

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	257.116.560,92	100%				-0,05%	0,85%	1,47%	1,67%	3,99%	7,86%	18,98%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,05%	2,60%	5,02%	5,36%	10,08%	13,74%	18,57%
Renda Fixa Total Return - Perfil Moderado	148.074.947,76	57,59%			1,22%	-0,33%	0,75%	1,28%	1,44%	3,66%	7,38%	18,57%
ATLANTIDA 2 FI MULT	73.685.528,48	28,66%	ITAU	100%	1,35%	-0,28%	0,74%	-	-	-	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	74.389.419,28	28,93%	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%
Renda Fixa Total Return - Perfil Conservador	101.298.552,12	39,40%			0,55%	0,27%	0,86%	1,40%	1,55%	3,79%	7,75%	18,99%
ATLANTIDA FI MULT	51.452.019,77	20,01%	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	19,39%	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%
Renda Fixa ALM	6.715.156,64	2,61%			0,01%							
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.715.156,64	2,61%		100%	0,01%	1,25%	3,65%	7,47%	8,96%	15,87%	26,54%	39,47%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,34%	3,46%	6,75%	7,38%	13,74%	21,49%	30,87%
Renda Fixa CDI	1.027.904,40	0,40%			0,05%	0,39%	0,99%	1,62%	1,91%	2,81%	4,46%	11,71%
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.027.904,40	0,40%	BRADESCO	0,01%	0,05%	0,39%	1,00%	1,45%	1,61%	2,22%	6,47%	13,18%
Benchmark:	CDI					0,36%	0,93%	1,48%	1,63%	2,43%	6,77%	13,54%
Total	257.114.129,03	100%			0,89%	-0,05%	1,00%	1,67%	1,59%	4,66%	8,28%	20,35%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,34%	3,46%	6,75%	7,38%	13,74%	21,49%	30,87%

* 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.

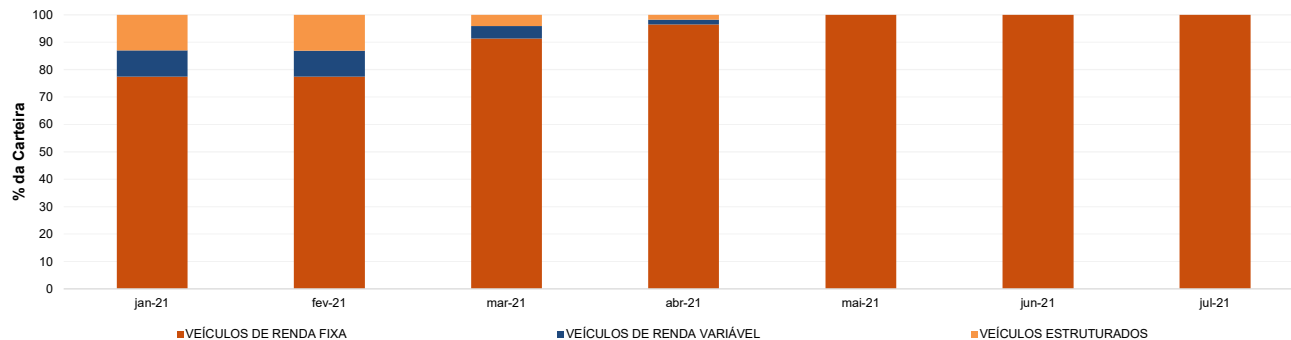
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

