

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/07/2021

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	101.298.552,12	100%										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,05%	2,60%	5,02%	5,36%	10,08%	13,74%	18,57%
Renda Fixa Total Return	101.298.552,12	100%			0,55%	0,27%	0,86%	1,40%	1,55%	3,79%	7,75%	18,99%
ATLANTIDA FI MULT	51.452.019,77	50,79%	ITAU	100%	0,59%	0,54%	1,27%	2,10%	2,29%	5,11%	10,01%	21,44%
ITAPEMA FI MULT	49.846.532,35	49,21%	TAG INVEST	100%	0,59%	-0,01%	0,50%	0,73%	0,84%	2,45%	5,02%	15,96%
Benchmark:	IPCA + 1.2% a.a.					1,07%	2,65%	5,12%	5,48%	10,29%	14,19%	19,28%
Total	101.298.552,14	100%			0,55%	0,27%	0,87%	1,50%	1,53%	3,68%	7,49%	18,37%
Benchmark:	IPCA + 1.2% a.a.					1,07%	2,65%	5,12%	5,48%	10,29%	14,19%	19,28%

* 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.

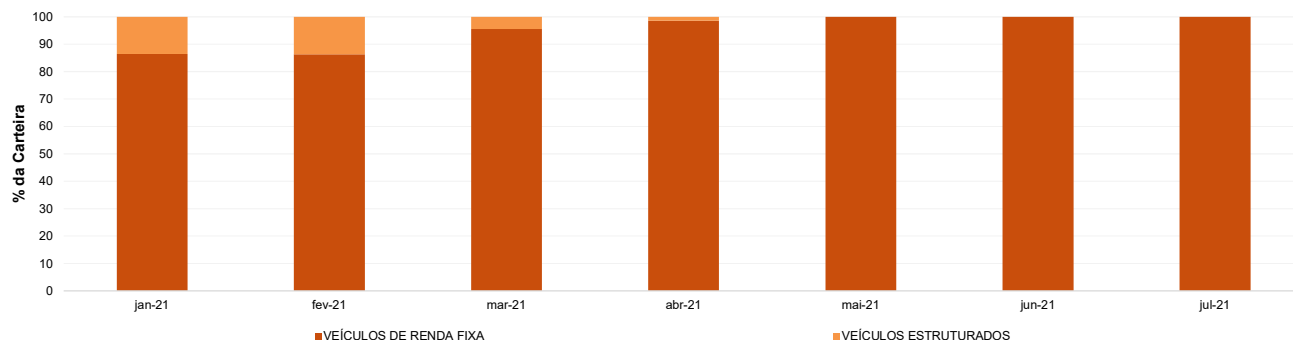
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

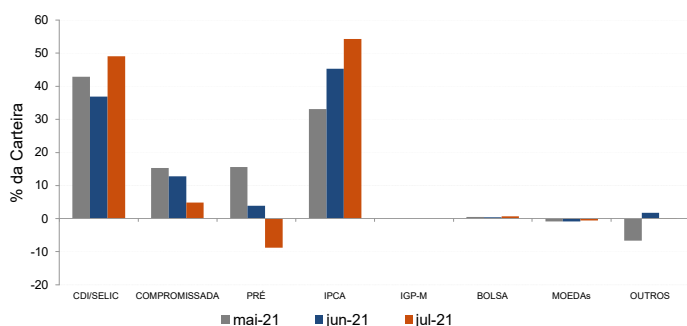
Distribuição da Carteira

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.

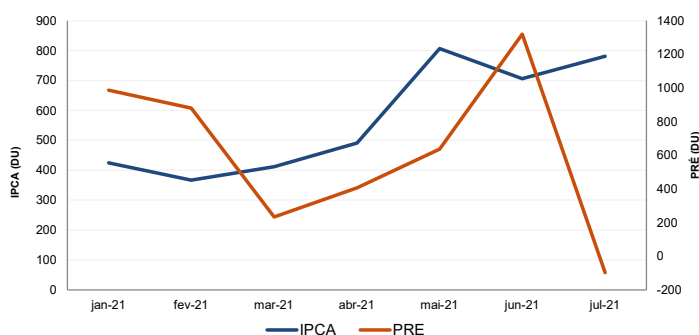
Evolução do Patrimônio Líquido



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	86,90	6,87	17,40	2,18
VALE3	Mineração	86,14	6,81	38,18	4,79
BOVA11	Fundos	73,65	5,82	70,74	8,87
BOVV11	Fundos	68,11	5,38	65,10	8,16
RECV3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	55,32	4,37	63,78	8,00
BRKM5	Químicos	53,06	4,19	19,77	2,48
BPAC11	Intermediários Financeiros	50,97	4,03	-2,79	-0,35
VALE US	Mineração	50,81	4,02	54,80	6,87
ASAI3	Comércio e Distribuição	48,14	3,81	37,45	4,70
RDOR3	viços Médico - Hospitalares, Análises e Diagnósti	44,80	3,54	36,01	4,52

