

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/08/2021

O Relatório de Análise de Investimentos (RAI) apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e retorno. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações apresentadas foram extraídas dos relatórios de risco de mercado já produzidos pela ADITUS. A seguir, uma fotografia da alocação segregada por mandatos ou segmentos, de acordo com as especificações da Política de Investimentos.

VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	101.238.297,26	100%										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.				0,96%	2,64%	5,04%	6,37%	10,77%	14,61%	19,71%	
Renda Fixa Total Return	101.238.297,26	100%		0,95%	0,17%	0,50%	1,60%	1,73%	3,64%	7,68%	18,97%	
ATLANTIDA FI MULT	51.376.632,59	50,75%	ITAU	100%	0,69%	0,34%	1,02%	2,38%	2,64%	5,22%	10,09%	22,07%
ITAPEMA FI MULT	49.861.664,68	49,25%	TAG INVEST	100%	1,34%	0,00%	-0,03%	0,86%	0,84%	2,03%	4,81%	15,37%
Benchmark:	IPCA + 1.2% a.a.				0,98%	2,69%	5,15%	6,51%	10,99%	15,06%	20,42%	
Total	101.235.581,07	100%		0,95%	0,16%	0,49%	1,55%	1,69%	3,55%	7,38%	18,38%	
Benchmark:	IPCA + 1.2% a.a.				0,98%	2,69%	5,15%	6,51%	10,99%	15,06%	20,42%	

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.

O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

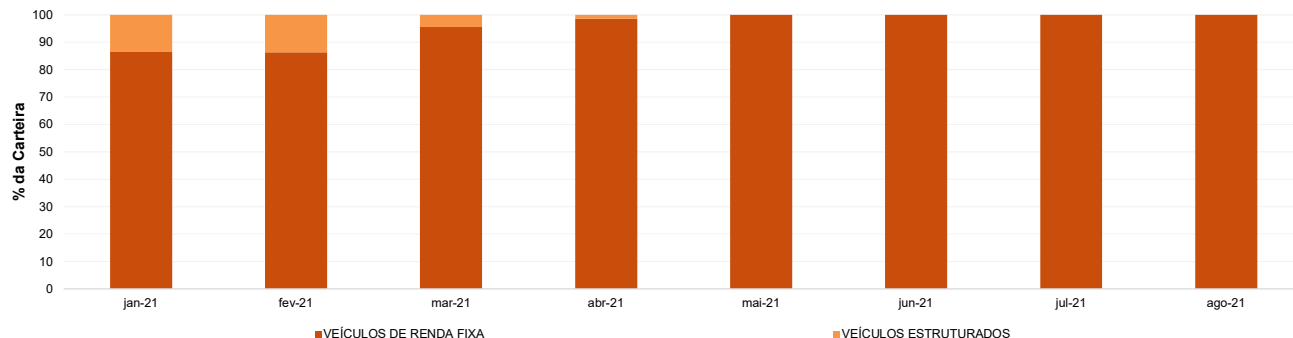
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

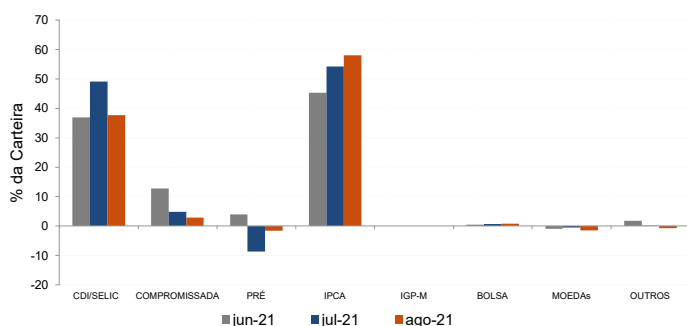
Distribuição da Carteira

O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

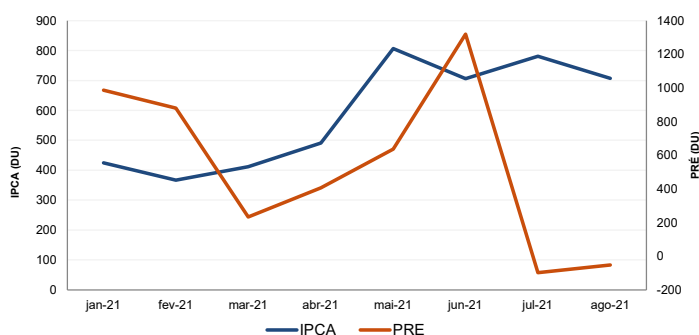
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Renda Variável

