

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	ALOCÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	148.074.947,76	100%									
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.				1,05%	2,60%	5,02%	5,36%	10,08%	13,74%	18,57%
Renda Fixa Total Return	148.074.947,76	100%		1,22%	-0,33%	0,75%	1,28%	1,44%	3,66%	7,38%	18,57%
ATLANTIDA 2 FI MULT	73.685.528,48	49,76%	ITAU	100%	1,35%	-0,28%	0,74%	-	-	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	74.389.419,28	50,24%	TAG INVEST	100%	1,12%	-0,39%	0,69%	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 2.55% a.a.				1,18%	2,99%	5,81%	6,29%	11,75%	17,26%	24,10%
Total	148.074.125,56	100%		1,22%	-0,34%	0,74%	1,17%	0,96%	4,28%	7,78%	21,92%
Benchmark:	IPCA + 2.55% a.a.				1,18%	2,99%	5,81%	6,29%	11,75%	17,26%	24,10%

* 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.

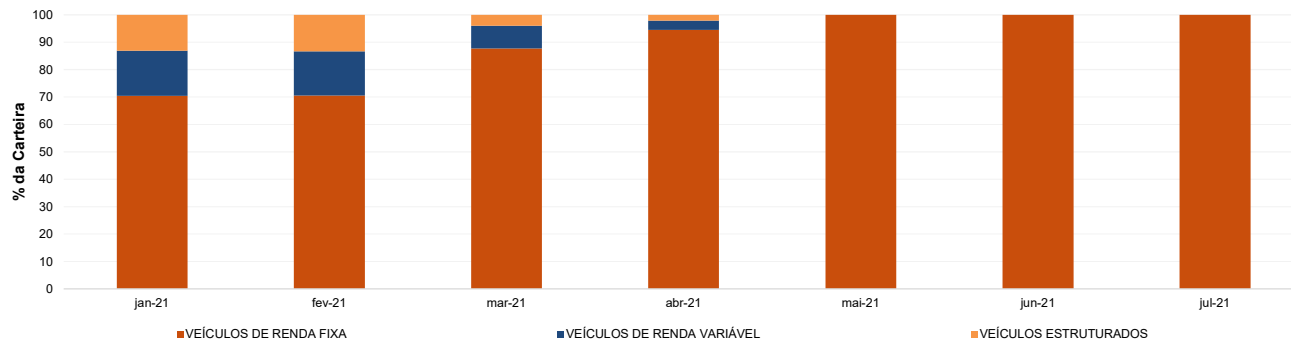
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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

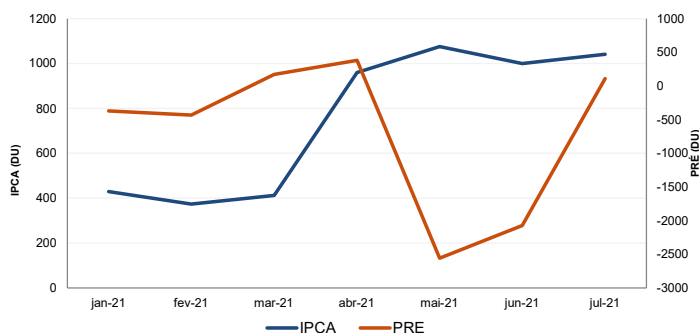
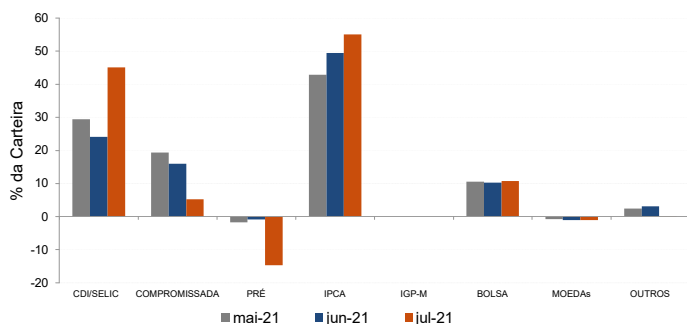
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais 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*	%
VALE3	Mineração	841,65	6,69	807,16	6,79
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	473,15	3,76	467,06	3,93
BPAC11	Intermediários Financeiros	432,98	3,44	486,84	4,10
BBDC4	Intermediários Financeiros	381,34	3,03	484,49	4,08
ITUB4	Intermediários Financeiros	373,87	2,97	343,80	2,89
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	335,63	2,67	258,45	2,18
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	306,60	2,44	312,58	2,63
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	257,69	2,05	276,14	2,32
ITSA4	Intermediários Financeiros	212,96	1,69	241,29	2,03
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	203,27	1,62	101,89	0,86

