

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	258.854.179,27	100%				0,08%	1,18%	1,72%	1,72%	4,57%	8,87%	19,74%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,61%	1,93%	4,27%	4,27%	9,43%	12,88%	17,83%
Renda Fixa Total Return	250.507.797,28	96,78%			0,95%	0,05%	1,13%	1,56%	1,56%	4,30%	8,49%	19,76%
ATLANTIDA FI MULT	51.140.924,06	19,76%	ITAU	100%	0,66%	0,14%	1,10%	1,75%	1,75%	4,96%	10,49%	22,24%
ATLANTIDA 2 FI MULT	74.383.353,37	28,74%	ITAU	100%	1,31%	0,05%	-	-	-	-	-	-
ITAPEMA FI MULT	49.812.255,82	19,24%	TAG INVEST	100%	0,66%	-0,02%	0,67%	0,85%	0,85%	3,06%	5,85%	16,58%
ITAPEMA 2 FI MULT	75.171.264,03	29,04%	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%
Renda Fixa ALM	6.632.512,39	2,56%										
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PRÓPRIA RF	6.632.512,39	2,56%		100%		1,30%	3,42%	7,61%	7,61%	15,50%	25,91%	39,56%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,89%	2,76%	5,96%	5,96%	13,08%	20,59%	30,05%
Renda Fixa CDI	1.713.869,60	0,66%			0,06%	0,32%	0,74%	1,51%	1,51%	2,85%	4,65%	11,93%
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.093.345,47	0,42%	BRADESCO	0,02%	0,05%	0,32%	0,75%	1,21%	1,21%	2,01%	6,65%	13,34%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	620.524,13	0,24%	ITAU	0,00%	0,07%	0,31%	0,74%	1,16%	1,16%	1,97%	6,50%	13,07%
Benchmark:	CDI					0,30%	0,78%	1,27%	1,27%	2,27%	6,99%	13,75%
Total	258.849.234,26	100%			0,92%	0,08%	1,36%	1,65%	1,65%	5,85%	9,50%	21,44%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,89%	2,76%	5,96%	5,96%	13,08%	20,59%	30,05%

* 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.

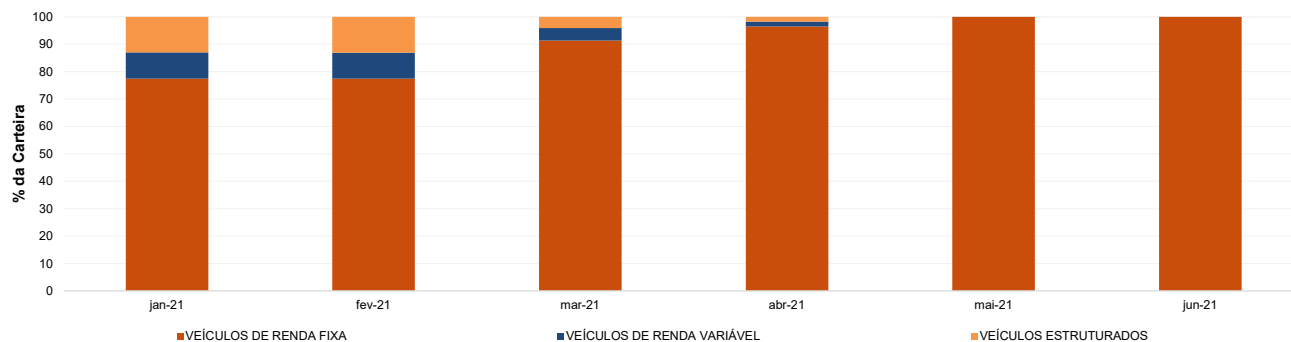
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

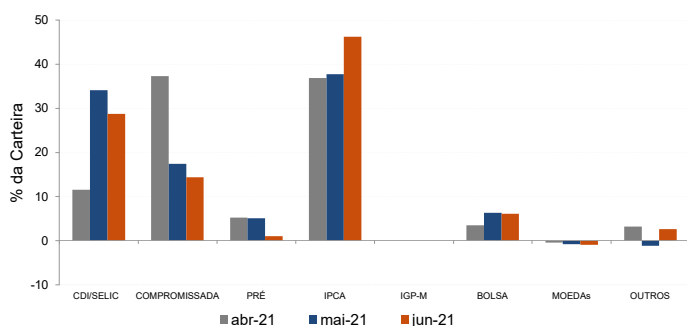
Distribuição da Carteira

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.

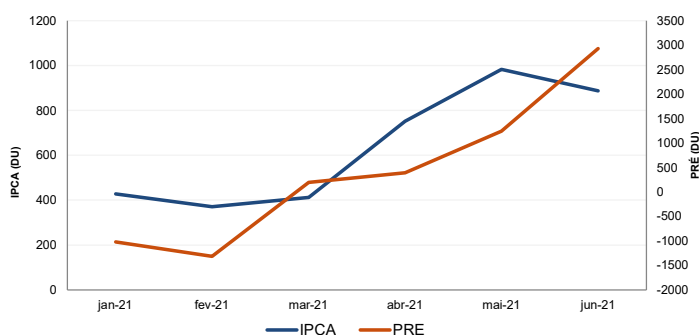
Evolução do Patrimônio Líquido



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	845,34	6,67	738,53	5,94
BBDC4	Intermediários Financeiros	492,91	3,89	436,02	3,51
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	484,46	3,82	372,82	3,00
BPAC11	Intermediários Financeiros	484,04	3,82	447,69	3,60
ITUB4	Intermediários Financeiros	368,19	2,90	331,23	2,66
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	341,16	2,69	394,57	3,17
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	297,37	2,35	279,04	2,24
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	265,33	2,09	329,47	2,65
ITSA4	Intermediários Financeiros	248,43	1,96	326,70	2,63
VVAR3	Comércio	247,43	1,95	155,58	1,25

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

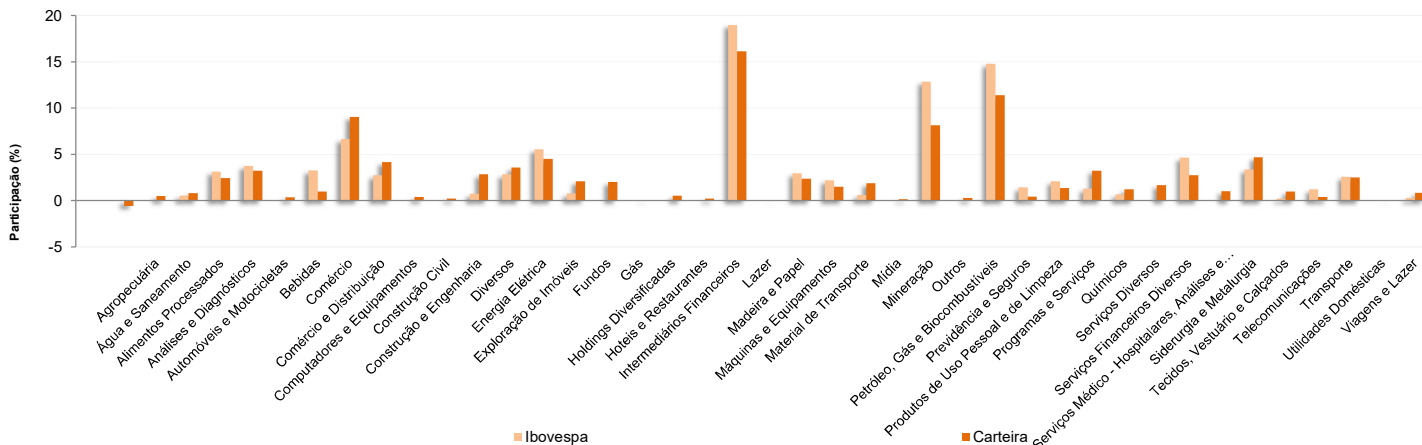
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BID12	1,25	0,01	0,00	Sem Liquidez
VALE3	845,34	6,67	0,00	1
BBDC4	492,91	3,89	0,00	1
PETR4	484,46	3,82	0,00	1
BPAC11	484,04	3,82	0,00	1
ITUB4	368,19	2,90	0,00	1
PETR3	341,16	2,69	0,00	1
B3SA3	297,37	2,35	0,00	1
GGBR4	265,33	2,09	0,00	1
ITSA4	248,43	1,96	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

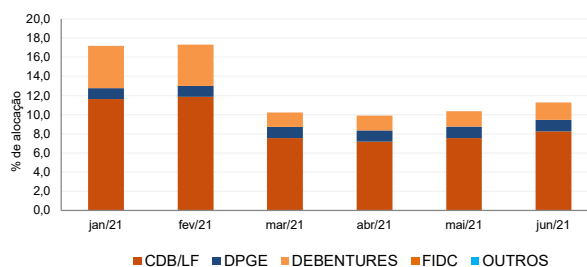
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	6.171,83	2,41	Faixa 2
BCO SAFRA SA	5.757,21	2,25	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	3.620,82	1,42	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.225,11	0,87	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	2.052,73	0,80	Faixa 2
BANCO C6 S.A.	2.050,83	0,80	Sem Faixa
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.250,23	0,49	Faixa 1
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.022,17	0,40	Faixa 4
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	868,81	0,34	Faixa 2
VALE SA	846,68	0,33	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	0,27	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
CPLD14	0,41	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 PLANO CV

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	0,10%	CDI	BANCO XP S.A	25-jun-21	1,50%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	28-jun-23	150.099	0,06%	CDI	BANCO XP S.A	25-jun-21	1,50%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	10-jun-24	50.150	0,02%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	09-jun-21	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	24-jun-24	50.053	0,02%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	23-jun-21	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	28-jun-24	150.103	0,06%	CDI	BANCO XP S.A	25-jun-21	1,70%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	28-jun-24	100.068	0,04%	CDI	BANCO XP S.A	25-jun-21	1,70%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	30-jun-25	300.063	0,12%	CDI	BCO BRADESCO SA	29-jun-21	1,20%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	29-dez-25	300.064	0,12%	CDI	BCO BRADESCO SA	29-jun-21	1,30%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	29-jun-26	300.065	0,12%	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	0,07%	Selic		04-jun-21	0,10%	0,10%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	108.941	0,04%	Selic		14-jun-21	0,10%	0,10%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	76.259	0,03%	Selic		22-jun-21	0,11%	0,12%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	54.440	0,02%	Selic		16-jun-21	0,11%	0,11%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	54.440	0,02%	Selic		07-jun-21	0,11%	0,11%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-09-01	01-set-22	446.222	0,17%	Selic		08-jun-21	0,11%	0,11%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-09-01	01-set-22	206.786	0,08%	Selic		09-jun-21	0,11%	0,11%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-09-01	01-set-22	8.210	0,00%	Selic		10-jun-21	0,11%	0,11%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	347.535	0,14%	Selic		08-jun-21	0,15%	0,16%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	97.744	0,04%	Selic		09-jun-21	0,16%	0,16%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2024-09-01	01-set-24	21.214	0,01%	Selic		07-jun-21	0,24%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	525.440	0,21%	IPCA		24-jun-21	1,93%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	399.792	0,16%	IPCA		25-jun-21	1,83%	1,91%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	395.984	0,15%	IPCA		23-jun-21	1,96%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	281.758	0,11%	IPCA		24-jun-21	1,93%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	270.335	0,11%	IPCA		25-jun-21	1,86%	1,91%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	262.720	0,10%	IPCA		23-jun-21	1,93%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	224.645	0,09%	IPCA		23-jun-21	1,92%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	209.415	0,08%	IPCA		25-jun-21	1,83%	1,91%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	209.415	0,08%	IPCA		23-jun-21	1,96%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	144.686	0,06%	IPCA		28-jun-21	1,87%	1,79%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	137.071	0,05%	IPCA		23-jun-21	1,93%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	137.071	0,05%	IPCA		25-jun-21	1,86%	1,91%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	133.264	0,05%	IPCA		23-jun-21	1,94%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	129.456	0,05%	IPCA		24-jun-21	1,89%	1,88%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	118.034	0,05%	IPCA		23-jun-21	1,92%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	76.151	0,03%	IPCA		28-jun-21	1,87%	1,79%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	72.343	0,03%	IPCA		24-jun-21	1,89%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	68.536	0,03%	IPCA		23-jun-21	1,94%	1,88%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	9.662.338	3,78%	IPCA		01-jun-21	1,81%	1,84%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	3.705.405	1,45%	IPCA		01-jun-21	2,81%	2,78%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	88.293	0,03%	IPCA		23-jun-21	3,86%	3,84%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	32.106	0,01%	IPCA		04-jun-21	3,37%	3,28%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	8.027	0,00%	IPCA		16-jun-21	3,53%	3,53%	ATLANTIDA 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