

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	259.848.327,06	100%				2,41%	3,05%	4,21%	3,25%	6,64%	11,81%	21,65%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					0,91%	2,34%	5,13%	3,64%	9,13%	12,29%	18,69%
Renda Fixa Total Return	251.521.639,05	96,80%			1,29%	0,72%	1,29%	2,36%	1,42%	4,64%	9,66%	19,67%
ATLANTIDA FI MULT	51.683.552,46	19,89%	ITAU	100%	0,68%	0,58%	1,35%	2,68%	1,60%	5,27%	11,65%	22,61%
ATLANTIDA 2 FI MULT	74.393.005,41	28,63%	ITAU	100%	1,90%	0,97%	-	-	-	-	-	-
ITAPEMA FI MULT	49.848.568,00	19,18%	TAG INVEST	100%	0,85%	0,53%	0,89%	1,65%	0,87%	3,61%	7,20%	16,29%
ITAPEMA 2 FI MULT	75.596.513,19	29,09%	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%
Renda Fixa ALM	6.547.427,28	2,52%										
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PRÓPRIA RF	6.547.427,28	2,52%		100%		1,06%	3,92%	8,08%	6,23%	14,63%	24,90%	39,74%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,19%	3,20%	6,85%	5,03%	12,78%	19,92%	31,00%
Renda Fixa CDI	1.779.260,72	0,68%			0,06%	0,29%	0,60%	1,43%	1,20%	2,86%	4,84%	12,26%
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.159.315,56	0,45%	BRADESCO	0,02%	0,05%	0,29%	0,63%	1,11%	0,89%	1,91%	6,80%	13,56%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	619.945,17	0,24%	ITAU	0,00%	0,08%	0,29%	0,59%	1,08%	0,85%	1,86%	6,65%	13,29%
Benchmark:	CDI					0,27%	0,67%	1,13%	0,96%	2,18%	7,17%	14,00%
Total	259.843.213,50	100%			1,24%	0,75%	1,54%	2,84%	1,35%	6,69%	10,69%	21,12%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					1,19%	3,20%	6,85%	5,03%	12,78%	19,92%	31,00%

* 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.

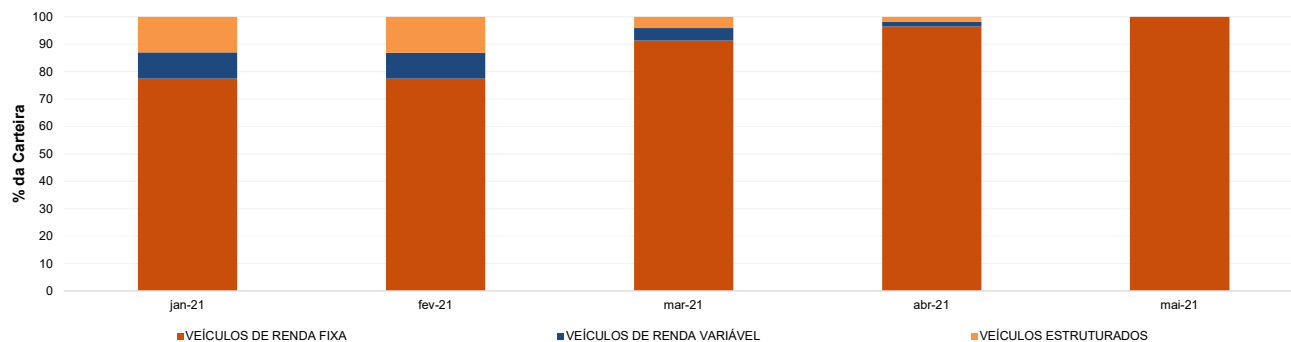
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

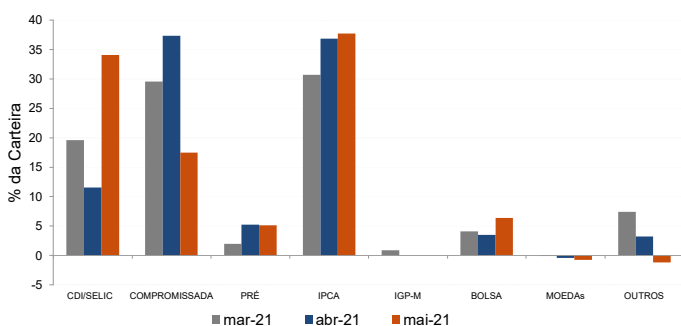
Distribuição da Carteira

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.

