

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/03/2021

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>96.773.089,83</b>	<b>88,15%</b>											
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,02%	2,30%	5,76%	2,30%	7,15%	11,81%	18,08%	
<b>Renda Fixa Total Return</b>	<b>96.773.089,83</b>	<b>88,15%</b>			<b>0,42%</b>	<b>0,30%</b>	<b>0,43%</b>	<b>2,38%</b>	<b>0,43%</b>	<b>4,40%</b>	<b>11,06%</b>	<b>18,70%</b>	
ATLANTIDA FI MULT	51.626.977,29	47,03%	ITAU	41,89%	0,66%	0,39%	0,64%	3,14%	0,64%	4,91%	12,88%	21,82%	
ITAPEMA FI MULT	45.146.112,54	41,12%	SUL AMERICA	48,65%	0,16%	0,20%	0,18%	1,50%	0,18%	3,47%	8,65%	15,11%	
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,02%	2,30%	5,76%	2,30%	7,15%	11,81%	18,08%	
<b>Estruturado</b>	<b>4.441.469,05</b>	<b>4,05%</b>											
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,47%	1,20%	2,44%	1,20%	5,27%	14,36%	25,23%	
<b>Multimercado Estruturado</b>	<b>4.441.469,05</b>	<b>4,05%</b>			<b>0,96%</b>	<b>0,31%</b>	<b>0,54%</b>	<b>3,05%</b>	<b>0,54%</b>	<b>5,55%</b>	<b>10,77%</b>	<b>15,30%</b>	
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	2.856.171,23	2,60%	ABSOLUTE	0,32%	0,81%	0,31%	0,48%	0,84%	0,48%	1,82%	9,54%	19,30%	
ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	1.585.297,82	1,44%	ITAU	0,03%	1,42%	0,33%	0,54%	3,03%	0,54%	6,88%	13,07%	24,03%	
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,47%	1,20%	2,44%	1,20%	5,27%	14,36%	25,23%	
<b>Total</b>	<b>109.779.858,02</b>	<b>100%</b>			<b>0,39%</b>	<b>0,25%</b>	<b>0,39%</b>	<b>2,39%</b>	<b>0,39%</b>	<b>4,34%</b>	<b>10,69%</b>	<b>17,98%</b>	
Benchmark:	IPCA + 1,2% a.a.					1,04%	2,35%	5,87%	2,35%	7,36%	12,25%	18,78%	

\* 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.

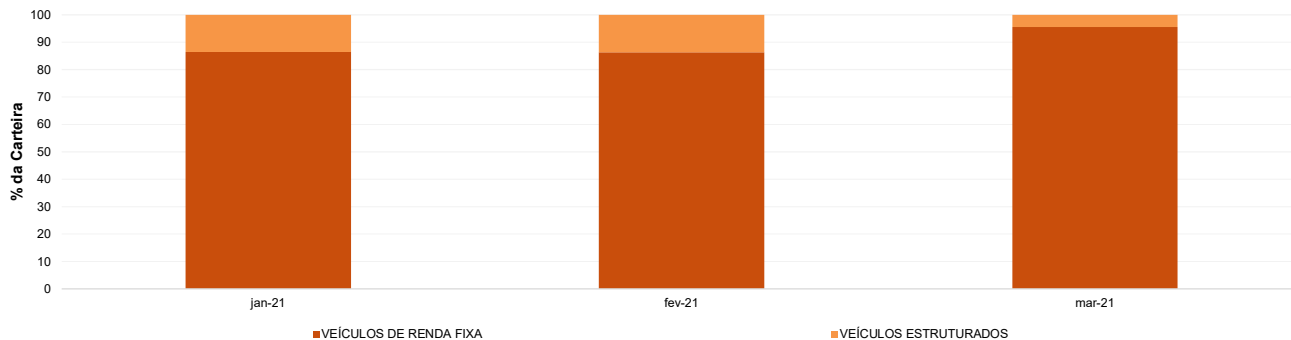
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

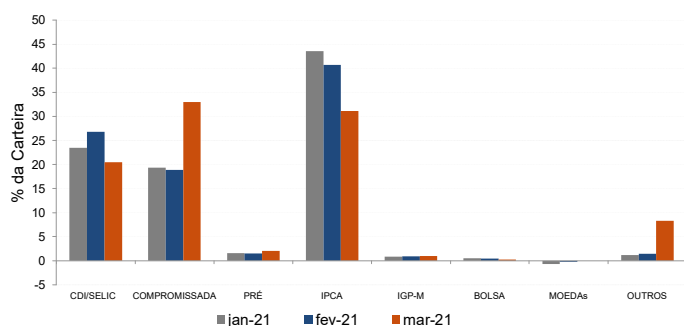
## Distribuição da Carteira

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.

