

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 29/01/2021

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	89.253.607,91	86,48%										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,33%	2,76%	4,82%	0,33%	5,59%	11,12%	16,46%
Renda Fixa Total Return	89.253.607,91	86,48%			0,38%	0,15%	1,93%	2,36%	0,15%	2,84%	11,86%	20,81%
ATLANTIDA FI MULT	50.746.685,37	49,17%	ITAU	46,93%	0,56%	0,19%	2,21%	2,96%	0,19%	3,97%	13,36%	23,80%
ITAPEMA FI MULT	38.506.922,55	37,31%	SUL AMERICA	43,26%	0,17%	0,11%	1,61%	1,70%	0,11%	1,26%	9,82%	17,40%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,33%	2,76%	4,82%	0,33%	5,59%	11,12%	16,46%
Estruturado	13.953.551,03	13,52%										
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,38%	1,20%	2,43%	0,38%	5,57%	15,05%	26,04%
Multimercado Estruturado	13.953.551,03	13,52%			1,49%	-0,75%	1,89%	1,20%	-0,75%	1,06%	9,55%	16,01%
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	2.841.930,11	2,75%	ABSOLUTE	0,30%	0,64%	-0,02%	0,23%	0,26%	-0,02%	1,37%	10,14%	20,35%
AZ QUEST MULT FC FI MULT	1.074.822,98	1,04%	AZ QUEST	0,14%	0,94%	-1,01%	0,31%	-0,51%	-1,01%	0,59%	9,34%	18,73%
ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	1.572.426,42	1,52%	ITAU	0,03%	1,38%	-0,28%	2,19%	1,81%	-0,28%	3,03%	11,81%	26,03%
KINEA CHRONOS FI MULT	8.464.371,51	8,20%	KINEA	0,14%	2,01%	-1,00%	2,48%	1,50%	-1,00%	0,39%	8,72%	19,77%
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,38%	1,20%	2,43%	0,38%	5,57%	15,05%	26,04%
Total	103.202.846,12	100%			0,50%	0,03%	1,91%	2,15%	0,03%	2,40%	11,30%	19,96%
Benchmark:	IPCA + 1,2% a.a.					0,34%	2,81%	4,92%	0,34%	5,80%	11,56%	17,15%

* 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.

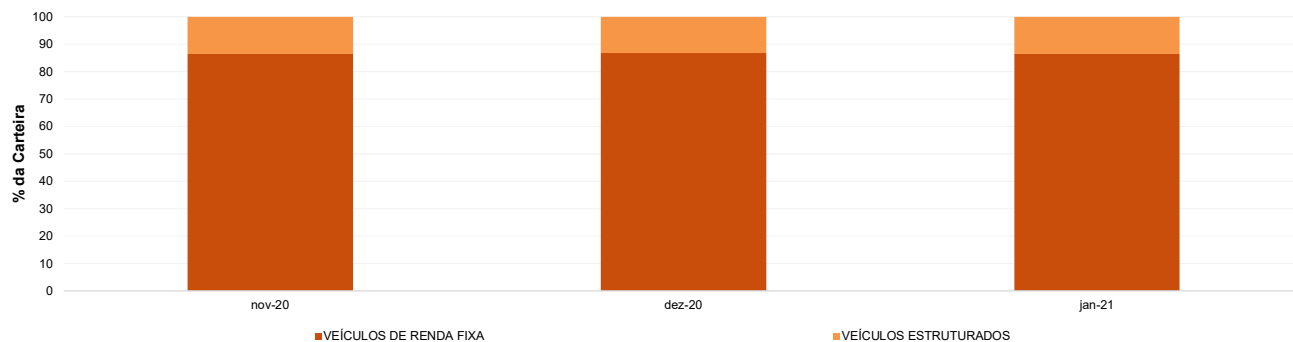
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

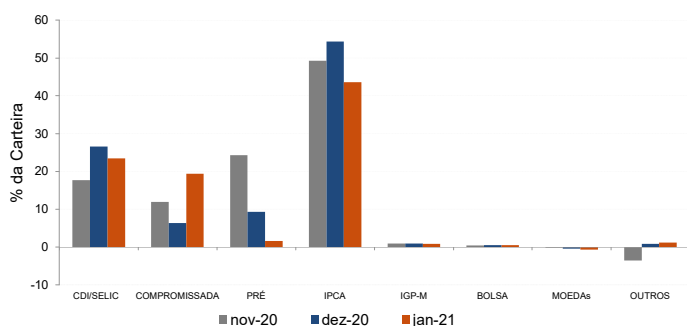
Distribuição da Carteira

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.