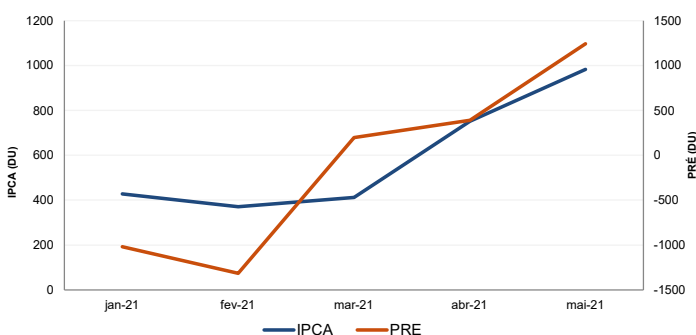
Evolução do Patrimônio Líquido



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	738,53	5,94	522,47	7,09
BPAC11	Intermediários Financeiros	447,69	3,60	38,87	0,53
BBDC4	Intermediários Financeiros	436,02	3,51	73,92	1,00
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	394,57	3,17	110,10	1,49
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	372,82	3,00	393,39	5,34
LREN3	Comércio	363,74	2,93	419,73	5,70
ITUB4	Intermediários Financeiros	331,23	2,66	582,66	7,91
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	329,47	2,65	466,14	6,33
ITSA4	Intermediários Financeiros	326,70	2,63	224,69	3,05
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	279,04	2,24	288,83	3,92

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

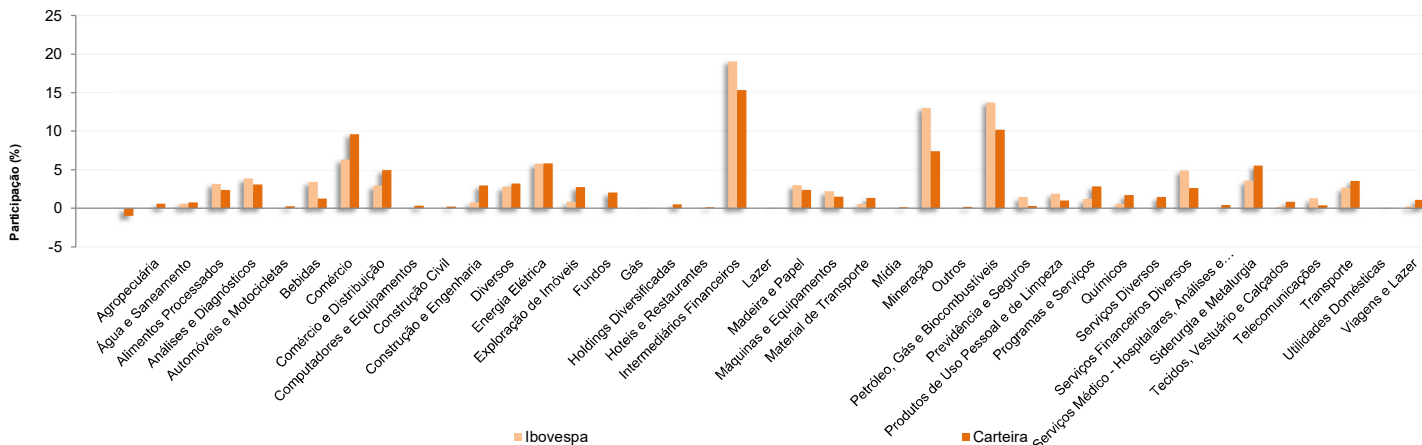
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
SMLE11	6,74	0,05	0,00	Sem Liquidez
VALE3	738,53	5,94	0,00	1
BPAC11	447,69	3,60	0,00	1
BBDC4	436,02	3,51	0,00	1
PETR3	394,57	3,17	0,00	1
PETR4	372,82	3,00	0,00	1
LREN3	363,74	2,93	0,00	1
ITUB4	331,23	2,66	0,00	1
GGBR4	329,47	2,65	0,00	1
ITSA4	326,70	2,63	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

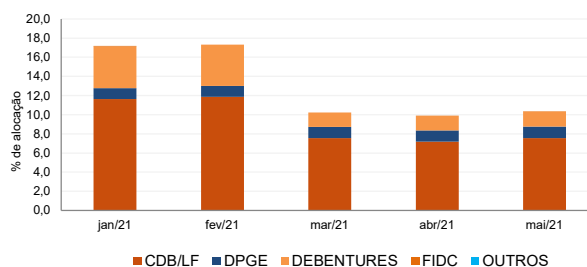
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	6.153,82	2,39	Faixa 2
BCO SAFRA SA	5.752,40	2,24	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	2.641,76	1,03	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.214,57	0,86	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	2.051,92	0,80	Faixa 2
BANCO C6 S.A.	2.042,05	0,79	Sem Faixa
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.245,56	0,48	Faixa 1
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.017,62	0,40	Faixa 4
CIA LOCAÇAO AMERICAS	854,17	0,33	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	767,39	0,30	Faixa 2

* 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
BSA315	108,47	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	Sem Faixa	Faixa 1	24-mai-24	CDI	1,17%	ATLANTIDA 2 FI MULT
BSA325	111,82	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	Sem Faixa	Faixa 1	24-mai-26	CDI	1,39%	ATLANTIDA FI MULT
BSA325	175,12	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	Sem Faixa	Faixa 1	24-mai-26	CDI	1,39%	ATLANTIDA 2 FI MULT

