

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	204.066.987,51	77,51%			0,19%	1,98%	2,48%	0,19%	2,84%	11,87%	19,99%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.				0,33%	2,76%	4,82%	0,33%	5,59%	11,12%	16,46%
Renda Fixa Total Return	197.141.689,15	74,88%		0,37%	0,15%	1,93%	2,35%	0,15%	2,65%	11,64%	20,53%
ATLANTIDA FI MULT	108.134.230,90	41,07%	ITAU	100%	0,56%	0,19%	2,21%	2,96%	0,19%	3,97%	23,80%
ITAPEMA FI MULT	89.007.458,25	33,81%	SUL AMERICA	100%	0,17%	0,11%	1,61%	1,70%	0,11%	1,26%	9,82%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.				0,33%	2,76%	4,82%	0,33%	5,59%	11,12%	16,46%
Renda Fixa ALM	6.059.302,72	2,30%									
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.059.302,72	2,30%		100%	1,38%	4,52%	7,82%	1,38%	11,52%	24,21%	37,21%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.				0,59%	3,60%	6,55%	0,59%	9,09%	18,68%	28,52%
Renda Fixa CDI	865.995,64	0,33%			0,28%	0,28%	0,66%	1,17%	0,28%	0,43%	6,15%
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	238.745,73	0,09%	BRADESCO	0,00%	0,06%	0,16%	0,50%	0,76%	0,16%	2,30%	8,18%
BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV	573.996,09	0,22%	BTG PACTUAL	0,06%	0,42%	0,56%	1,24%	3,10%	0,56%	-0,43%	5,16%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	53.253,82	0,02%	ITAU	0,00%	0,08%	0,17%	0,50%	0,78%	0,17%	2,28%	14,76%
Benchmark:	CDI				0,15%	0,46%	0,94%	0,15%	2,54%	8,47%	15,40%
Renda Variável	25.181.819,83	9,56%			-1,29%	15,84%	9,19%	-1,29%	-6,54%	21,14%	37,76%
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	9,56%			8,98%	-1,29%	15,84%	9,19%	-1,29%	-6,54%	21,08%
AZ QUEST ACOES FC FIA	3.396.593,52	1,29%	AZ QUEST	0,45%	10,67%	-2,64%	14,42%	4,55%	-2,64%	-9,84%	12,05%
BRADESCO FIA SELECTION	3.476.424,45	1,32%	BRADESCO	0,44%	10,96%	-2,48%	13,85%	13,11%	-2,48%	-4,84%	13,16%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	10.052.152,80	3,82%	BTG PACTUAL	0,37%	8,35%	-0,62%	13,66%	7,92%	-0,62%	5,08%	38,70%
ITAU ACOES DUNAMIS INSTITUCIONAL FC	4.377.976,21	1,66%	ITAU	2,03%	8,76%	-1,47%	18,11%	12,04%	-1,47%	-	-
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	3.878.672,84	1,47%	NEO GESTAO	0,60%	8,01%	-0,51%	13,90%	16,50%	-0,51%	1,24%	41,42%
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.				-3,09%	23,37%	13,46%	-3,09%	4,15%	25,31%	48,01%
Estruturado	34.035.807,05	12,93%			-0,75%	1,94%	1,22%	-0,75%	1,44%	10,08%	16,75%
Benchmark:	CDI + 3% a.a.				0,38%	1,20%	2,43%	0,38%	5,57%	15,05%	26,04%
Multimercado Estruturado	34.035.807,05	12,93%			1,48%	-0,75%	1,94%	1,22%	-0,75%	1,44%	9,83%
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	5.538.459,74	2,10%	ABSOLUTE	0,58%	0,64%	-0,02%	0,23%	0,26%	-0,02%	1,37%	10,14%
AZ QUEST MULT FC FI MULT	4.134.387,16	1,57%	AZ QUEST	0,55%	0,94%	-1,01%	0,31%	-0,51%	-1,01%	0,59%	9,34%
ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	4.326.534,20	1,64%	ITAU	0,09%	1,38%	-0,28%	2,19%	1,81%	-0,28%	3,03%	11,81%
KINEA CHRONOS FI MULT	20.036.425,94	7,61%	KINEA	0,32%	2,01%	-1,00%	2,48%	1,50%	-1,00%	0,39%	8,72%
Benchmark:	CDI + 3% a.a.				0,38%	1,20%	2,43%	0,38%	5,57%	15,05%	26,04%
Total	263.275.438,73	100%			1,26%	-0,08%	3,06%	2,94%	-0,08%	2,12%	12,32%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.				0,59%	3,60%	6,55%	0,59%	9,09%	18,68%	28,52%

* 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.

