

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/12/2021

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>101.135.213,41</b>	<b>100%</b>										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,82%	3,21%	6,60%	11,16%	11,16%	17,34%	23,62%
<b>Multiestatégia</b>	<b>101.135.213,41</b>	<b>100%</b>			<b>1,06%</b>	<b>0,65%</b>	<b>1,26%</b>	<b>2,49%</b>	<b>3,80%</b>	<b>3,80%</b>	<b>6,97%</b>	<b>17,38%</b>
ATLANTIDA FI MULT	51.540.749,10	50,96%	ITAU	100%	0,78%	0,61%	1,41%	3,34%	5,14%	5,14%	9,63%	20,61%
ITAPEMA FI MULT	49.594.464,31	49,04%	TAG INVEST	100%	1,45%	0,69%	1,10%	1,62%	2,48%	2,48%	3,90%	13,65%
Benchmark:	IPCA + 1.2% a.a.					0,84%	3,27%	6,71%	11,38%	11,38%	17,80%	24,35%
<b>Total</b>	<b>101.132.501,68</b>	<b>100%</b>			<b>1,06%</b>	<b>0,65%</b>	<b>1,25%</b>	<b>2,47%</b>	<b>3,76%</b>	<b>3,76%</b>	<b>6,64%</b>	<b>16,96%</b>
Benchmark:	IPCA + 1.2% a.a.					0,84%	3,27%	6,71%	11,38%	11,38%	17,80%	24,35%

\* 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.

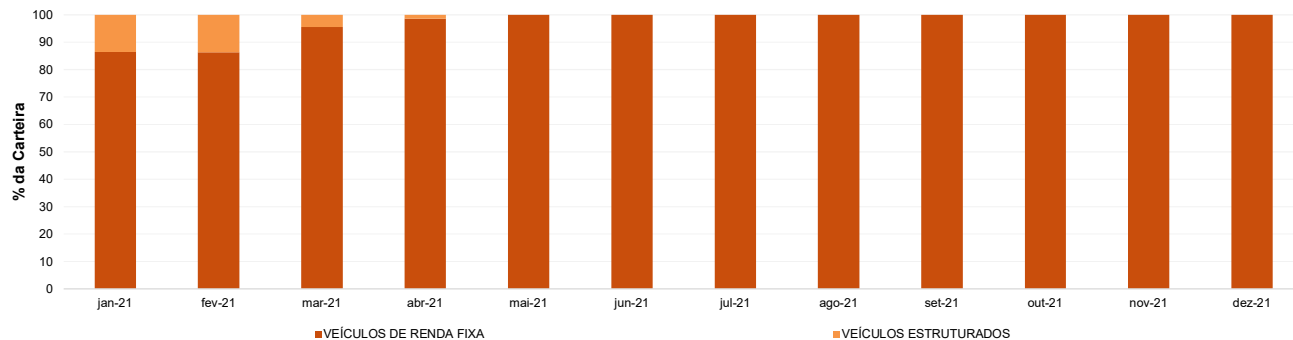
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

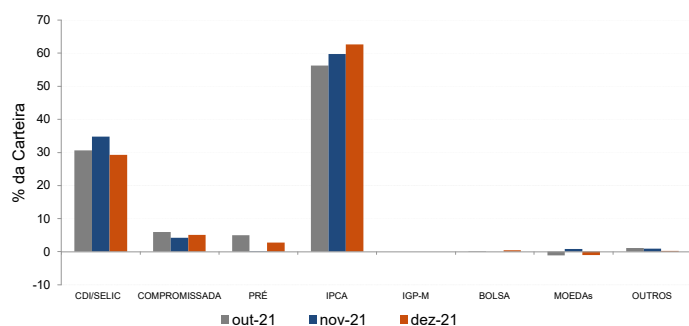
## Distribuição da Carteira

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.

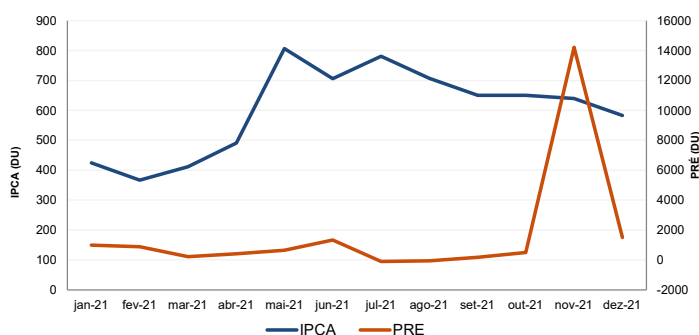
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	158,28	15,16	126,95	12,29
SUZB3	Madeira e Papel	81,56	7,81	44,41	4,30
BOVA11	Fundos	80,55	7,71	76,09	7,36
BRAP4	Mineração	75,52	7,23	66,05	6,39
BOVV11	Fundos	74,89	7,17	60,65	5,87
USIM5	Siderurgia e Metalurgia	61,79	5,92	47,82	4,63
ITUB4	Intermediários Financeiros	47,24	4,52	61,93	5,99
GNDI3	Análises e Diagnósticos	44,80	4,29	17,56	1,70
DIRR3	Construção e Engenharia	40,90	3,92	33,91	3,28
RECV3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	35,94	3,44	28,33	2,74