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	0,04%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	27-mai-21	1,17%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
BSA315	24-mai-24	69.212	0,03%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	27-mai-21	1,17%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
BSA325	24-mai-26	175.121	0,07%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	27-mai-21	1,39%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
BSA325	24-mai-26	111.824	0,04%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	27-mai-21	1,39%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CDB PRE	03-abr-23	127.575	0,05%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	25-mai-21	8,51%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
CDB PRE	03-abr-23	81.278	0,03%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	25-mai-21	8,51%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CDB PRE	19-mai-23	128.386	0,05%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	19-mai-21	8,80%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
CDB PRE	19-mai-23	81.794	0,03%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	19-mai-21	8,80%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CDB PRE	03-jul-23	127.937	0,05%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	27-mai-21	8,72%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
CDB PRE	03-jul-23	81.509	0,03%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	27-mai-21	8,72%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	02-jun-23	100.162	0,04%	CDI	BANCO CSF SA	18-mai-21	1,20%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	02-jun-23	50.081	0,02%	CDI	BANCO CSF SA	18-mai-21	1,20%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	06-jun-23	50.018	0,02%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	27-mai-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	06-jun-23	50.018	0,02%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	27-mai-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	12-jun-23	50.000	0,02%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	31-mai-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	12-jun-23	50.000	0,02%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	31-mai-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	06-mai-24	802.658	0,31%	CDI	BCO SAFRA SA	05-mai-21	1,35%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	27-mai-24	50.018	0,02%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	27-mai-21	1,20%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	27-mai-24	50.018	0,02%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	27-mai-21	1,20%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	31-mai-24	100.000	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	31-mai-21	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	31-mai-24	100.000	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	31-mai-21	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF IPCA	17-mai-28	1.095.182	0,43%	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	7.645.823	2,97%	Selic		07-mai-21	0,08%	0,08%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.541.367	0,99%	Selic		07-mai-21	0,08%	0,08%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.367.599	0,92%	Selic		24-mai-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.900.595	0,74%	Selic		17-mai-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.618.221	0,63%	Selic		10-mai-21	0,08%	0,08%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.194.660	0,46%	Selic		25-mai-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	575.609	0,22%	Selic		11-mai-21	0,08%	0,09%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	86.884	0,03%	Selic		28-mai-21	0,10%	0,10%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	86.884	0,03%	Selic		12-mai-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	76.024	0,03%	Selic		05-mai-21	7,00%	0,07%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	54.303	0,02%	Selic		03-mai-21	7,00%	0,07%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	54.303	0,02%	Selic		26-mai-21	0,09%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	65.129	0,03%	Selic		18-mai-21	0,10%	0,10%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.257.252	0,49%	Selic		17-mai-21	0,13%	0,13%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	12.374	0,00%	Selic		05-mai-21	0,14%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	474.584	0,18%	IPCA		19-mai-21	1,30%	1,35%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	280.954	0,11%	IPCA		12-mai-21	1,30%	1,33%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	273.360	0,11%	IPCA		25-mai-21	1,27%	1,27%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	151.867	0,06%	IPCA		25-mai-21	1,23%	1,27%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	356.030	0,14%	IPCA		17-mai-21	1,94%	1,86%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	313.919	0,12%	IPCA		25-mai-21	1,79%	1,86%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	256.495	0,10%	IPCA		12-mai-21	1,84%	1,92%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	206.727	0,08%	IPCA		19-mai-21	1,89%	1,94%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	137.818	0,05%	IPCA		25-mai-21	1,80%	1,86%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	95.707	0,04%	IPCA		21-mai-21	1,87%	1,82%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	50.946	0,02%	IPCA		05-mai-21	3,12%	3,08%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	43.169	0,02%	IPCA		25-mai-21	3,09%	3,18%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	43.169	0,02%	IPCA		17-mai-21	3,06%	3,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	19.622	0,01%	IPCA		17-mai-21	3,06%	3,00%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.022.296	0,40%	IPCA		06-mai-21	3,44%	3,42%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	982.048	0,38%	IPCA		14-mai-21	3,44%	3,44%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	68.257	0,03%	IPCA		05-mai-21	3,47%	3,46%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	40.248	0,02%	IPCA		27-mai-21	3,50%	3,46%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	32.198	0,01%	IPCA		21-mai-21	3,44%	3,41%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	359.087	0,14%	IPCA		06-mai-21	3,86%	3,85%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	334.604	0,13%	IPCA		14-mai-21	3,85%	3,84%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	304.489	0,12%	IPCA		05-mai-21	3,88%	3,88%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	135.439	0,05%	IPCA		05-mai-21	4,10%	4,08%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	16.910	0,01%	IPCA		05-mai-21	4,15%	4,14%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
NTN-B 2040-08-15	15-ago-40	34.683	0,01%	IPCA		05-mai-21	4,37%	4,36%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	39.632	0,02%	IPCA		05-mai-21	4,58%	4,59%	RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPF