

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>149.989.518,60</b>	<b>100%</b>										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,91%	2,34%	5,13%	3,64%	9,13%	12,29%	18,69%
<b>Renda Fixa Total Return</b>	<b>149.989.518,60</b>	<b>100%</b>			<b>1,66%</b>	<b>1,97%</b>	<b>2,54%</b>	<b>3,62%</b>	<b>2,67%</b>	<b>5,93%</b>	<b>10,99%</b>	<b>21,11%</b>
ATLANTIDA 2 FI MULT	74.393.005,41	49,60%	ITAU	100%	1,90%	0,97%	-	-	-	-	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	75.596.513,19	50,40%	TAG INVEST	100%	1,45%	1,07%	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,91%	2,34%	5,13%	3,64%	9,13%	12,29%	18,69%
<b>Total</b>	<b>149.988.655,00</b>	<b>100%</b>			<b>1,66%</b>	<b>1,05%</b>	<b>1,79%</b>	<b>3,10%</b>	<b>1,27%</b>	<b>7,76%</b>	<b>11,24%</b>	<b>23,72%</b>
Benchmark:	IPCA + 2,55% a.a.					1,04%	2,74%	5,92%	4,28%	10,80%	15,75%	24,22%

\* 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.

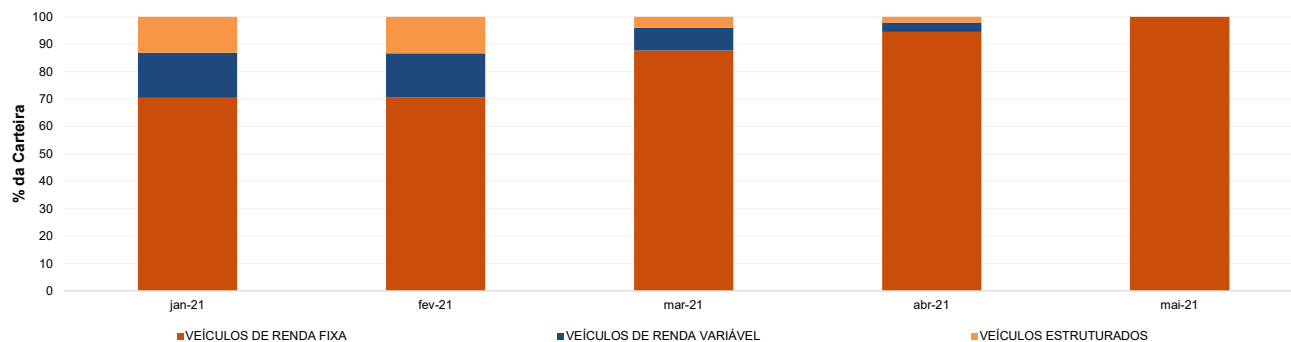
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

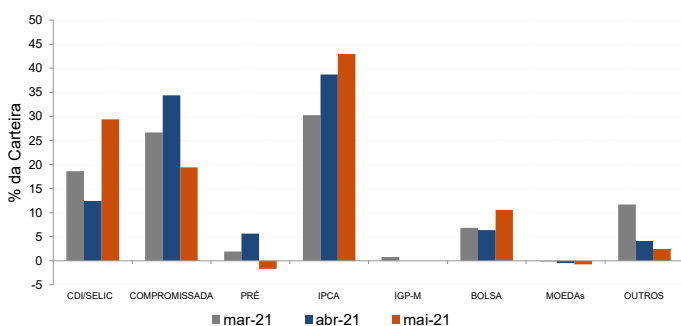
## Distribuição da Carteira

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.

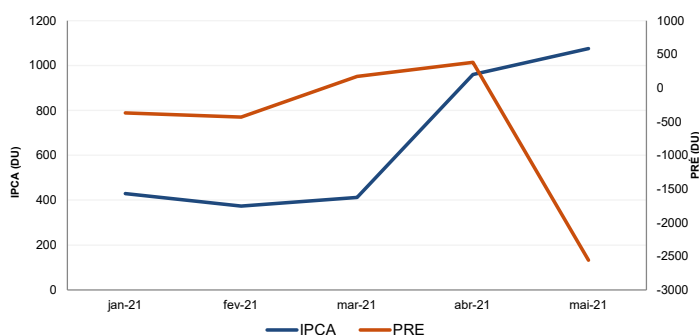
## Evolução do Patrimônio Líquido



## 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	725,40	6,16	492,87	7,04
BPAC11	Intermediários Financeiros	441,62	3,75	30,55	0,44
BBDC4	Intermediários Financeiros	430,81	3,66	64,17	0,92
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	360,87	3,06	394,38	5,63
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	333,53	2,83	77,18	1,10
ITSA4	Intermediários Financeiros	323,11	2,74	219,76	3,14
ITUB4	Intermediários Financeiros	322,36	2,74	562,69	8,04
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	320,53	2,72	458,71	6,55
LREN3	Comércio	314,91	2,67	404,79	5,78
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	275,10	2,34	274,41	3,92

