

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	107.888.081,24	70,45%										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,33%	2,76%	4,82%	0,33%	5,59%	11,12%	16,46%
Renda Fixa Total Return	107.888.081,24	70,45%			0,36%	0,15%	1,93%	2,34%	0,15%	2,63%	11,61%	20,42%
ATLANTIDA FI MULT	57.387.545,53	37,47%	ITAU	53,07%	0,56%	0,19%	2,21%	2,96%	0,19%	3,97%	13,36%	23,80%
ITAPEMA FI MULT	50.500.535,70	32,97%	SUL AMERICA	56,74%	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%
Renda Variável	25.181.819,83	16,44%										
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					-3,09%	23,37%	13,46%	-3,09%	4,15%	25,31%	48,01%
Renda Variável Ativa	25.181.819,83	16,44%			8,98%	-1,29%	15,84%	9,19%	-1,29%	-6,09%	21,82%	45,00%
AZ QUEST ACOES FC FIA	3.396.593,52	2,22%	AZ QUEST	0,45%	10,67%	-2,64%	14,42%	4,55%	-2,64%	-9,84%	12,05%	33,40%
BRADESCO FIA SELECTION	3.476.424,45	2,27%	BRADESCO	0,44%	10,96%	-2,48%	13,85%	13,11%	-2,48%	-4,84%	13,16%	33,95%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	10.052.152,80	6,56%	BTG PACTUAL	0,37%	8,35%	-0,62%	13,66%	7,92%	-0,62%	5,08%	38,70%	67,53%
ITAU ACOES DUNAMIS INSTITUCIONAL FC	4.377.976,21	2,86%	ITAU	2,03%	8,76%	-1,47%	18,11%	12,04%	-1,47%	-	-	-
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	3.878.672,84	2,53%	NEO GESTAO	0,60%	8,01%	-0,51%	13,90%	16,50%	-0,51%	1,24%	41,42%	47,33%
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					-3,09%	23,37%	13,46%	-3,09%	4,15%	25,31%	48,01%
Estruturado	20.082.256,01	13,11%										
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,38%	1,20%	2,43%	0,38%	5,57%	15,05%	26,04%
Multimercado Estruturado	20.082.256,01	13,11%			1,48%	-0,76%	1,97%	1,22%	-0,76%	1,70%	10,00%	16,52%
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	2.696.529,63	1,76%	ABSOLUTE	0,28%	0,64%	-0,02%	0,23%	0,26%	-0,02%	1,37%	10,14%	20,35%
AZ QUEST MULT FC FI MULT	3.059.564,18	2,00%	AZ QUEST	0,40%	0,94%	-1,01%	0,31%	-0,51%	-1,01%	0,59%	9,34%	18,73%
ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	2.754.107,78	1,80%	ITAU	0,06%	1,38%	-0,28%	2,19%	1,81%	-0,28%	3,03%	11,81%	26,03%
KINEA CHRONOS FI MULT	11.572.054,43	7,56%	KINEA	0,19%	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	153.148.733,20	100%			1,86%	-0,21%	3,65%	3,08%	-0,21%	1,48%	12,70%	22,84%
Benchmark:	IPCA + 2.55% a.a.					0,45%	3,14%	5,61%	0,45%	7,19%	14,55%	21,88%

* 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.