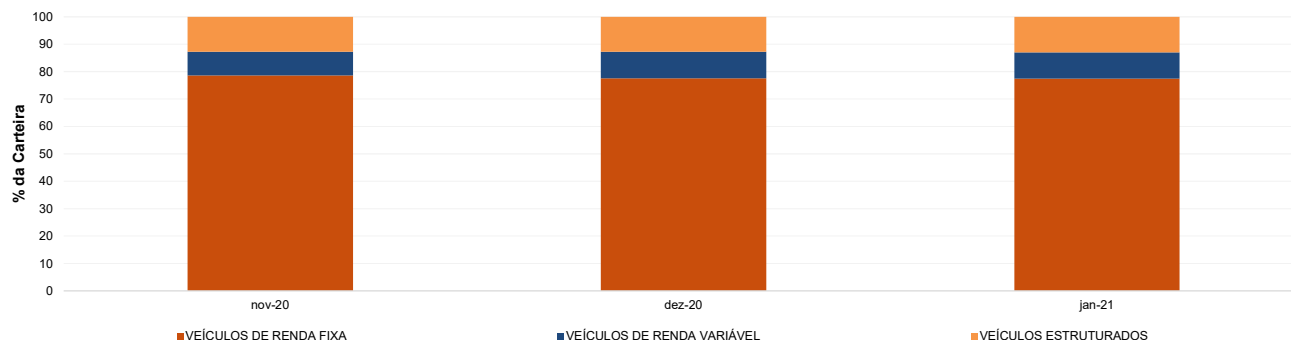
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

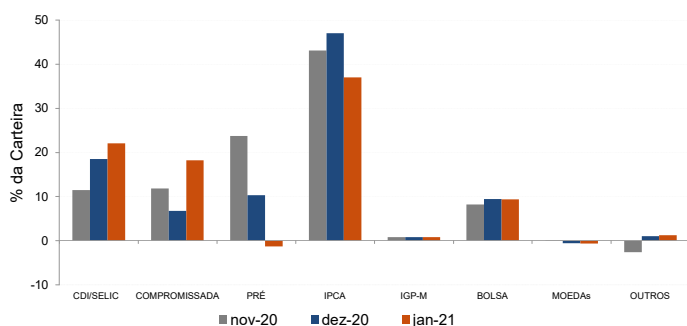
Distribuição da Carteira

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.

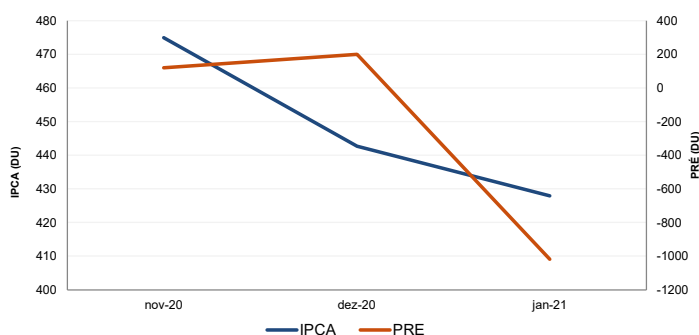
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
MGLU3	Comércio	2.055,47	7,65	1.792,14	6,56
VALE3	Mineração	1.626,18	6,05	2.005,28	7,34
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	1.464,85	5,45	1.670,38	6,11
RENT3	Diversos	1.296,00	4,82	1.502,18	5,50
SUZB3	Madeira e Papel	1.293,63	4,81	1.133,19	4,15
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	1.124,14	4,18	1.104,85	4,04
LAME4	Comércio	955,74	3,56	1.048,72	3,84
HAPV3	Análises e Diagnósticos	952,21	3,54	744,72	2,73
BBDC4	Intermediários Financeiros	938,09	3,49	1.171,19	4,29
EQTL3	Energia Elétrica	936,72	3,49	1.040,60	3,81

