

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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 | 255.849.342,10 | 100% | | | | -0,05% | -0,02% | 1,43% | 1,62% | 3,60% | 7,55% | 18,69% |
| Benchmark: | IPCA + 1% a.a. | | | | | 0,96% | 2,64% | 5,04% | 6,37% | 10,77% | 14,61% | 19,71% |
| Renda Fixa Total Return - Perfil Moderado | 146.841.181,95 | 57,39% | | | 1,83% | -0,27% | -0,57% | 1,04% | 1,17% | 3,05% | 6,85% | 18,04% |
| ATLANTIDA 2 FI MULT | 73.222.947,85 | 28,62% | ITAU | 100% | 2,00% | -0,24% | -0,47% | - | - | - | - | - |
| ITAPEMA 2 FI MULT | 73.618.234,10 | 28,77% | 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% |
| Renda Fixa Total Return - Perfil Conservador | 101.238.297,26 | 39,57% | | | 0,95% | 0,17% | 0,50% | 1,60% | 1,73% | 3,64% | 7,68% | 18,97% |
| ATLANTIDA FI MULT | 51.376.632,59 | 20,08% | 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 | 19,49% | 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% |
| Renda Fixa ALM | 6.667.577,46 | 2,61% | | | 0,02% | | | | | | | |
| RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF | 6.667.577,46 | 2,61% | | 100% | 0,02% | 1,39% | 3,99% | 8,06% | 10,47% | 16,53% | 27,39% | 40,32% |
| Benchmark: | IPCA + 4,39% a.a. | | | | | 1,25% | 3,52% | 6,83% | 8,73% | 14,48% | 22,41% | 32,10% |
| Renda Fixa CDI | 1.102.285,42 | 0,43% | | | 0,02% | 0,44% | 1,16% | 1,76% | 2,36% | 3,00% | 4,40% | 11,49% |
| BRAM FI RF REF DI FEDERAL II | 1.102.285,42 | 0,43% | BRADESCO | 0,02% | 0,02% | 0,44% | 1,16% | 1,80% | 2,06% | 2,52% | 6,41% | 13,04% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,42% | 1,09% | 1,77% | 2,06% | 2,70% | 6,68% | 13,38% |
| Total | 255.844.101,34 | 100% | | | 1,41% | -0,05% | -0,02% | 1,73% | 1,55% | 4,39% | 7,79% | 20,30% |
| Benchmark: | IPCA + 4,39% a.a. | | | | | 1,25% | 3,52% | 6,83% | 8,73% | 14,48% | 22,41% | 32,10% |

* 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.

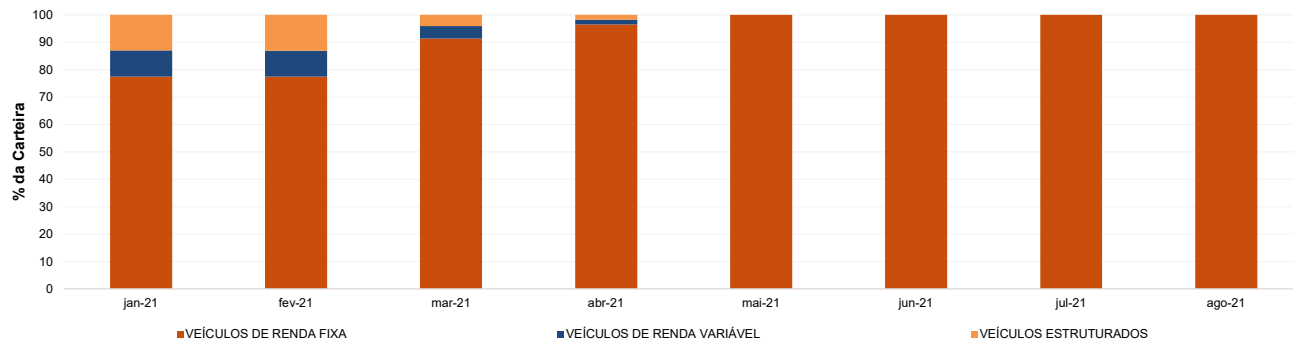
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