Distribuição da Carteira

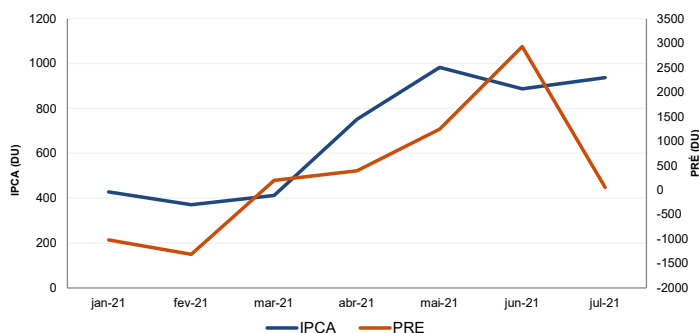
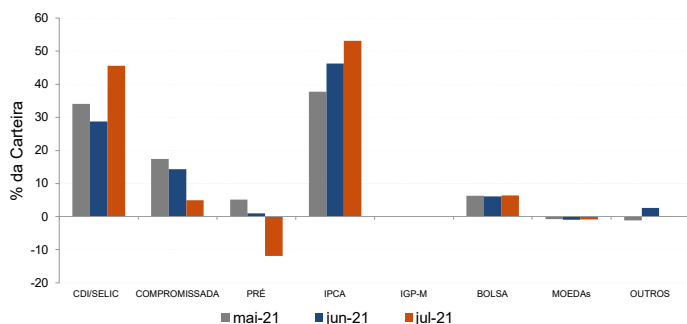
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais 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*	%
VALE3	Mineração	927,79	6,70	845,34	6,67
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	560,05	4,04	484,46	3,82
BPAC11	Intermediários Financeiros	483,95	3,49	484,04	3,82
ITUB4	Intermediários Financeiros	393,93	2,84	368,19	2,90
BBDC4	Intermediários Financeiros	383,14	2,77	492,91	3,89
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	341,12	2,46	265,33	2,09
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	335,48	2,42	341,16	2,69
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	280,15	2,02	297,37	2,35
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	245,10	1,77	105,31	0,83
LREN3	Comércio	231,12	1,67	209,24	1,65

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

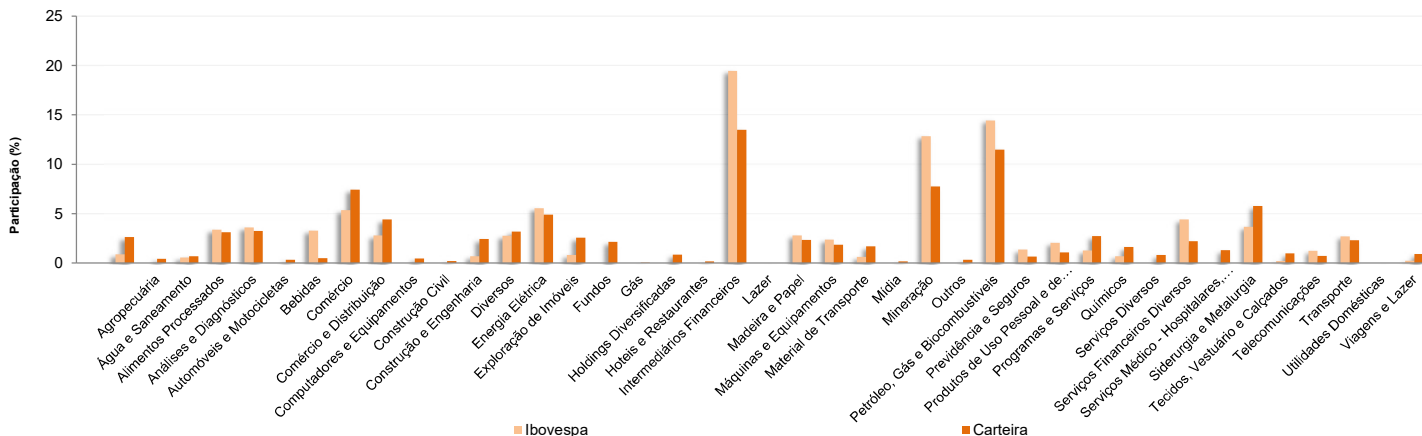
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
LINX3	1,05	0,01	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	27,37	0,20	0,02	6
CRPG6	20,60	0,15	0,00	2
VALE3	927,79	6,70	0,00	1
PETR4	560,05	4,04	0,00	1
BPAC11	483,95	3,49	0,00	1
ITUB4	393,93	2,84	0,00	1
BBDC4	383,14	2,77	0,00	1
GGBR4	341,12	2,46	0,00	1
PETR3	335,48	2,42	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

