

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/06/2021

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	100.953.179,88	100%										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,61%	1,93%	4,27%	4,27%	9,43%	12,88%	17,83%
Renda Fixa Total Return	100.953.179,88	100%			0,62%	0,06%	0,84%	1,28%	1,28%	4,02%	8,41%	19,68%
ATLANTIDA FI MULT	51.140.924,06	50,66%	ITAU	100%	0,66%	0,14%	1,10%	1,75%	1,75%	4,96%	10,49%	22,24%
ITAPEMA FI MULT	49.812.255,82	49,34%	TAG INVEST	100%	0,66%	-0,02%	0,67%	0,85%	0,85%	3,06%	5,85%	16,58%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,61%	1,93%	4,27%	4,27%	9,43%	12,88%	17,83%
Total	100.950.480,30	100%			0,62%	0,06%	0,86%	1,26%	1,26%	3,99%	8,16%	19,02%
Benchmark:	IPCA + 1,2% a.a.					0,63%	1,98%	4,37%	4,37%	9,64%	13,33%	18,53%

* 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.

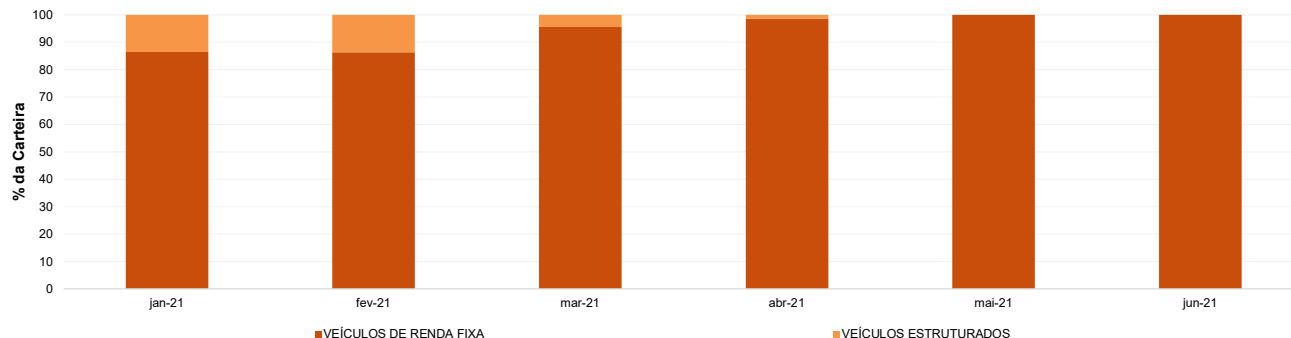
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

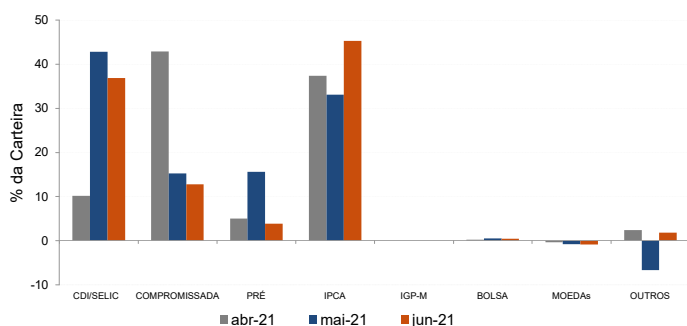
Distribuição da Carteira

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.

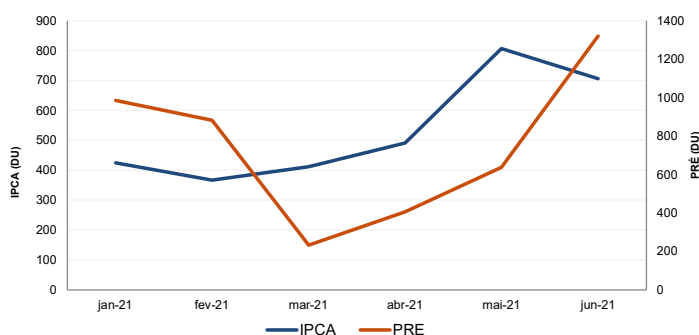
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
BOVA11	Fundos	70,74	8,87	70,41	10,69
BOVV11	Fundos	65,10	8,16	64,47	9,79
RECV3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	63,78	8,00	59,02	8,96
VALE US	Mineração	54,80	6,87	55,94	8,50
TOTS3	Programas e Serviços	43,25	5,42	43,13	6,55
SEQL3	Serviços Diversos	40,86	5,12	35,32	5,36
DIRR3	Construção e Engenharia	38,20	4,79	38,64	5,87
VALE3	Mineração	38,18	4,79	13,13	1,99
ASAI3	Comércio e Distribuição	37,45	4,70	42,08	6,39
RDOR3	viços Médico - Hospitalares, Análises e Diagnósti	36,01	4,52	0,00	

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

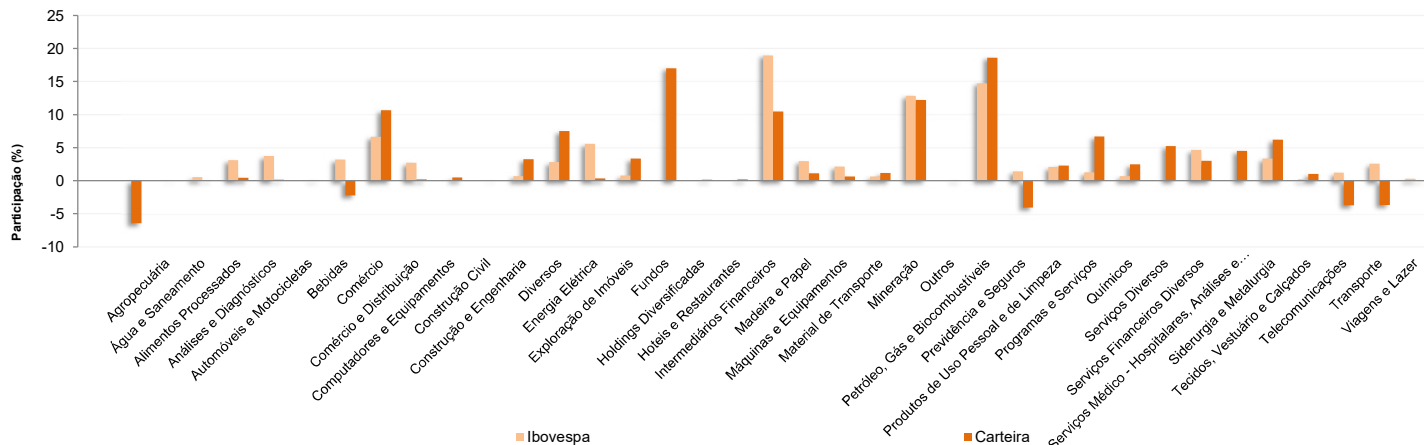
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BID112	0,04	0,00	0,00	Sem Liquidez
RECV3	63,78	8,00	0,00	1
TOTS3	43,25	5,42	0,00	1
SEQL3	40,86	5,12	0,00	1
DIRR3	38,20	4,79	0,00	1
VALE3	38,18	4,79	0,00	1
ASAI3	37,45	4,70	0,00	1
RDOR3	36,01	4,52	0,00	1
PETR3	28,58	3,58	0,00	1
BPAC13	25,65	3,22	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

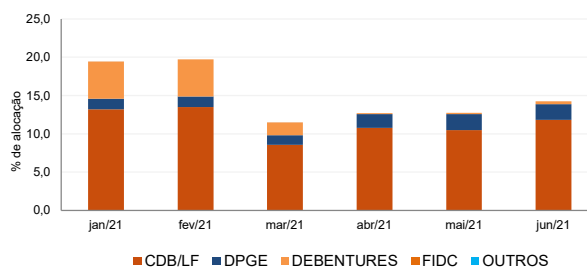
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	4.316,07	4,33	Faixa 2
BCO SAFRA SA	3.854,88	3,87	Faixa 2
BANCO C6 S.A.	2.050,82	2,06	Sem Faixa
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.149,79	1,15	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	915,12	0,92	Faixa 2
PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	715,09	0,72	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	250,81	0,25	Faixa 1
BANCO XP S.A	250,17	0,25	Faixa 2
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	244,52	0,25	Faixa 1
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	202,91	0,20	Sem Faixa

* 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
CPLD14	0,27	COPEL DISTRIBUICAO SA	Faixa 2	Faixa 1	27-set-23	CDI	1,83%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
CPLD14	0,75	COPEL DISTRIBUICAO SA	Faixa 2	Faixa 1	27-set-23	CDI	1,88%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/06/2021

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	28-jun-23	150.099	0,15%	CDI	BANCO XP S.A	25-jun-21	1,50%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	10-jun-24	50.150	0,05%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	09-jun-21	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	24-jun-24	50.053	0,05%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	23-jun-21	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	28-jun-24	100.068	0,10%	CDI	BANCO XP S.A	25-jun-21	1,70%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	30-jun-25	300.063	0,30%	CDI	BCO BRADESCO SA	29-jun-21	1,20%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	29-dez-25	300.064	0,30%	CDI	BCO BRADESCO SA	29-jun-21	1,30%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	29-jun-26	300.065	0,30%	CDI	BCO BRADESCO SA	29-jun-21	1,40%	Faixa 2	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	185.199	0,19%	Selic		04-jun-21	0,10%	0,10%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	54.440	0,05%	Selic		16-jun-21	0,11%	0,11%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	347.535	0,35%	Selic		08-jun-21	0,15%	0,16%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	97.744	0,10%	Selic		09-jun-21	0,16%	0,16%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	281.758	0,28%	IPCA		24-jun-21	1,93%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	209.415	0,21%	IPCA		25-jun-21	1,83%	1,91%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	209.415	0,21%	IPCA		23-jun-21	1,96%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	137.071	0,14%	IPCA		23-jun-21	1,93%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	137.071	0,14%	IPCA		25-jun-21	1,86%	1,91%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	118.034	0,12%	IPCA		23-jun-21	1,92%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	76.151	0,08%	IPCA		28-jun-21	1,87%	1,79%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	72.343	0,07%	IPCA		24-jun-21	1,89%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	68.536	0,07%	IPCA		23-jun-21	1,94%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	9.662.338	9,69%	IPCA		01-jun-21	1,81%	1,84%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	8.027	0,01%	IPCA		16-jun-21	3,53%	3,53%	ATLANTIDA FI MULT