Distribuição da Carteira

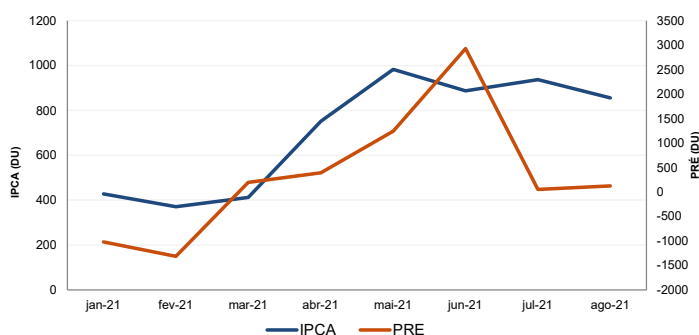
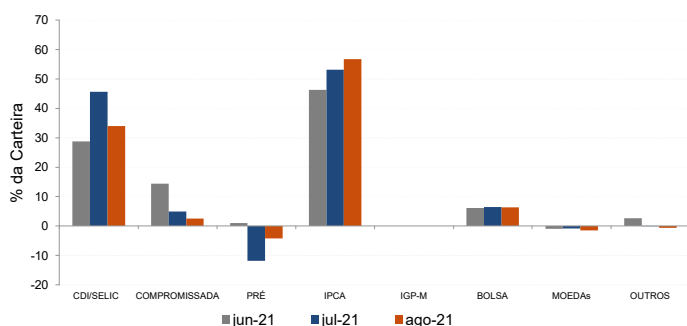
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais 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 | 749,10 | 5,46 | 927,79 | 6,70 |
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 482,63 | 3,52 | 560,05 | 4,04 |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 404,56 | 2,95 | 383,14 | 2,77 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 400,21 | 2,92 | 393,93 | 2,84 |
| BPAC11 | Intermediários Financeiros | 375,91 | 2,74 | 483,95 | 3,49 |
| PETR3 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 346,77 | 2,53 | 335,48 | 2,42 |
| ITSA4 | Intermediários Financeiros | 332,74 | 2,42 | 220,48 | 1,59 |
| B3SA3 | Serviços Financeiros Diversos | 281,17 | 2,05 | 280,15 | 2,02 |
| BRDT3 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 262,51 | 1,91 | 245,10 | 1,77 |
| GGBR4 | Siderurgia e Metalurgia | 228,09 | 1,66 | 341,12 | 2,46 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

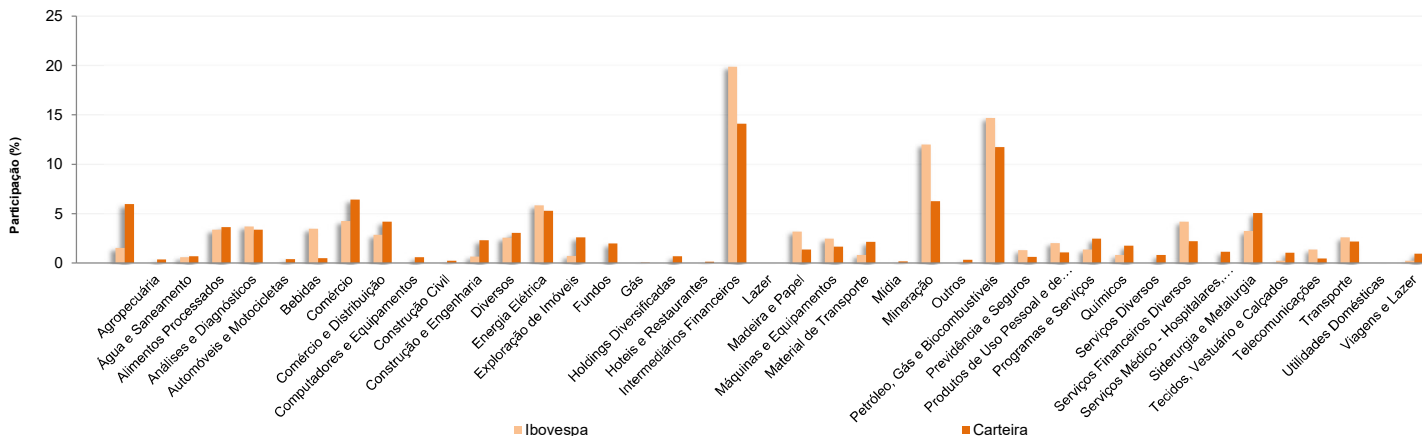
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|--------|--------|------|--------------|--------------------|
| BAUH4 | 22,92 | 0,17 | 0,02 | 12 |
| VALE3 | 749,10 | 5,46 | 0,00 | 1 |
| PETR4 | 482,63 | 3,52 | 0,00 | 1 |
| BBDC4 | 404,56 | 2,95 | 0,00 | 1 |
| ITUB4 | 400,21 | 2,92 | 0,00 | 1 |
| BPAC11 | 375,91 | 2,74 | 0,00 | 1 |
| PETR3 | 346,77 | 2,53 | 0,00 | 1 |
| ITSA4 | 332,74 | 2,42 | 0,00 | 1 |
| B3SA3 | 281,17 | 2,05 | 0,00 | 1 |
| BRDT3 | 262,51 | 1,91 | 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.