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

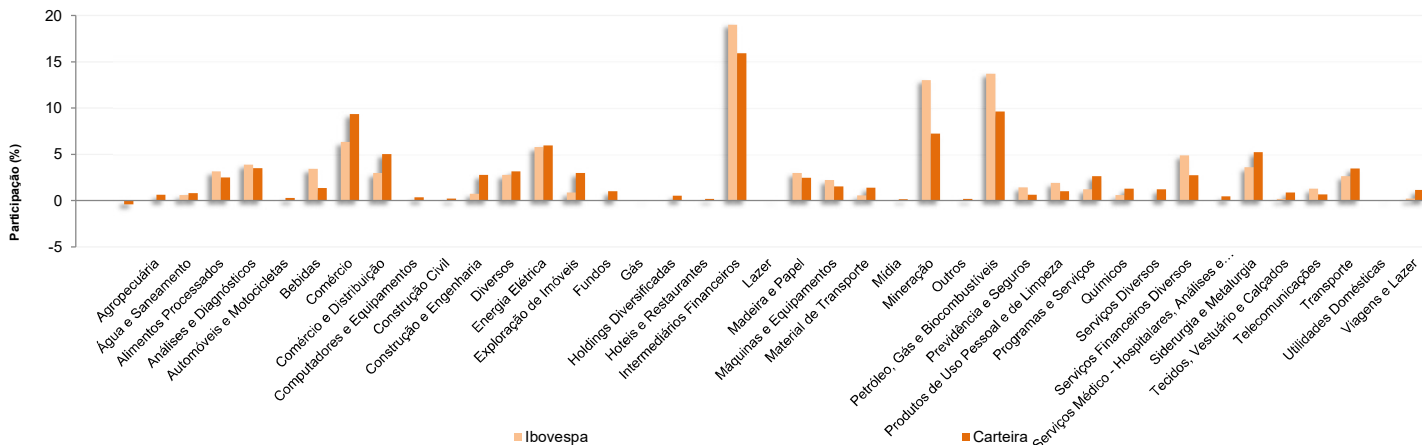
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
SMLE11	6,74	0,06	0,00	Sem Liquidez
VALE3	725,40	6,16	0,00	1
BPAC11	441,62	3,75	0,00	1
BBDC4	430,81	3,66	0,00	1
PETR4	360,87	3,06	0,00	1
PETR3	333,53	2,83	0,00	1
ITSA4	323,11	2,74	0,00	1
ITUB4	322,36	2,74	0,00	1
GGBR4	320,53	2,72	0,00	1
LREN3	314,91	2,67	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.



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.

## Análises de Contrapartes

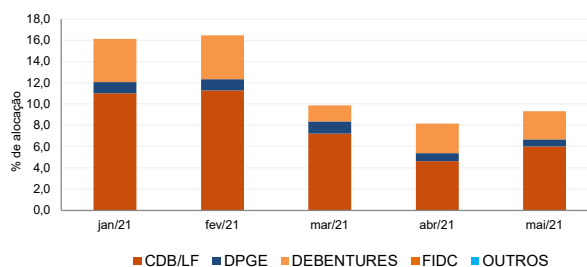
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	2.634,40	1,77	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.214,57	1,49	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	2.051,92	1,38	Faixa 2
BCO SAFRA SA	1.897,84	1,28	Faixa 2
BCO ITAU SA	1.851,22	1,24	Faixa 2
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.017,62	0,68	Faixa 4
CIA LOCAÇÃO AMERICAS	852,74	0,57	Faixa 2
VALE SA	725,40	0,49	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	694,40	0,47	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	628,27	0,42	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	108,47	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	Sem Faixa	Faixa 1	24-mai-24	CDI	1,17%	ATLANTIDA 2 FI MULT
BSA325	175,12	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	Sem Faixa	Faixa 1	24-mai-26	CDI	1,39%	ATLANTIDA 2 FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	108.466	0,07%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	27-mai-21	1,17%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
BSA325	24-mai-26	175.121	0,12%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	27-mai-21	1,39%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
CDB PRE	03-abr-23	127.575	0,09%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	25-mai-21	8,51%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
CDB PRE	19-mai-23	128.386	0,09%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	19-mai-21	8,80%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
CDB PRE	03-jul-23	127.937	0,09%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	27-mai-21	8,72%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	02-jun-23	50.081	0,03%	CDI	BANCO CSF SA	18-mai-21	1,20%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	06-jun-23	50.018	0,03%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	27-mai-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	12-jun-23	50.000	0,03%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	31-mai-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	06-mai-24	802.658	0,54%	CDI	BCO SAFRA SA	05-mai-21	1,35%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	27-mai-24	50.018	0,03%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	27-mai-21	1,20%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	31-mai-24	100.000	0,07%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	31-mai-21	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF IPCA	17-mai-28	1.095.182	0,74%	IPCA	BCO SAFRA SA	17-mai-21	6,00%	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	2.541.367	1,71%	Selic		07-mai-21	0,08%	0,08%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.194.660	0,80%	Selic		25-mai-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	575.609	0,39%	Selic		11-mai-21	0,08%	0,09%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	86.884	0,06%	Selic		28-mai-21	0,10%	0,10%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	86.884	0,06%	Selic		12-mai-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	65.129	0,04%	Selic		18-mai-21	0,10%	0,10%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.257.252	0,85%	Selic		17-mai-21	0,13%	0,13%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	474.584	0,32%	IPCA		19-mai-21	1,30%	1,35%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	356.030	0,24%	IPCA		17-mai-21	1,94%	1,86%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	95.707	0,06%	IPCA		21-mai-21	1,87%	1,82%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	43.169	0,03%	IPCA		17-mai-21	3,06%	3,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.022.296	0,69%	IPCA		06-mai-21	3,44%	3,42%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	982.048	0,66%	IPCA		14-mai-21	3,44%	3,44%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	40.248	0,03%	IPCA		27-mai-21	3,50%	3,46%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	32.198	0,02%	IPCA		21-mai-21	3,44%	3,41%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	359.087	0,24%	IPCA		06-mai-21	3,86%	3,85%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	334.604	0,22%	IPCA		14-mai-21	3,85%	3,84%	ATLANTIDA 2 FI MULT

