

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	ALOCÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	146.841.181,95	100%										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.				0,96%	2,64%	5,04%	6,37%	10,77%	14,61%	19,71%	
Renda Fixa Total Return	146.841.181,95	100%		1,83%	-0,27%	-0,57%	1,04%	1,17%	3,05%	6,85%	18,04%	
ATLANTIDA 2 FI MULT	73.222.947,85	49,87%	ITAU	100%	2,00%	-0,24%	-0,47%	-	-	-	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	73.618.234,10	50,13%	TAG INVEST	100%	1,70%	-0,30%	-0,67%	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 2.55% a.a.				1,09%	3,05%	5,87%	7,45%	12,47%	18,15%	25,27%	
Total	146.840.277,46	100%		1,83%	-0,27%	-0,58%	1,20%	0,68%	3,87%	6,94%	21,96%	
Benchmark:	IPCA + 2.55% a.a.				1,09%	3,05%	5,87%	7,45%	12,47%	18,15%	25,27%	

* 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.

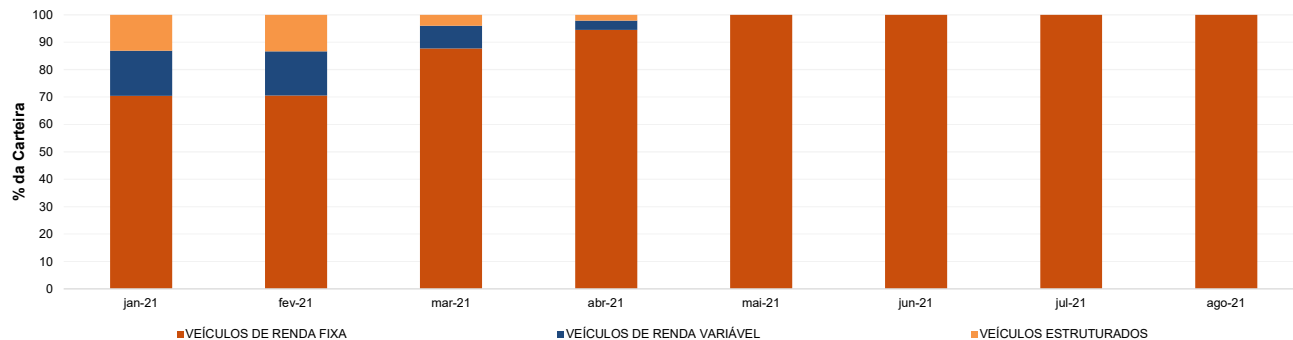
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

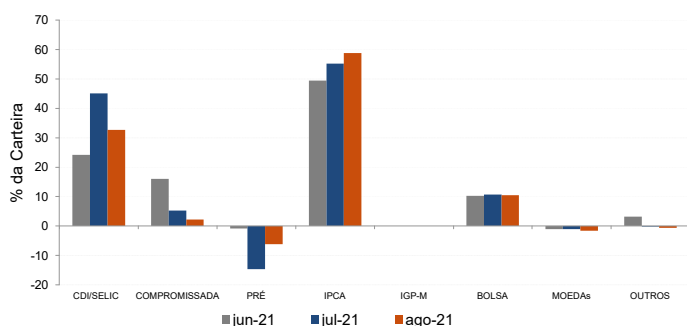
Distribuição da Carteira

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.