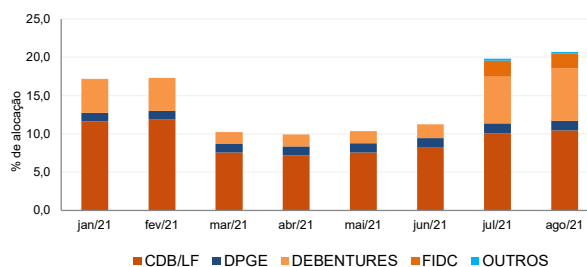
Análises de Contrapartes

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 SAFRA SA | 6.574,30 | 2,56 | Faixa 1 |
| BCO ITAU SA | 6.248,88 | 2,44 | Faixa 1 |
| BCO BRADESCO SA | 3.922,26 | 1,53 | Faixa 1 |
| ESTACIO PARTICIPACOES SA | 2.209,17 | 0,86 | Faixa 1 |
| BANCO C6 S.A. | 2.181,26 | 0,85 | Sem Faixa |
| BCO DAYCOVAL SA | 1.865,82 | 0,73 | Faixa 2 |
| BANCO VOTORANTIM S.A. | 1.555,61 | 0,61 | Faixa 2 |
| BCO TOYOTA BRASIL SA | 1.261,86 | 0,49 | Faixa 1 |
| OMNI SA CRED FINANCI INVEST | 1.033,23 | 0,40 | Faixa 4 |
| COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS | 978,44 | 0,38 | 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 | 103,58 | BR PROPERTIES SA | Sem Faixa | Faixa 2 | 10-ago-26 | CDI | 1,88% | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R |
| BRPRA7 | 5,47 | BR PROPERTIES SA | Sem Faixa | Faixa 2 | 10-ago-26 | CDI | 1,88% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| BRPRA7 | 4,28 | BR PROPERTIES SA | Sem Faixa | Faixa 2 | 10-ago-26 | CDI | 1,85% | AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV |
| BRPRA7 | 6,39 | BR PROPERTIES SA | Sem Faixa | Faixa 2 | 10-ago-26 | CDI | 1,85% | AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV |
| BRPRA7 | 154,63 | BR PROPERTIES SA | Sem Faixa | Faixa 2 | 10-ago-26 | CDI | 1,88% | CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R |
| 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 | 0,81 | ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA | Sem Faixa | Faixa 3 | 30-jul-24 | CDI | 2,20% | LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT |
| 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 | 1,22 | ITAUSA SA | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-jun-31 | CDI | 2,00% | LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT |
| ITSA24 | 1,84 | ITAUSA SA | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-jun-31 | CDI | 2,00% | LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT |
| RDORB9 | 1,47 | REDE D OR SAO LUIZ SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 20-ago-31 | CDI | 1,90% | 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 | 75,46 | 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 | 0,97 | REDE D OR SAO LUIZ SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 20-ago-31 | CDI | 1,90% | LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT |

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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 | 0,18% | CDI | BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVI | 24-ago-21 | 1,30% | Faixa 2 | ATLANTIDA FI MULT |
| LF CDI | 24-ago-23 | 200.251 | 0,08% | CDI | BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVI | 24-ago-21 | 1,30% | Faixa 2 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 14-fev-24 | 100.051 | 0,04% | CDI | BANCO VOTORANTIM S.A. | 27-ago-21 | 1,40% | Faixa 2 | ATLANTIDA FI MULT |
| LF CDI | 22-fev-24 | 200.148 | 0,08% | CDI | BCO SAFRA SA | 26-ago-21 | 1,20% | Faixa 1 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 22-fev-24 | 150.111 | 0,06% | CDI | BCO SAFRA SA | 26-ago-21 | 1,20% | Faixa 1 | ATLANTIDA FI MULT |
| LF CDI | 14-mar-24 | 100.051 | 0,04% | CDI | BANCO VOTORANTIM S.A. | 27-ago-21 | 1,40% | Faixa 2 | ATLANTIDA FI MULT |
| LF CDI | 26-ago-24 | 200.149 | 0,08% | CDI | BCO SAFRA SA | 26-ago-21 | 1,25% | Faixa 1 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 26-ago-24 | 150.112 | 0,06% | CDI | BCO SAFRA SA | 26-ago-21 | 1,25% | Faixa 1 | ATLANTIDA FI MULT |
| LF CDI | 26-ago-24 | 50.038 | 0,02% | CDI | BCO ABC BRASIL SA | 26-ago-21 | 1,30% | Faixa 2 | ATLANTIDA FI MULT |
| LF CDI | 26-ago-24 | 50.038 | 0,02% | CDI | BCO ABC BRASIL SA | 26-ago-21 | 1,30% | Faixa 2 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 26-ago-25 | 50.025 | 0,02% | CDI | BCO VOLKSWAGEN SA | 27-ago-21 | 1,40% | Faixa 1 | ATLANTIDA FI MULT |
| LF CDI | 26-ago-25 | 50.025 | 0,02% | CDI | BCO VOLKSWAGEN SA | 27-ago-21 | 1,40% | Faixa 1 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 01-set-25 | 100.027 | 0,04% | CDI | PORTOSEG S/A CREDITO, FINANCIAMEN | 30-ago-21 | 1,80% | Faixa 2 | ATLANTIDA FI MULT |
| LF CDI Mensal | 12-ago-26 | 100.352 | 0,04% | 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 |
|------------------|------------|---------|-----------------|-----------|--|-------------|--------------|----------------|------------------------------|
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 2.820 | 0,00% | Selic | | 19-ago-21 | 5,00% | 0,05% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 241.240 | 0,09% | Selic | | 18-ago-21 | 0,12% | 0,12% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 120.620 | 0,05% | Selic | | 25-ago-21 | 0,11% | 0,10% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 65.793 | 0,03% | Selic | | 30-ago-21 | 0,10% | 0,10% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 54.827 | 0,02% | Selic | | 23-ago-21 | 0,11% | 0,11% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 43.862 | 0,02% | Selic | | 09-ago-21 | 0,12% | 0,12% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 963.145 | 0,38% | Selic | | 16-ago-21 | 0,16% | 0,16% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 24.603 | 0,01% | Selic | | 30-ago-21 | 0,17% | 0,17% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 442.464 | 0,17% | IPCA | | 05-ago-21 | 1,99% | 2,22% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 438.714 | 0,17% | IPCA | | 05-ago-21 | 2,00% | 2,22% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 378.719 | 0,15% | IPCA | | 04-ago-21 | 2,02% | 2,01% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 251.229 | 0,10% | IPCA | | 04-ago-21 | 2,04% | 2,01% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 251.229 | 0,10% | IPCA | | 04-ago-21 | 2,03% | 2,01% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 247.480 | 0,10% | IPCA | | 04-ago-21 | 2,06% | 2,01% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 228.731 | 0,09% | IPCA | | 05-ago-21 | 2,00% | 2,22% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 228.731 | 0,09% | IPCA | | 05-ago-21 | 1,99% | 2,22% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 202.483 | 0,08% | IPCA | | 04-ago-21 | 2,02% | 2,01% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 191.234 | 0,07% | IPCA | | 17-ago-21 | 2,35% | 2,27% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 138.739 | 0,05% | IPCA | | 04-ago-21 | 2,04% | 2,01% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 134.989 | 0,05% | IPCA | | 04-ago-21 | 2,06% | 2,01% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 134.989 | 0,05% | IPCA | | 04-ago-21 | 2,03% | 2,01% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 119.990 | 0,05% | IPCA | | 17-ago-21 | 2,35% | 2,27% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2024-08-15 | 15-ago-24 | 45.798 | 0,02% | IPCA | | 18-ago-21 | 4,21% | 4,37% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2026-08-15 | 15-ago-26 | 151.491 | 0,06% | IPCA | | 17-ago-21 | 4,49% | 4,50% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2028-08-15 | 15-ago-28 | 141.997 | 0,06% | IPCA | | 17-ago-21 | 4,67% | 4,63% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2028-08-15 | 15-ago-28 | 39.444 | 0,02% | 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 | 0,00% | IPCA | | 20-ago-21 | 4,80% | 4,66% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2030-08-15 | 15-ago-30 | 292.067 | 0,11% | IPCA | | 17-ago-21 | 4,73% | 4,72% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2030-08-15 | 15-ago-30 | 88.020 | 0,03% | IPCA | | 11-ago-21 | 4,47% | 4,48% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2030-08-15 | 15-ago-30 | 80.018 | 0,03% | 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 | | 20-ago-21 | 4,85% | 4,74% | 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 |