

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/05/2021

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	101.532.120,46	100%									
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.				0,91%	2,34%	5,13%	3,64%	9,13%	12,29%	18,69%
Renda Fixa Total Return	101.532.120,46	100%		0,75%	2,72%	3,30%	4,39%	3,43%	6,89%	12,06%	22,29%
ATLANTIDA FI MULT	51.683.552,46	50,90%	ITAU	100%	0,68%	1,35%	2,68%	1,60%	5,27%	11,65%	22,61%
ITAPEMA FI MULT	49.848.568,00	49,10%	TAG INVEST	100%	0,85%	0,53%	0,89%	1,65%	0,87%	3,61%	7,20%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.				0,91%	2,34%	5,13%	3,64%	9,13%	12,29%	18,69%
Total	101.529.452,16	100%		0,75%	0,54%	1,05%	2,18%	1,19%	4,44%	9,43%	19,13%
Benchmark:	IPCA + 1,2% a.a.				0,93%	2,39%	5,23%	3,72%	9,35%	12,73%	19,39%

* 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.

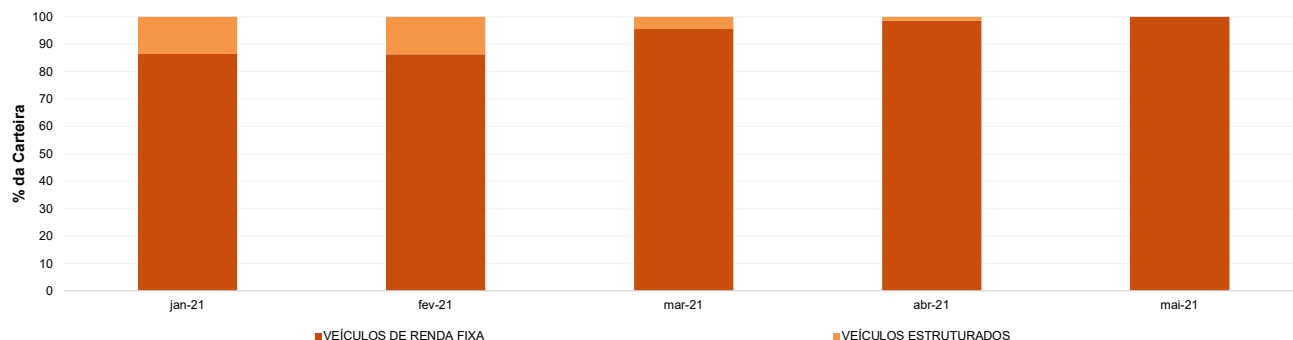
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

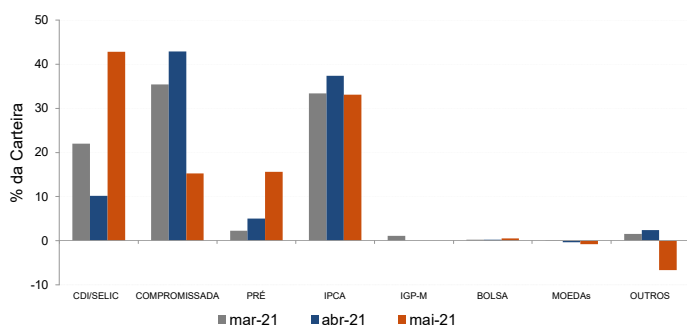
Distribuição da Carteira

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.

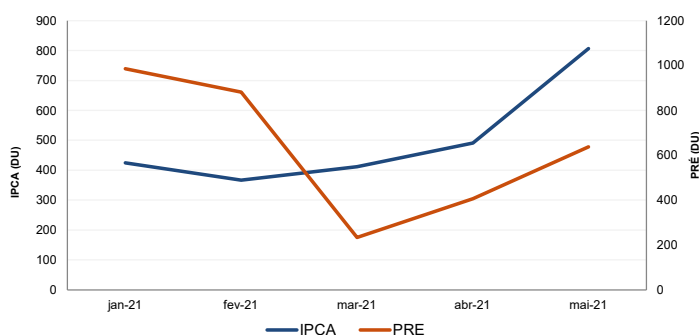
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
BOVA11	Fundos	70,41	10,69	0,00	
BOVV11	Fundos	64,47	9,79	0,00	
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	61,03	9,27	32,92	9,00
RECV3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	59,02	8,96	0,00	
BRKM5	Químicos	56,69	8,61	4,04	1,10
VALE US	Mineração	55,94	8,50	0,00	
LREN3	Comércio	48,83	7,42	14,94	4,09
TOTS3	Programas e Serviços	43,13	6,55	7,44	2,03
ASAI3	Comércio e Distribuição	42,08	6,39	4,98	1,36
JHSF3	Construção e Engenharia	40,91	6,21	0,00	0,00