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

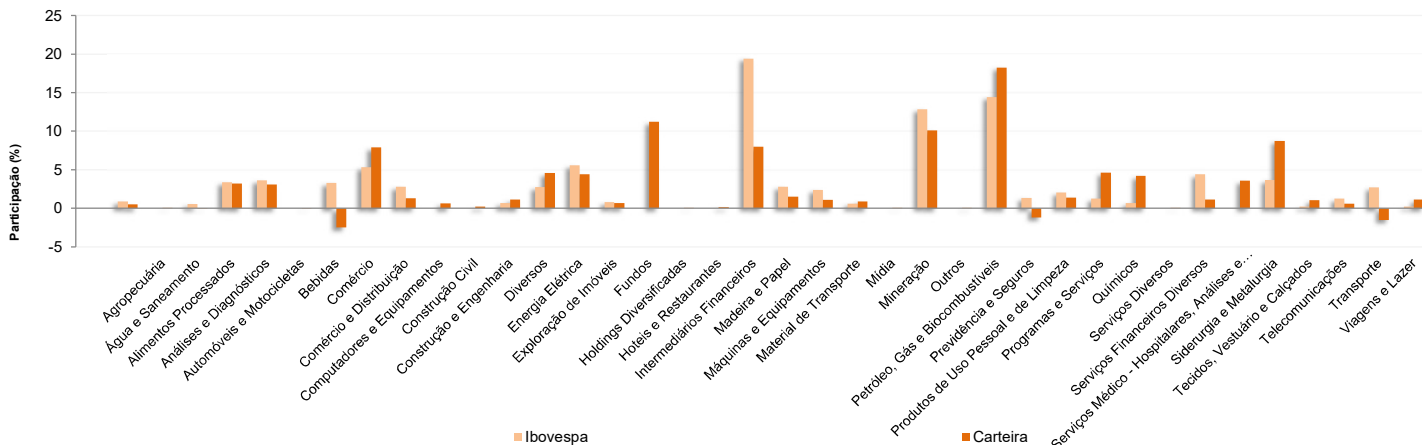
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
LINX3	0,51	0,04	0,00	Sem Liquidez
PETR4	86,90	6,87	0,00	1
VALE3	86,14	6,81	0,00	1
RECV3	55,32	4,37	0,00	1
BRKM5	53,06	4,19	0,00	1
BPAC11	50,97	4,03	0,00	1
ASAI3	48,14	3,81	0,00	1
RDOR3	44,80	3,54	0,00	1
BRDT3	41,83	3,31	0,00	1
USIM5	41,82	3,31	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.



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.

Análises de Contrapartes

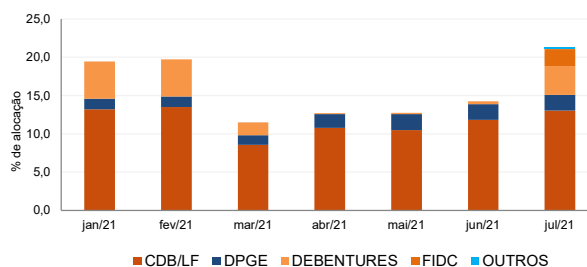
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	4.344,60	4,33	Faixa 2
BCO SAFRA SA	3.855,56	3,85	Faixa 2
BANCO C6 S.A.	2.060,79	2,06	Sem Faixa
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.154,70	1,15	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	935,18	0,93	Faixa 2
PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	818,03	0,82	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	551,67	0,55	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	412,14	0,41	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	251,97	0,25	Faixa 1
BANCO XP S.A	251,46	0,25	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
PCHS11	10,45	MULTI PCH SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FINAI	Sem Faixa	Faixa 2	16-out-30	IPCA	10,43%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
SMFT24	1,50	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,29%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
SMFT24	2,68	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,35%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
SMFT24	1,00	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,54%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,26%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,67%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,25%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,04	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,01	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,06	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,08	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,14	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,25%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,35%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,33	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,18%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANÇA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,18%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/07/2021

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	13-jul-23	200.554	0,20%	CDI	BCO CITIBANK SA	13-jul-21	1,30%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	24-jul-23	100.104	0,10%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	23-jul-21	1,20%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	31-jul-23	100.000	0,10%	CDI	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVI	30-jul-21	1,30%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	08-jan-24	351.063	0,35%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	12-jul-21	1,40%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	08-jan-24	200.607	0,20%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	12-jul-21	1,40%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	26-jul-24	100.044	0,10%	CDI	PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	28-jul-21	1,55%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	29-jul-24	100.021	0,10%	CDI	BANCO CSF SA	29-jul-21	1,30%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
SBSPE8	15-jul-26	294.942	0,29%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	16-jul-21	1,44%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2021-09-01	01-set-21	546.725	0,55%	Selic		09-jul-21	0,12%	0,12%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	896.339	0,89%	Selic		06-jul-21	0,12%	0,12%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	578.465	0,58%	Selic		14-jul-21	0,13%	0,13%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	54.572	0,05%	Selic		15-jul-21	0,13%	0,13%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	98.086	0,10%	Selic		07-jul-21	0,15%	0,15%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	43.594	0,04%	Selic		26-jul-21	0,16%	0,16%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	54.065	0,05%	Selic		13-jul-21	0,27%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	2.954.960	2,95%	IPCA		30-jul-21	2,92%	3,02%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	274.880	0,27%	IPCA		07-jul-21	2,51%	2,52%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	7.998	0,01%	IPCA		16-jul-21	3,69%	3,62%	ATLANTIDA FI MULT