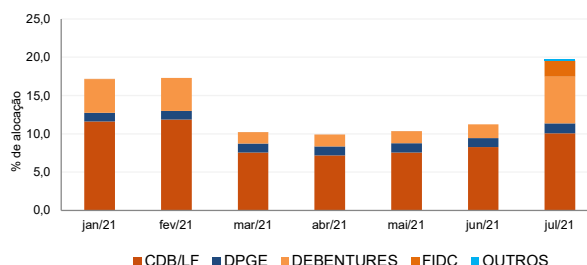
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	6.213,02	2,44	Faixa 2
BCO SAFRA SA	5.835,22	2,29	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	3.920,44	1,54	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.238,42	0,88	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	2.176,96	0,86	Faixa 2
BANCO C6 S.A.	2.135,89	0,84	Sem Faixa
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.354,23	0,53	Faixa 2
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.255,59	0,49	Faixa 1
OMNI SA CRED FINANCI INVEST	1.027,33	0,40	Faixa 4
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	998,74	0,39	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
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
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	0,04	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
SMFT24	1,50	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,29%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	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	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	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	0,50	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	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,26%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,67%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,25%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	2,68	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,35%	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	1,00	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,54%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,01	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	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	0,08	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,34%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,14	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,25%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,35%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,33	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,18%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	Faixa 3	Faixa 2	20-abr-26	CDI	3,18%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	0,12%	CDI	BCO CITIBANK SA	13-jul-21	1,30%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	13-jul-23	200.554	0,08%	CDI	BCO CITIBANK SA	13-jul-21	1,30%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	24-jul-23	100.104	0,04%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	23-jul-21	1,20%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	31-jul-23	100.000	0,04%	CDI	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVI	30-jul-21	1,30%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	08-jan-24	501.518	0,20%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	12-jul-21	1,40%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	08-jan-24	351.063	0,14%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	12-jul-21	1,40%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	08-jan-24	301.041	0,12%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	08-jul-21	1,40%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	08-jan-24	200.607	0,08%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	12-jul-21	1,40%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	26-jul-24	100.044	0,04%	CDI	PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	28-jul-21	1,55%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	29-jul-24	100.021	0,04%	CDI	BANCO CSF SA	29-jul-21	1,30%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	29-jul-24	100.021	0,04%	CDI	BANCO CSF SA	29-jul-21	1,30%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
SBSP8	15-jul-26	294.942	0,12%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	16-jul-21	1,44%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2021-09-01	01-set-21	546.725	0,21%	Selic		09-jul-21	0,12%	0,12%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	251.494	0,10%	Selic		09-jul-21	0,12%	0,12%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1.169.613	0,46%	Selic		14-jul-21	0,12%	0,11%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	896.339	0,35%	Selic		06-jul-21	0,12%	0,12%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	163.964	0,06%	Selic		06-jul-21	0,12%	0,12%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	109.310	0,04%	Selic		20-jul-21	0,10%	0,09%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	16.209	0,01%	Selic		14-jul-21	0,12%	0,11%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	16.209	0,01%	Selic		23-jul-21	0,08%	0,07%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	578.465	0,23%	Selic		14-jul-21	0,13%	0,13%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	54.572	0,02%	Selic		15-jul-21	0,13%	0,13%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	30.750	0,01%	Selic		14-jul-21	0,13%	0,13%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	16.184	0,01%	Selic		23-jul-21	0,13%	0,13%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.035.350	0,41%	Selic		07-jul-21	0,15%	0,15%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	98.086	0,04%	Selic		07-jul-21	0,15%	0,15%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	65.391	0,03%	Selic		22-jul-21	0,16%	0,16%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	43.594	0,02%	Selic		26-jul-21	0,16%	0,16%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	33.613	0,01%	Selic		09-jul-21	0,15%	0,15%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	227.072	0,09%	Selic		13-jul-21	0,27%	0,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	54.065	0,02%	Selic		13-jul-21	0,27%	0,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	2.954.960	1,16%	IPCA		30-jul-21	2,92%	3,02%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.221.689	0,48%	IPCA		30-jul-21	2,92%	3,02%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	274.880	0,11%	IPCA		07-jul-21	2,51%	2,52%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	39.990	0,02%	IPCA		28-jul-21	3,85%	3,91%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	7.998	0,00%	IPCA		16-jul-21	3,69%	3,62%	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	2,43%	IPCA		30-jul-21	4,11%	4,28%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	3.109.968	1,22%	IPCA		30-jul-21	4,12%	4,28%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	1.743.404	0,69%	IPCA		30-jul-21	4,11%	4,28%	ATLANTIDA 2 FI MULT