Essa seção abrange análises sobre a carteira de Renda Variável. Todas as informações sobre concentração são relativas ao total da carteira de Renda Variável do plano.

Maiores Exposições

A análise de maiores exposições apresenta as ações com maior participação na carteira, o setor ao qual pertencem e a evolução da posição em relação ao mês anterior.

Nome	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
BOVA11	Fundos	71,74	5,30	73,65	5,82
DESK3		70,42	5,20	0,90	0,07
PETRA	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	68,16	5,03	86,90	6,87
BRKM5	Químicos	63,98	4,72	53,06	4,19
BOVV11	Fundos	60,70	4,48	68,11	5,38
RECV3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	60,27	4,45	55,32	4,37
USIM5	Siderurgia e Metalurgia	56,37	4,16	41,82	3,31
BPAC11	Intermediários Financeiros	52,57	3,88	50,97	4,03
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	52,16	3,85	41,83	3,31
ASAI3	Comércio e Distribuição	50,98	3,76	48,14	3,81

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

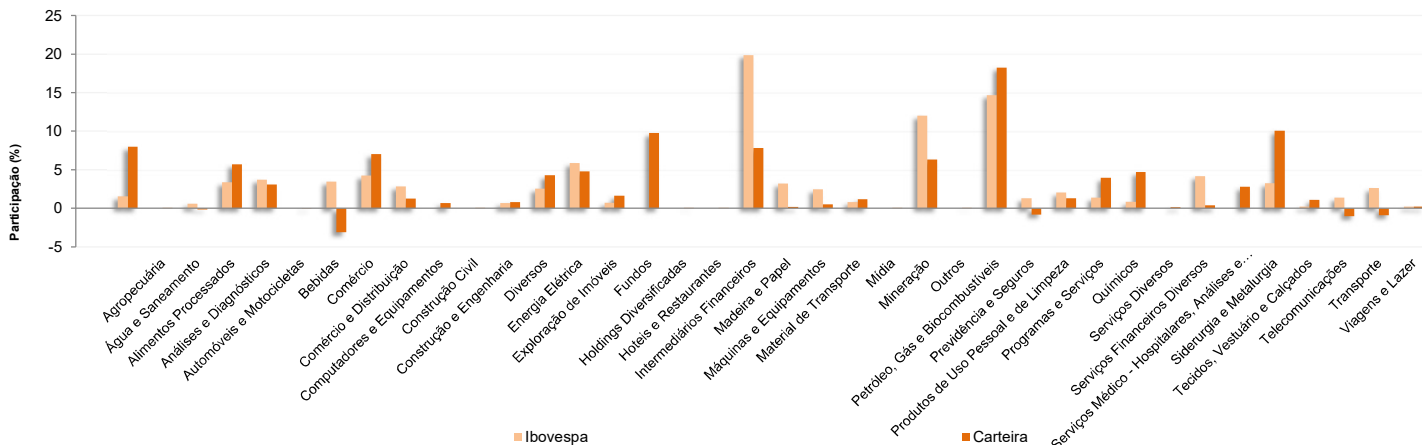
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
DESK3	70,42	5,20	0,01	1
PETRA	68,16	5,03	0,00	1
BRKM5	63,98	4,72	0,00	1
RECV3	60,27	4,45	0,00	1
USIM5	56,37	4,16	0,00	1
BPAC11	52,57	3,88	0,00	1
BRDT3	52,16	3,85	0,00	1
ASAI3	50,98	3,76	0,00	1
VALE3	50,05	3,69	0,00	1
CPL6	44,93	3,32	0,00	1

* em mil R\$

Concentração por setor

A concentração por setor segrega as ações da carteira em setores da Bovespa e compara os percentuais de alocação da carteira com os do benchmark de renda variável.