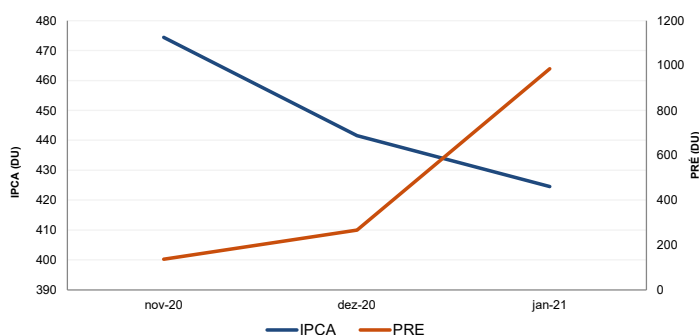
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
LINX3	Programas e Serviços	158,54	16,82	170,53	18,94
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	72,46	7,69	74,28	8,25
SUZB3	Madeira e Papel	57,16	6,07	23,06	2,56
LCAM3	Diversos	53,98	5,73	65,78	7,31
VALE3	Mineração	52,63	5,58	87,92	9,76
IGTA3	Exploração de Imóveis	50,68	5,38	26,41	2,93
CPLE3	Energia Elétrica	38,92	4,13	36,70	4,08
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	31,83	3,38	25,40	2,82
BBDC3	Intermediários Financeiros	31,77	3,37	25,29	2,81
ALUP11	Energia Elétrica	29,75	3,16	35,80	3,98

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

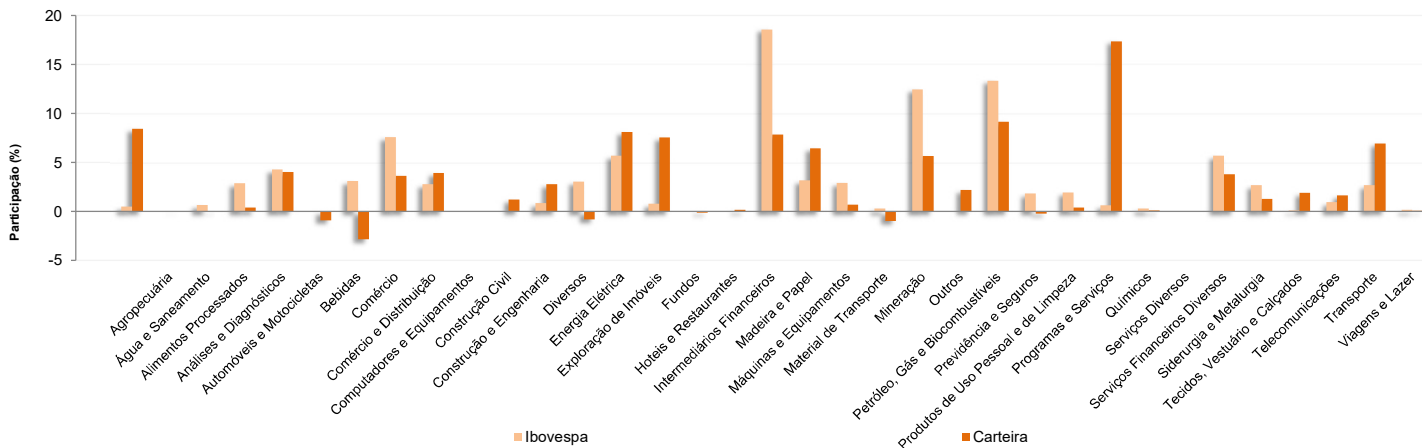
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
ESPA3	7,64	0,81	0,00	Sem Liquidez
LINX3	158,54	16,82	0,00	1
PETR3	72,46	7,69	0,00	1
SUZB3	57,16	6,07	0,00	1
LCAM3	53,98	5,73	0,00	1
VALE3	52,63	5,58	0,00	1
IGTA3	50,68	5,38	0,00	1
CPLE3	38,92	4,13	0,00	1
B3SA3	31,83	3,38	0,00	1
BBDC3	31,77	3,37	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

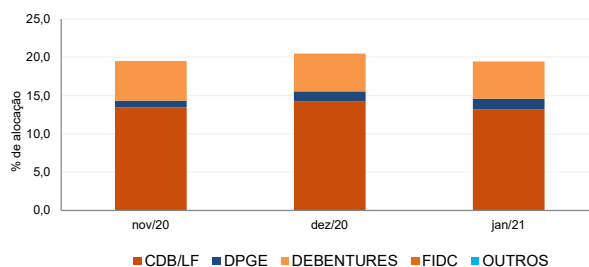
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	3.473,57	3,36	Faixa 2
BCO ITAU SA	2.821,89	2,73	Faixa 2
BCO BRASIL SA	2.495,08	2,41	Faixa 2
BCO SAFRA SA	2.066,36	2,00	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.349,75	1,30	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.036,13	1,00	Faixa 1
BCO VOTORANTIM SA	1.020,72	0,99	Faixa 2
BCO DAYCOVAL SA	962,74	0,93	Faixa 2
BANCO C6 S.A.	946,02	0,91	Sem Faixa
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	673,26	0,65	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 29/01/2021

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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2021-03-01	01-mar-21	364.091	0,35%	Selic	20-jan-21	0,08%	0,07%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	368.965	0,36%	Selic	18-jan-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	105.592	0,10%	IPCA	27-jan-21	1,94%	-2,10%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	30.169	0,03%	IPCA	12-jan-21	1,33%	-2,15%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	694.606	0,67%	IPCA	21-jan-21	0,28%	0,37%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	152.957	0,15%	IPCA	19-jan-21	0,17%	0,23%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	134.962	0,13%	IPCA	08-jan-21	0,12%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	14.396	0,01%	IPCA	19-jan-21	0,19%	0,23%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	83.038	0,08%	IPCA	21-jan-21	2,19%	2,27%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	30.195	0,03%	IPCA	12-jan-21	2,17%	2,11%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	28.702	0,03%	IPCA	21-jan-21	4,06%	4,11%	ATLANTIDA FI MULT