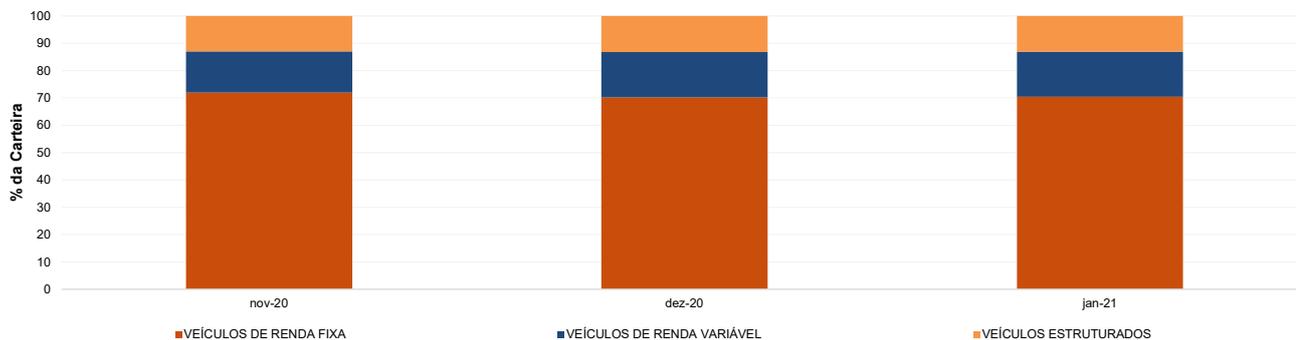
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

Este 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.

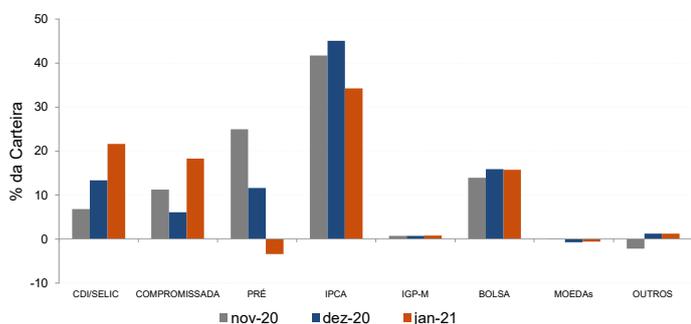
Distribuição da Carteira

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.

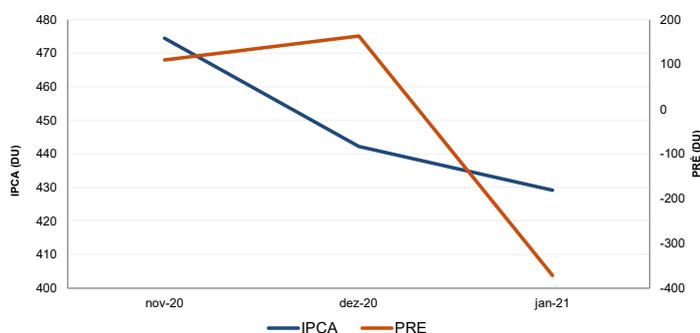
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
MGLU3	Comércio	2.029,65	7,83	1.779,48	6,74
VALE3	Mineração	1.573,55	6,07	1.917,37	7,26
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	1.461,15	5,64	1.663,98	6,30
RENT3	Diversos	1.348,97	5,20	1.550,57	5,87
SUZB3	Madeira e Papel	1.236,47	4,77	1.110,12	4,20
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	1.092,31	4,21	1.079,44	4,09
LAME4	Comércio	957,01	3,69	1.048,83	3,97
HAPV3	Análises e Diagnósticos	949,66	3,66	748,22	2,83
BBDC4	Intermediários Financeiros	943,32	3,64	1.170,81	4,43
EQTL3	Energia Elétrica	931,87	3,59	1.034,81	3,92