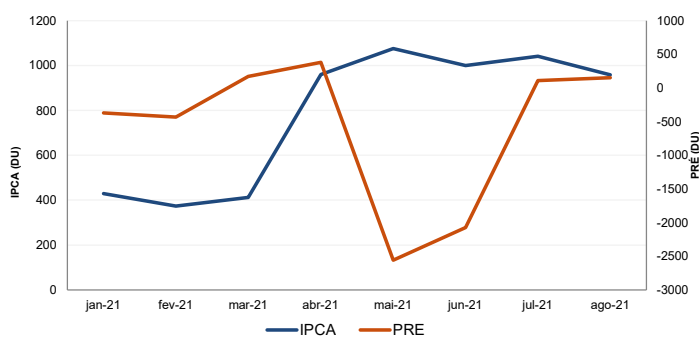
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
VALE3	Mineração	699,06	5,65	841,65	6,69
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	414,47	3,35	473,15	3,76
BBDC4	Intermediários Financeiros	412,25	3,33	381,34	3,03
ITUB4	Intermediários Financeiros	380,28	3,07	373,87	2,97
BPAC11	Intermediários Financeiros	323,33	2,61	432,98	3,44
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	314,98	2,55	306,60	2,44
ITSA4	Intermediários Financeiros	312,74	2,53	212,96	1,69
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	265,15	2,14	257,69	2,05
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	214,59	1,74	335,63	2,67
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	210,34	1,70	203,27	1,62

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

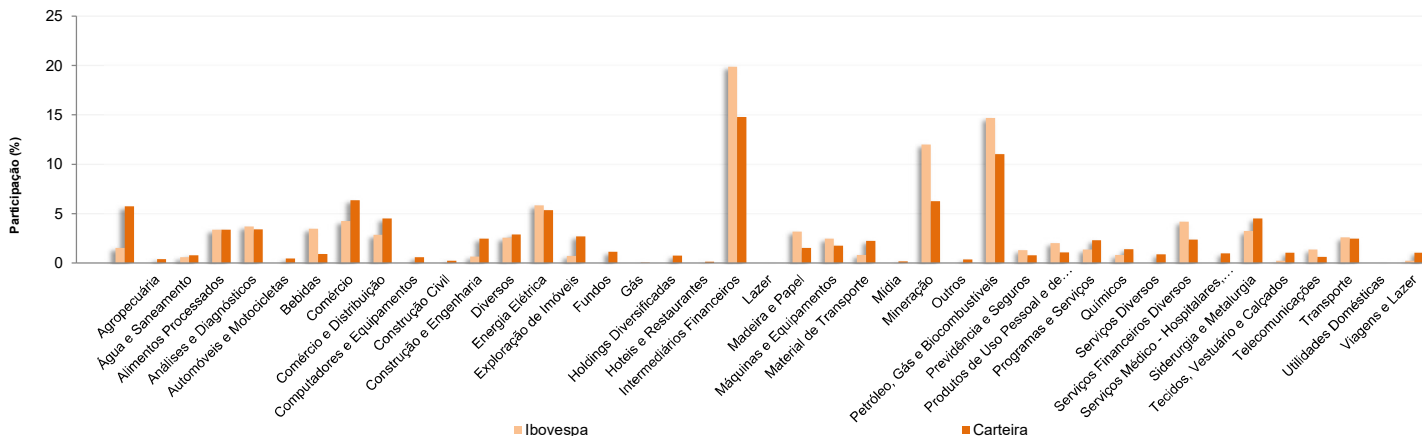
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BAUH4	22,92	0,19	0,02	12
VALE3	699,06	5,65	0,00	1
PETR4	414,47	3,35	0,00	1
BBDC4	412,25	3,33	0,00	1
ITUB4	380,28	3,07	0,00	1
BPAC11	323,33	2,61	0,00	1
PETR3	314,98	2,55	0,00	1
ITSA4	312,74	2,53	0,00	1
B3SA3	265,15	2,14	0,00	1
GGBR4	214,59	1,74	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

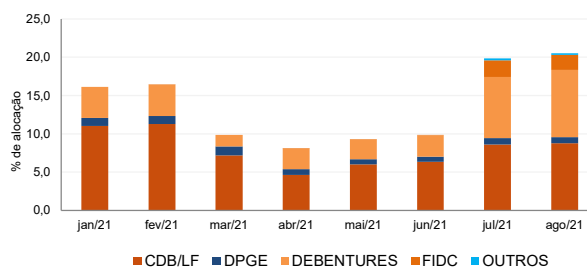
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	2.997,43	2,03	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.417,26	1,64	Faixa 1
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.209,17	1,50	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.879,39	1,28	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	1.765,44	1,20	Faixa 2
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.033,23	0,70	Faixa 4
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	958,35	0,65	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	832,81	0,57	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	803,26	0,55	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	729,65	0,50	Faixa 2