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

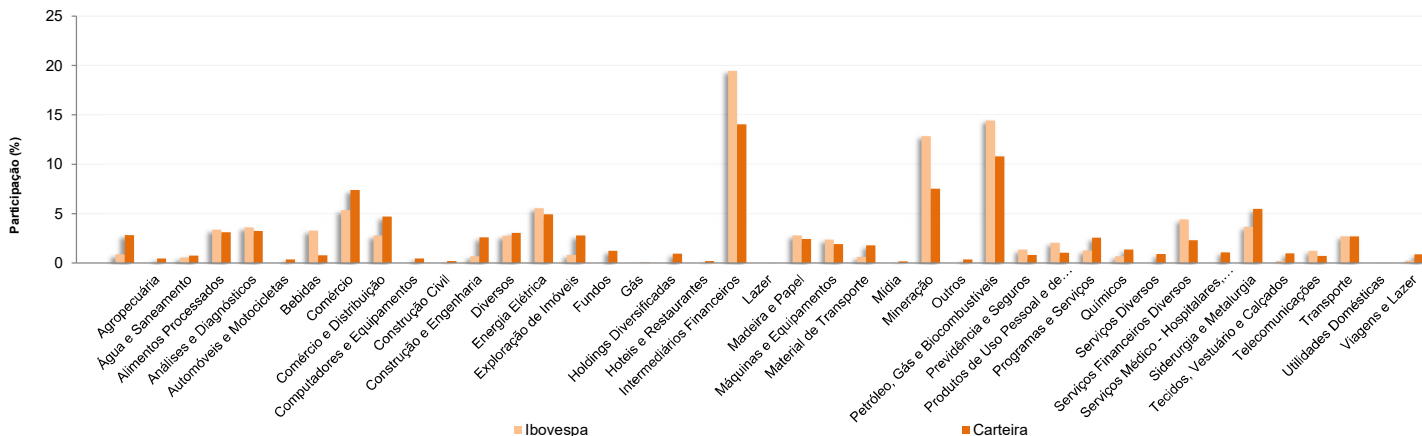
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
LINX3	0,54	0,00	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	27,37	0,22	0,02	6
CRPG6	20,60	0,16	0,00	2
VALE3	841,65	6,69	0,00	1
PETR4	473,15	3,76	0,00	1
BPAC11	432,98	3,44	0,00	1
BBDC4	381,34	3,03	0,00	1
ITUB4	373,87	2,97	0,00	1
GGBR4	335,63	2,67	0,00	1
PETR3	306,60	2,44	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

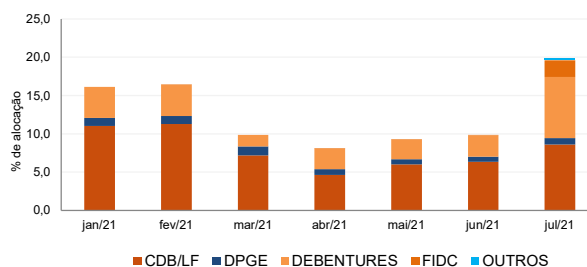
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	2.985,25	2,04	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.238,42	1,53	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	2.176,92	1,49	Faixa 2
BCO SAFRA SA	1.979,67	1,35	Faixa 2
BCO ITAU SA	1.868,42	1,28	Faixa 2
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.027,33	0,70	Faixa 4
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	976,53	0,67	Faixa 2
VALE SA	843,22	0,58	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	837,35	0,57	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	802,56	0,55	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
NP CDI	69,29	ENERGISA SA	Sem Faixa	Faixa 1	23-jul-24	CDI	1,23%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
PCHS11	15,61	MULTI PCH SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FINAI	Sem Faixa	Faixa 2	16-out-30	IPCA	10,43%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
SAPR19	0,00	COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SANEPAR	Faixa 2	Faixa 1	11-jun-24	CDI	106,05%	BB TOP DI RF REF DI LP FI
SMFT24	0,04	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,21	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,25%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,04	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,35%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,50	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,18%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,04	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,18%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	2,24	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,29%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
SMFT24	4,01	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,35%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
SMFT24	1,50	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,54%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
SMFT24	0,04	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,04	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,26%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,04	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,67%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,04	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,25%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,06	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,04	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,02	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,08	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,13	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	300.830	0,21%	CDI	BCO CITIBANK SA	13-jul-21	1,30%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	08-jan-24	501.518	0,34%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	12-jul-21	1,40%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	08-jan-24	301.041	0,21%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	08-jul-21	1,40%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	29-jul-24	100.021	0,07%	CDI	BANCO CSF SA	29-jul-21	1,30%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 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	251.494	0,17%	Selic		09-jul-21	0,12%	0,12%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1.169.613	0,80%	Selic		14-jul-21	0,12%	0,11%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	163.964	0,11%	Selic		06-jul-21	0,12%	0,12%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	109.310	0,07%	Selic		20-jul-21	0,10%	0,09%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.035.350	0,71%	Selic		07-jul-21	0,15%	0,15%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	65.391	0,04%	Selic		22-jul-21	0,16%	0,16%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	227.072	0,16%	Selic		13-jul-21	0,27%	0,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.221.689	0,83%	IPCA		30-jul-21	2,92%	3,02%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	39.990	0,03%	IPCA		28-jul-21	3,85%	3,91%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	3.999	0,00%	IPCA		16-jul-21	3,69%	3,62%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	6.178.525	4,22%	IPCA		30-jul-21	4,11%	4,28%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	3.109.968	2,13%	IPCA		30-jul-21	4,12%	4,28%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	1.743.404	1,19%	IPCA		30-jul-21	4,11%	4,28%	ATLANTIDA 2 FI MULT