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

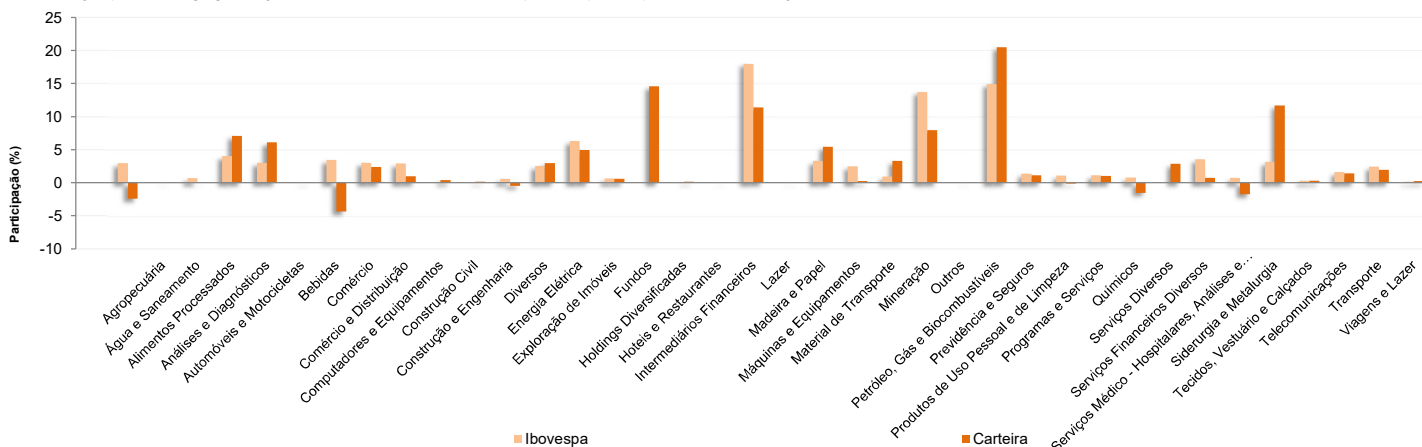
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PETR4	158,28	15,16	0,00	1
SUZB3	81,56	7,81	0,00	1
BRAP4	75,52	7,23	0,00	1
USIM5	61,79	5,92	0,00	1
ITUB4	47,24	4,52	0,00	1
GNDI3	44,80	4,29	0,00	1
DIRR3	40,90	3,92	0,00	1
RECV3	35,94	3,44	0,00	1
JBSS3	35,60	3,41	0,00	1
EMBR3	34,62	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

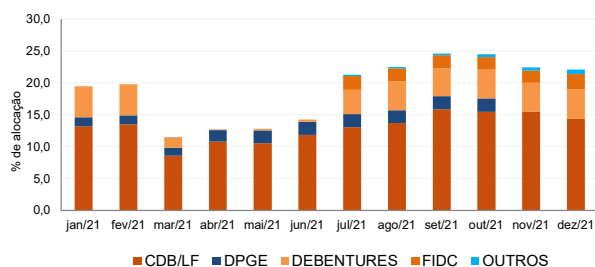
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	6.006,90	5,96	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.757,97	2,73	Faixa 1
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.156,50	1,15	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	944,55	0,94	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	754,80	0,75	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	551,78	0,55	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	414,18	0,41	Faixa 1
PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	411,52	0,41	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	395,24	0,39	Faixa 1
APICE SECURITIZADORA IMOBILIARIA SA	389,63	0,39	Sem Faixa

\* 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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/12/2021

## 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
EQTL15	15-dez-26	81.729	0,08%	CDI	EQUATORIAL ENERGIA SA	23-dez-21	1,55%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	13-dez-24	150.860	0,15%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	13-dez-21	1,55%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
SBSPD9	15-dez-26	106.236	0,11%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	23-dez-21	1,39%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
SMFT16	21-dez-28	111.414	0,11%	CDI	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA S/	23-dez-21	2,63%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
VBBR14	16-nov-28	52.027	0,05%	CDI	VIBRA ENERGIA SA	02-dez-21	1,45%	Faixa 1	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	73.507	0,07%	IPCA	03-dez-21	4,64%	4,72%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	34.819	0,03%	IPCA	09-dez-21	4,77%	5,22%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.736.517	1,72%	IPCA	16-dez-21	5,62%	5,73%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	248.620	0,25%	IPCA	23-dez-21	5,76%	5,81%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	202.721	0,20%	IPCA	16-dez-21	5,61%	5,73%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	183.597	0,18%	IPCA	03-dez-21	5,03%	4,90%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	152.997	0,15%	IPCA	22-dez-21	5,75%	5,81%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	149.172	0,15%	IPCA	16-dez-21	5,62%	5,73%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	145.347	0,14%	IPCA	29-dez-21	5,74%	5,72%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	141.522	0,14%	IPCA	22-dez-21	5,74%	5,81%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	122.398	0,12%	IPCA	23-dez-21	5,76%	5,81%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	114.748	0,11%	IPCA	28-dez-21	5,77%	5,69%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	114.748	0,11%	IPCA	28-dez-21	5,80%	5,69%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	110.923	0,11%	IPCA	22-dez-21	5,78%	5,81%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	99.448	0,10%	IPCA	29-dez-21	5,75%	5,72%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	42.074	0,04%	IPCA	23-dez-21	5,75%	5,81%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	42.074	0,04%	IPCA	09-dez-21	4,96%	5,42%	ATLANTIDA FI MULT