* 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	154,63	BR PROPERTIES SA	Sem Faixa	Faixa 2	10-ago-26	CDI	1,88%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
BRPRA7	6,39	BR PROPERTIES SA	Sem Faixa	Faixa 2	10-ago-26	CDI	1,85%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
BRPRA7	5,47	BR PROPERTIES SA	Sem Faixa	Faixa 2	10-ago-26	CDI	1,88%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
CEED11	72,17	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRIC/	Sem Faixa	Faixa 2	15-ago-26	CDI	1,51%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
ECHP13	1,23	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	Sem Faixa	Faixa 3	30-jul-24	CDI	2,20%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
ITSA24	41,25	ITAUSA SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-jun-31	CDI	2,06%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
ITSA24	1,84	ITAUSA SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-jun-31	CDI	2,00%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
RDORB9	112,65	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-ago-31	CDI	2,48%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
RDORB9	145,06	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-ago-31	CDI	2,48%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
RDORB9	1,47	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-ago-31	CDI	1,90%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	200.251	0,14%	CDI	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVI	24-ago-21	1,30%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	22-fev-24	200.148	0,14%	CDI	BCO SAFRA SA	26-ago-21	1,20%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	26-ago-24	200.149	0,14%	CDI	BCO SAFRA SA	26-ago-21	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	26-ago-24	50.038	0,03%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	26-ago-21	1,30%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	26-ago-25	50.025	0,03%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	27-ago-21	1,40%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-03-01	01-mar-23	241.240	0,16%	Selic		18-ago-21	0,12%	0,12%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	120.620	0,08%	Selic		25-ago-21	0,11%	0,10%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	65.793	0,04%	Selic		30-ago-21	0,10%	0,10%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	54.827	0,04%	Selic		23-ago-21	0,11%	0,11%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	43.862	0,03%	Selic		09-ago-21	0,12%	0,12%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	963.145	0,65%	Selic		16-ago-21	0,16%	0,16%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	442.464	0,30%	IPCA		05-ago-21	1,99%	2,22%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	438.714	0,30%	IPCA		05-ago-21	2,00%	2,22%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	378.719	0,26%	IPCA		04-ago-21	2,02%	2,01%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	251.229	0,17%	IPCA		04-ago-21	2,04%	2,01%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	251.229	0,17%	IPCA		04-ago-21	2,03%	2,01%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	247.480	0,17%	IPCA		04-ago-21	2,06%	2,01%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	119.990	0,08%	IPCA		17-ago-21	2,35%	2,27%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	45.798	0,03%	IPCA		18-ago-21	4,21%	4,37%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	151.491	0,10%	IPCA		17-ago-21	4,49%	4,50%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	141.997	0,10%	IPCA		17-ago-21	4,67%	4,63%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	39.444	0,03%	IPCA		11-ago-21	4,39%	4,41%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	19.722	0,01%	IPCA		20-ago-21	4,80%	4,66%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	11.833	0,01%	IPCA		20-ago-21	4,80%	4,66%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	292.067	0,20%	IPCA		17-ago-21	4,73%	4,72%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	88.020	0,06%	IPCA		11-ago-21	4,47%	4,48%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	80.018	0,05%	IPCA		18-ago-21	4,73%	4,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	16.004	0,01%	IPCA		11-ago-21	4,49%	4,48%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	16.004	0,01%	IPCA		20-ago-21	4,88%	4,74%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	16.004	0,01%	IPCA		20-ago-21	4,85%	4,74%	ATLANTIDA 2 FI MULT