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

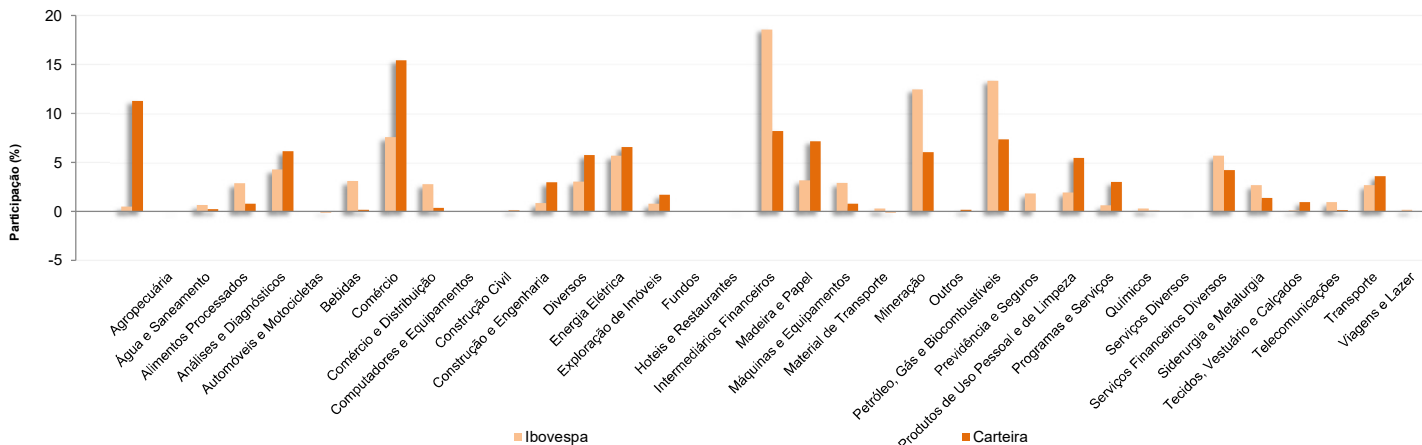
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
ESPA3	100,54	0,37	0,00	Sem Liquidez
MGLU3	2.055,47	7,65	0,00	1
VALE3	1.626,18	6,05	0,00	1
NTCO3	1.464,85	5,45	0,00	1
RENT3	1.296,00	4,82	0,00	1
SUZB3	1.293,63	4,81	0,00	1
B3SA3	1.124,14	4,18	0,00	1
LAME4	955,74	3,56	0,00	1
HAPV3	952,21	3,54	0,01	1
BBDC4	938,09	3,49	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

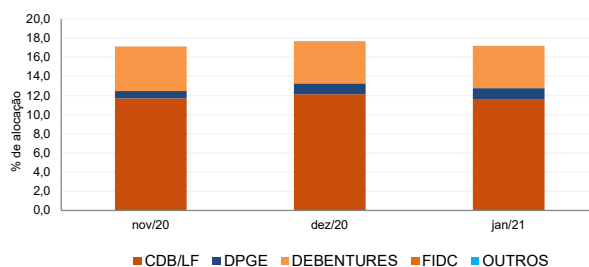
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	8.817,75	3,34	Faixa 2
BCO ITAU SA	6.386,85	2,42	Faixa 2
BCO BRASIL SA	5.774,52	2,19	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	4.538,33	1,72	Faixa 2
BCO SAFRA SA	4.403,12	1,67	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	2.359,37	0,89	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	2.325,22	0,88	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.207,84	0,84	Faixa 1
MAGAZINE LUIZA SA	2.055,47	0,78	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	2.051,47	0,78	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 PLANO CV

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	775.829	0,29%	Selic	20-jan-21	0,08%	0,07%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.856	0,00%	Selic	27-jan-21	0,08%	0,08%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	577	0,00%	Selic	14-jan-21	0,08%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	490	0,00%	Selic	12-jan-21	0,08%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	288	0,00%	Selic	14-jan-21	0,08%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	786.214	0,30%	Selic	18-jan-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.009	0,00%	Selic	27-jan-21	0,10%	0,10%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.871	0,00%	Selic	27-jan-21	0,13%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	225.001	0,09%	IPCA	27-jan-21	1,94%	-2,10%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	64.286	0,02%	IPCA	12-jan-21	1,33%	-2,15%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.480.111	0,56%	IPCA	21-jan-21	0,28%	0,37%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	325.931	0,12%	IPCA	19-jan-21	0,17%	0,23%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	287.586	0,11%	IPCA	08-jan-21	0,12%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	30.676	0,01%	IPCA	19-jan-21	0,19%	0,23%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	176.942	0,07%	IPCA	21-jan-21	2,19%	2,27%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	64.342	0,02%	IPCA	12-jan-21	2,17%	2,11%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	61.160	0,02%	IPCA	21-jan-21	4,06%	4,11%	ATLANTIDA FI MULT