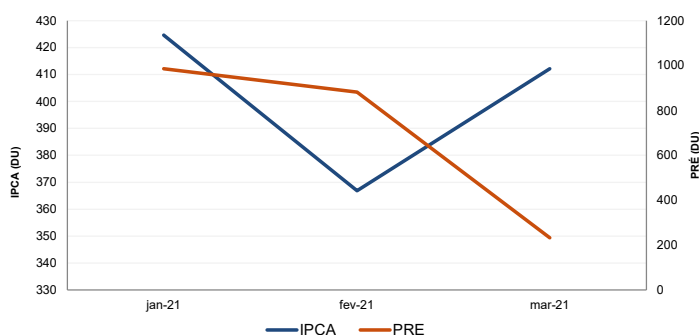
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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*	%
LINX3	Programas e Serviços	137,03	31,80	160,30	18,52
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	52,91	12,28	79,66	9,20
CPLE3	Energia Elétrica	43,46	10,09	35,36	4,08
LCAM3	Diversos	28,18	6,54	51,15	5,91
VALE3	Mineração	21,00	4,87	61,54	7,11
ITUB4	Intermediários Financeiros	19,72	4,58	5,25	0,61
KEPL3	Máquinas e Equipamentos	17,72	4,11	20,71	2,39
BBDC3	Intermediários Financeiros	12,75	2,96	26,95	3,11
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	12,45	2,89	39,21	4,53
PETZ3	Comércio	9,18	2,13	11,04	1,28

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

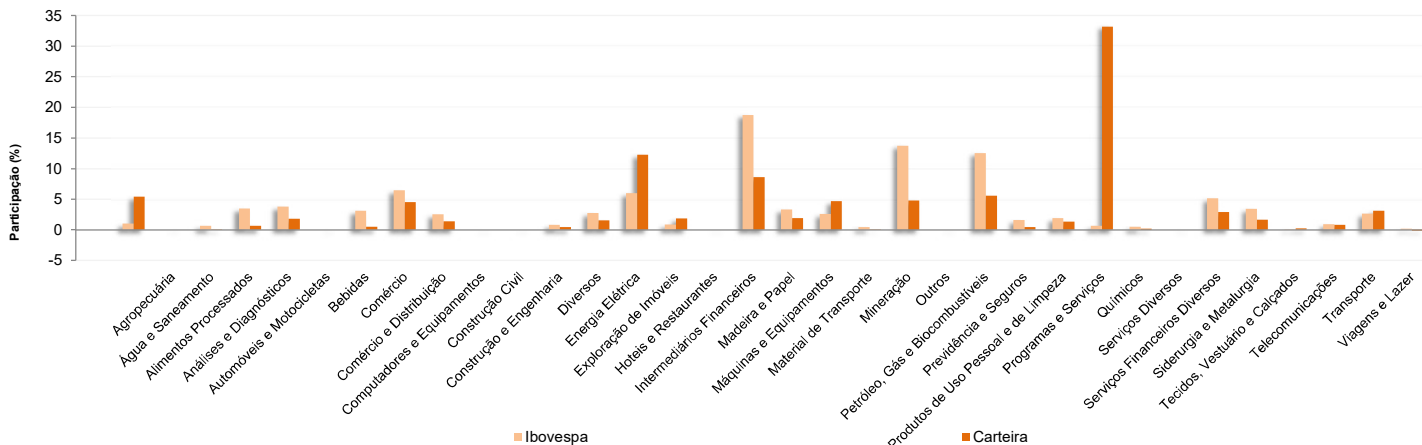
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
LINX3	137,03	31,80	0,00	1
PETR3	52,91	12,28	0,00	1
CPLE3	43,46	10,09	0,01	1
LCAM3	28,18	6,54	0,00	1
VALE3	21,00	4,87	0,00	1
ITUB4	19,72	4,58	0,00	1
KEPL3	17,72	4,11	0,00	1
BBDC3	12,75	2,96	0,00	1
B3SA3	12,45	2,89	0,00	1
PETZ3	9,18	2,13	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

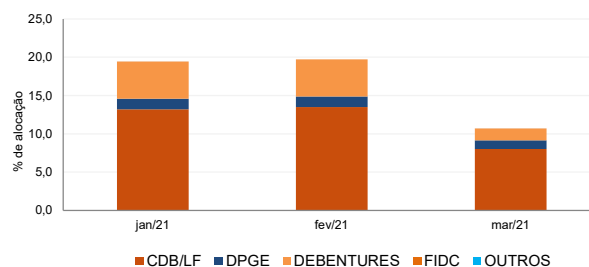
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	3.011,85	2,75	Faixa 2
BCO SAFRA SA	2.033,52	1,85	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	1.152,61	1,05	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	919,94	0,84	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	861,03	0,79	Faixa 2
BCO DAYCOVAL SA	859,76	0,78	Faixa 2
BANCO C6 S.A.	849,28	0,77	Sem Faixa
BCO TOYOTA BRASIL SA	435,33	0,40	Faixa 1
OMNI SA CRED FINANC INVEST	423,09	0,39	Faixa 4
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	371,65	0,34	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/03/2021

## 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	12-mar-24	83.943	0,08%	CDI	PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	12-mar-21	1,45%	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	969.061	0,88%	Selic		15-mar-21	4,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	729.060	0,66%	Selic		18-mar-21	4,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	307.926	0,28%	Selic		01-mar-21	6,00%	0,05%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	27.170	0,02%	Selic		19-mar-21	4,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	34.533	0,03%	IPCA		22-mar-21	1,13%	1,15%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	13.603.465	12,40%	IPCA		15-mar-21	1,63%	1,68%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	16.148	0,01%	IPCA		22-mar-21	1,97%	2,00%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	21.508	0,02%	IPCA		03-mar-21	2,96%	2,93%	ATLANTIDA FI MULT

