

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	149.554.617,40	100%										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,61%	1,93%	4,27%	4,27%	9,43%	12,88%	17,83%
Renda Fixa Total Return	149.554.617,40	100%			1,20%	0,03%	1,35%	1,78%	1,78%	4,52%	8,69%	19,97%
ATLANTIDA 2 FI MULT	74.383.353,37	49,74%	ITAU	100%	1,31%	0,05%	-	-	-	-	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	75.171.264,03	50,26%	TAG INVEST	100%	1,13%	0,01%	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,61%	1,93%	4,27%	4,27%	9,43%	12,88%	17,83%
Total	149.554.011,17	100%			1,20%	0,03%	1,39%	1,30%	1,30%	6,14%	9,52%	24,06%
Benchmark:	IPCA + 2,55% a.a.					0,74%	2,31%	5,05%	5,05%	11,10%	16,37%	23,32%

* 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.

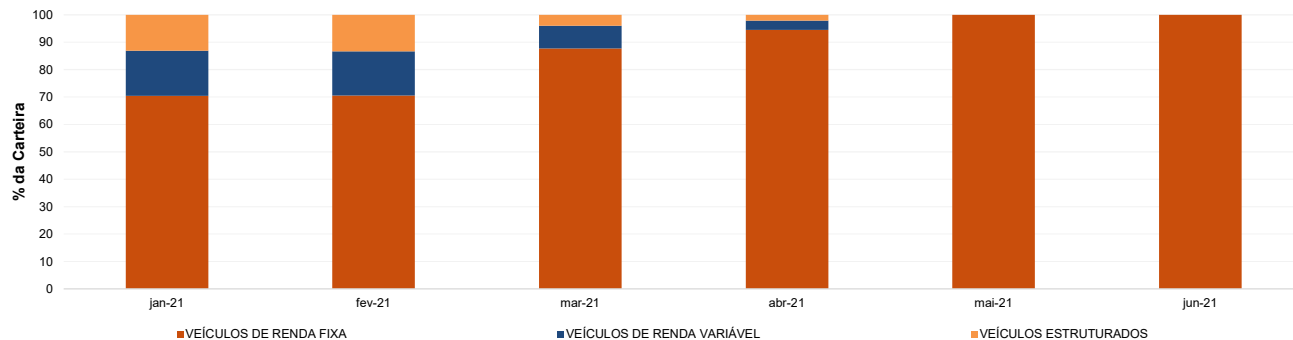
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

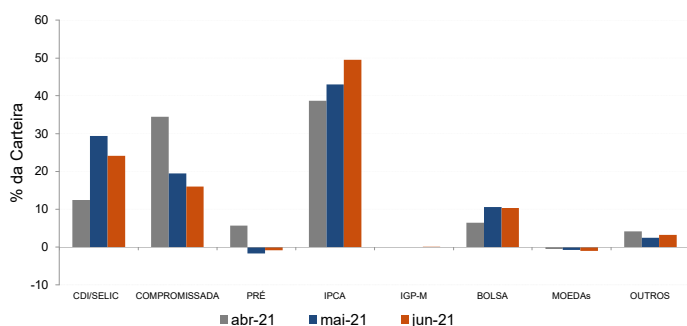
Distribuição da Carteira

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.

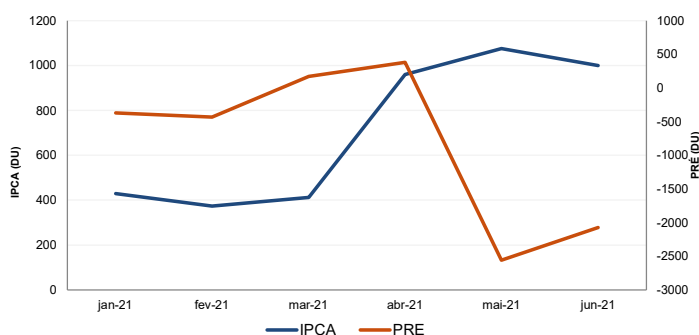
Evolução do Patrimônio Líquido



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	807,16	6,79	725,40	6,16
BPAC11	Intermediários Financeiros	486,84	4,10	441,62	3,75
BBDC4	Intermediários Financeiros	484,49	4,08	430,81	3,66
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	467,06	3,93	360,87	3,06
ITUB4	Intermediários Financeiros	343,80	2,89	322,36	2,74
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	312,58	2,63	333,53	2,83
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	276,14	2,32	275,10	2,34
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	258,45	2,18	320,53	2,72
ITSA4	Intermediários Financeiros	241,29	2,03	323,11	2,74
VVAR3	Comércio	222,98	1,88	144,21	1,22

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

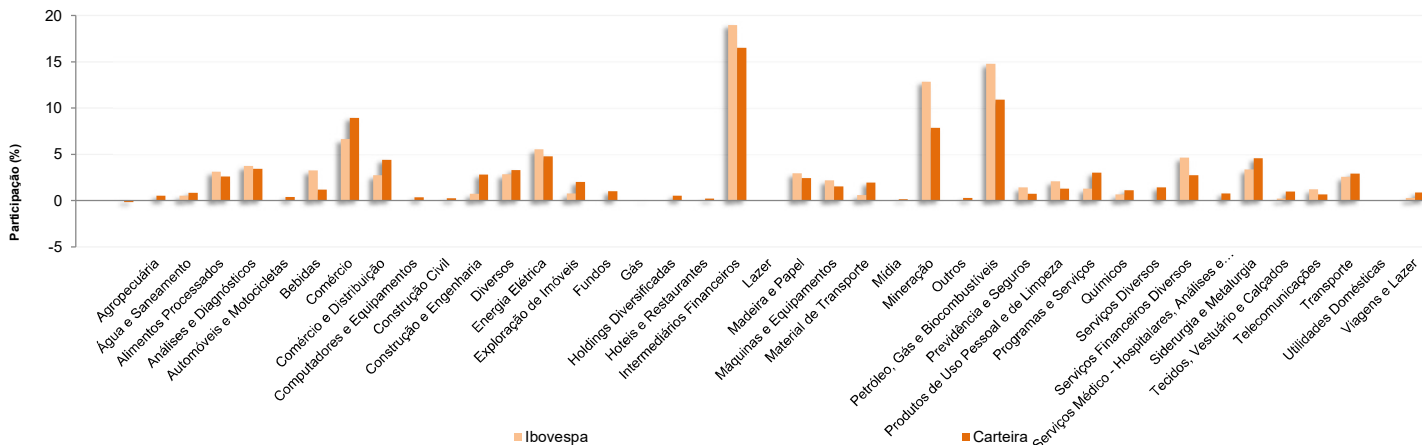
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BID12	1,21	0,01	0,00	Sem Liquidez
VALE3	807,16	6,79	0,00	1
BPAC11	486,84	4,10	0,00	1
BBDC4	484,49	4,08	0,00	1
PETR4	467,06	3,93	0,00	1
ITUB4	343,80	2,89	0,00	1
PETR3	312,58	2,63	0,00	1
B3SA3	276,14	2,32	0,00	1
GGBR4	258,45	2,18	0,00	1
ITSA4	241,29	2,03	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

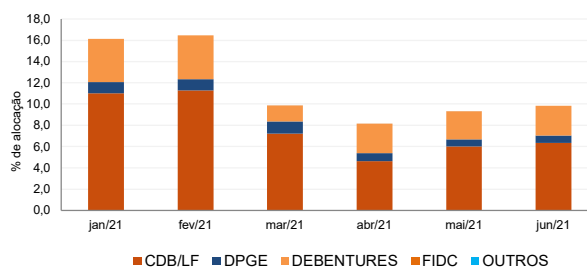
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	2.705,70	1,83	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.225,11	1,51	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	2.052,70	1,39	Faixa 2
BCO SAFRA SA	1.902,33	1,29	Faixa 2
BCO ITAU SA	1.855,77	1,26	Faixa 2
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.022,17	0,69	Faixa 4
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	863,10	0,58	Faixa 2
VALE SA	807,94	0,55	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	779,82	0,53	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	651,06	0,44	Faixa 1

* 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	0,41	COPEL DISTRIBUICAO SA	Faixa 2	Faixa 1	27-set-23	CDI	1,83%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
CPLD14	1,15	COPEL DISTRIBUICAO SA	Faixa 2	Faixa 1	27-set-23	CDI	1,88%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	250.165	0,17%	CDI	BANCO XP S.A	25-jun-21	1,50%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	28-jun-24	150.103	0,10%	CDI	BANCO XP S.A	25-jun-21	1,70%	Faixa 2	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	108.941	0,07%	Selic		14-jun-21	0,10%	0,10%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	76.259	0,05%	Selic		22-jun-21	0,11%	0,12%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	54.440	0,04%	Selic		07-jun-21	0,11%	0,11%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-09-01	01-set-22	446.222	0,30%	Selic		08-jun-21	0,11%	0,11%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-09-01	01-set-22	206.786	0,14%	Selic		09-jun-21	0,11%	0,11%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	525.440	0,36%	IPCA		24-jun-21	1,93%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	399.792	0,27%	IPCA		25-jun-21	1,83%	1,91%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	395.984	0,27%	IPCA		23-jun-21	1,96%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	270.335	0,18%	IPCA		25-jun-21	1,86%	1,91%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	262.720	0,18%	IPCA		23-jun-21	1,93%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	224.645	0,15%	IPCA		23-jun-21	1,92%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	144.686	0,10%	IPCA		28-jun-21	1,87%	1,79%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	133.264	0,09%	IPCA		23-jun-21	1,94%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	129.456	0,09%	IPCA		24-jun-21	1,89%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	3.705.405	2,51%	IPCA		01-jun-21	2,81%	2,78%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	88.293	0,06%	IPCA		23-jun-21	3,86%	3,84%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	32.106	0,02%	IPCA		04-jun-21	3,37%	3,28%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	4.091	0,00%	IPCA		04-jun-21	3,69%	3,61%	ATLANTIDA 2 FI MULT