Análises de Contrapartes

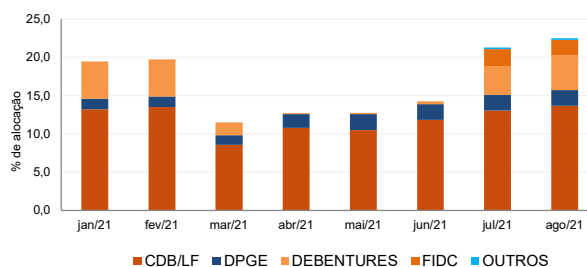
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	4.369,49	4,32	Faixa 1
BCO SAFRA SA	4.157,03	4,11	Faixa 1
BANCO C6 S.A.	2.072,23	2,05	Sem Faixa
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.160,43	1,15	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	924,83	0,91	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	752,35	0,74	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	551,08	0,54	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	412,20	0,41	Faixa 1
PORTOSEG S/A CREDITO, FINANCIAMENTO E INV	404,88	0,40	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	303,33	0,30	Faixa 1

* em mil R\$

Alocação Por Tipo de Crédito



Mudanças de Faixa de Risco de Crédito no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês. As alterações são checadas primeiro verificando a faixa correspondente da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Faixa Anterior	Faixa Atual	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
BRPRA7	103,58	BR PROPERTIES SA	Sem Faixa	Faixa 2	10-ago-26	CDI	1,88%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
BRPRA7	4,28	BR PROPERTIES SA	Sem Faixa	Faixa 2	10-ago-26	CDI	1,85%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
ECHP13	0,81	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	Sem Faixa	Faixa 3	30-jul-24	CDI	2,20%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
ITSA24	1,22	ITAUSA SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-jun-31	CDI	2,00%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
RDORB9	0,97	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-ago-31	CDI	1,90%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
RDORB9	75,46	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-ago-31	CDI	2,48%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/08/2021

Aquisições de Ativos no Mês

As tabelas a seguir apresentam os títulos adquiridos no último mês. Esses dados são extraídos dos arquivos XMLs da carteira e dos fundos com alocação direta. É apresentada a faixa de risco de crédito da emissão e, em caso de inexistência, apresenta-se a faixa do emissor.

Títulos Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
LF CDI	24-ago-23	450.564	0,45%	CDI	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVI	24-ago-21	1,30%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	14-fev-24	100.051	0,10%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	27-ago-21	1,40%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	22-fev-24	150.111	0,15%	CDI	BCO SAFRA SA	26-ago-21	1,20%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	14-mar-24	100.051	0,10%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	27-ago-21	1,40%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	26-ago-24	150.112	0,15%	CDI	BCO SAFRA SA	26-ago-21	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	26-ago-24	50.038	0,05%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	26-ago-21	1,30%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	26-ago-25	50.025	0,05%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	27-ago-21	1,40%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	01-set-25	100.027	0,10%	CDI	PORTOSEG S/A CREDITO, FINANCIAMEN	30-ago-21	1,80%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI Mensal	12-ago-26	100.352	0,10%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	12-ago-21	1,80%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	228.731	0,23%	IPCA		05-ago-21	2,00%	2,22%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	228.731	0,23%	IPCA		05-ago-21	1,99%	2,22%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	202.483	0,20%	IPCA		04-ago-21	2,02%	2,01%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	191.234	0,19%	IPCA		17-ago-21	2,35%	2,27%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	138.739	0,14%	IPCA		04-ago-21	2,04%	2,01%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	134.989	0,13%	IPCA		04-ago-21	2,03%	2,01%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	134.989	0,13%	IPCA		04-ago-21	2,06%	2,01%	ATLANTIDA FI MULT