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

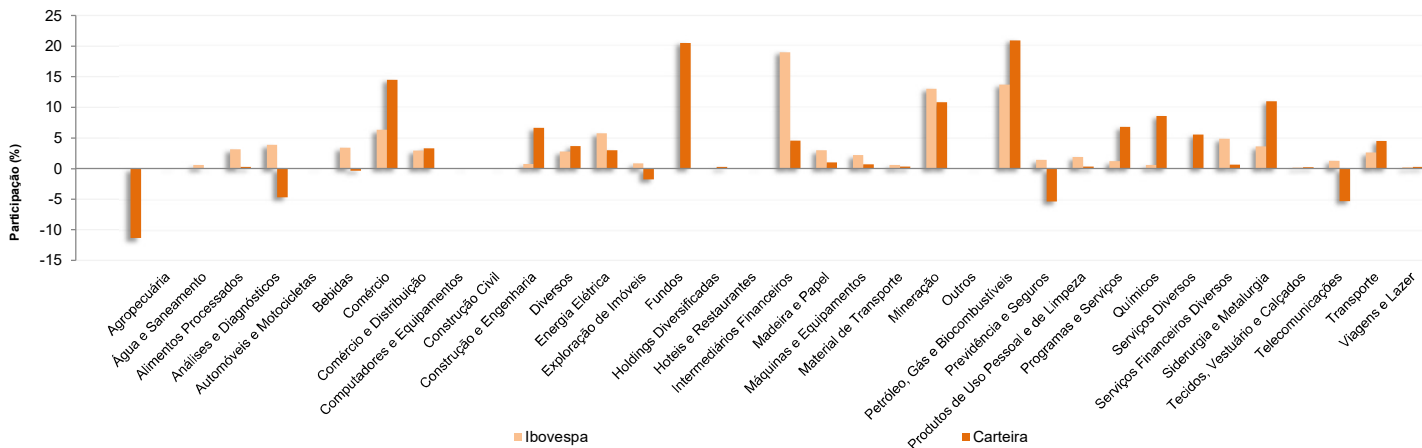
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PETR3	61,03	9,27	0,00	1
RECV3	59,02	8,96	0,00	1
BRKM5	56,69	8,61	0,00	1
LREN3	48,83	7,42	0,00	1
TOTS3	43,13	6,55	0,00	1
ASAI3	42,08	6,39	0,00	1
JHSF3	40,91	6,21	0,00	1
DIRR3	38,64	5,87	0,00	1
SEQL3	35,32	5,36	0,00	1
CSNA3	23,98	3,64	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

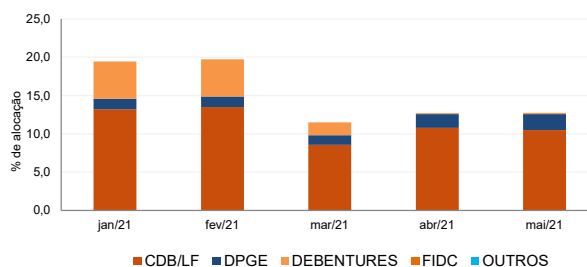
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	4.302,61	4,30	Faixa 2
BCO SAFRA SA	3.854,56	3,86	Faixa 2
BANCO C6 S.A.	2.042,05	2,04	Sem Faixa
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.145,52	1,15	Faixa 1
PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	712,59	0,71	Faixa 2
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	244,58	0,24	Faixa 1
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	184,97	0,19	Sem Faixa
BCO VOLKSWAGEN SA	150,00	0,15	Faixa 1
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	118,05	0,12	Faixa 2
BANCO CSF SA	100,16	0,10	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
BSA315	69,21	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	Sem Faixa	Faixa 1	24-mai-24	CDI	1,17%	ATLANTIDA FI MULT
BSA325	111,82	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	Sem Faixa	Faixa 1	24-mai-26	CDI	1,39%	ATLANTIDA FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/05/2021

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
BSA315	24-mai-24	69.212	0,07%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	27-mai-21	1,17%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
BSA325	24-mai-26	111.824	0,11%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	27-mai-21	1,39%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CDB PRE	03-abr-23	81.278	0,08%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	25-mai-21	8,51%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CDB PRE	19-mai-23	81.794	0,08%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	19-mai-21	8,80%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CDB PRE	03-jul-23	81.509	0,08%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	27-mai-21	8,72%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	02-jun-23	100.162	0,10%	CDI	BANCO CSF SA	18-mai-21	1,20%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	06-jun-23	50.018	0,05%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	27-mai-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	12-jun-23	50.000	0,05%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	31-mai-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	27-mai-24	50.018	0,05%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	27-mai-21	1,20%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	31-mai-24	100.000	0,10%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	31-mai-21	1,25%	Faixa 1	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	7.645.823	7,65%	Selic		07-mai-21	0,08%	0,08%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.367.599	2,37%	Selic		24-mai-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.900.595	1,90%	Selic		17-mai-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.618.221	1,62%	Selic		10-mai-21	0,08%	0,08%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	76.024	0,08%	Selic		05-mai-21	7,00%	0,07%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	54.303	0,05%	Selic		03-mai-21	7,00%	0,07%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	54.303	0,05%	Selic		26-mai-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	280.954	0,28%	IPCA		12-mai-21	1,30%	1,33%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	273.360	0,27%	IPCA		25-mai-21	1,27%	1,27%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	151.867	0,15%	IPCA		25-mai-21	1,23%	1,27%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	313.919	0,31%	IPCA		25-mai-21	1,79%	1,86%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	256.495	0,26%	IPCA		12-mai-21	1,84%	1,92%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	206.727	0,21%	IPCA		19-mai-21	1,89%	1,94%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	137.818	0,14%	IPCA		25-mai-21	1,80%	1,86%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	43.169	0,04%	IPCA		25-mai-21	3,09%	3,18%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	19.622	0,02%	IPCA		17-mai-21	3,06%	3,00%	ATLANTIDA FI MULT