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

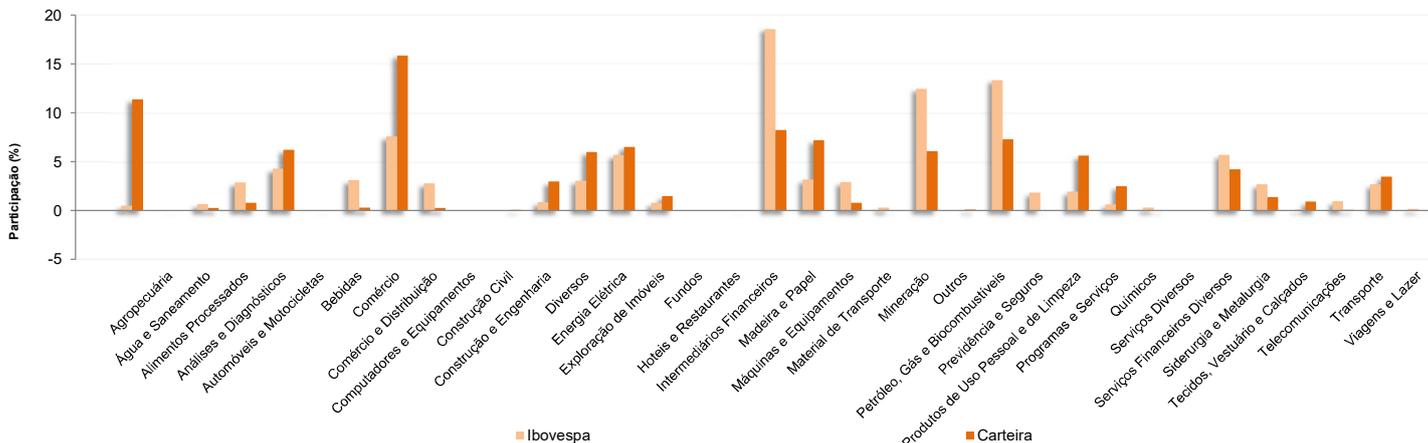
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
ESPA3	92,90	0,36	0,00	Sem Liquidez
MGLU3	2.029,65	7,83	0,00	1
VALE3	1.573,55	6,07	0,00	1
NTCO3	1.461,15	5,64	0,00	1
RENT3	1.348,97	5,20	0,00	1
SUZB3	1.236,47	4,77	0,00	1
B3SA3	1.092,31	4,21	0,00	1
LAME4	957,01	3,69	0,00	1
HAPV3	949,66	3,66	0,01	1
BBDC4	943,32	3,64	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.



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.

Análises de Contrapartes

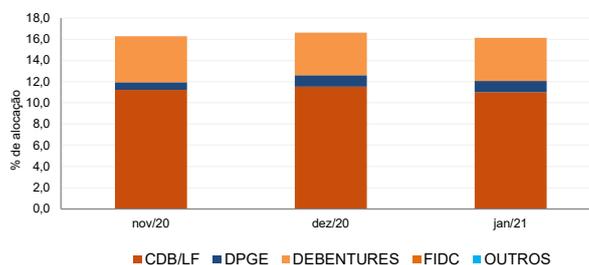
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	5.334,94	3,48	Faixa 2
BCO ITAU SA	3.564,95	2,32	Faixa 2
BCO BRASIL SA	3.279,43	2,14	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	3.188,58	2,08	Faixa 2
BCO SAFRA SA	2.336,77	1,52	Faixa 2
MAGAZINE LUIZA SA	2.029,65	1,32	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.651,96	1,08	Faixa 2
VALE SA	1.573,55	1,02	Faixa 1
NATURA COSMETICOS SA	1.461,15	0,95	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	1.338,65	0,87	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 MODERADO

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	411.737	0,27%	Selic	20-jan-21	0,08%	0,07%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	417.249	0,27%	Selic	18-jan-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	119.410	0,08%	IPCA	27-jan-21	1,94%	-2,10%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	34.117	0,02%	IPCA	12-jan-21	1,33%	-2,15%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	785.505	0,51%	IPCA	21-jan-21	0,28%	0,37%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	172.974	0,11%	IPCA	19-jan-21	0,17%	0,23%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	152.624	0,10%	IPCA	08-jan-21	0,12%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	16.280	0,01%	IPCA	19-jan-21	0,19%	0,23%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	93.904	0,06%	IPCA	21-jan-21	2,19%	2,27%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	34.147	0,02%	IPCA	12-jan-21	2,17%	2,11%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	32.458	0,02%	IPCA	21-jan-21	4,06%	4,11%	ATLANTIDA FI MULT

