

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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 | |
| Renda Fixa | 119.272.333,21 | 80,75% | | | | | | | | | | | |
| Benchmark: | IPCA + 1% a.a. | | | | | 1,02% | 2,30% | 5,76% | 2,30% | 7,15% | 11,81% | 18,08% | |
| Renda Fixa Total Return | 119.272.333,21 | 80,75% | | | 0,45% | 0,30% | 0,42% | 2,35% | 0,42% | 4,21% | 10,79% | 18,32% | |
| ATLANTIDA FI MULT | 71.620.613,31 | 48,49% | ITAU | 58,11% | 0,66% | 0,39% | 0,64% | 3,14% | 0,64% | 4,91% | 12,88% | 21,82% | |
| ITAPEMA FI MULT | 47.651.719,90 | 32,26% | SUL AMERICA | 51,35% | 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% | |
| Renda Variável | 11.239.223,73 | 7,61% | | | | | | | | | | | |
| Benchmark: | IBOVESPA + 3% a.a. | | | | | 6,28% | -1,30% | 25,09% | -1,30% | 64,48% | 29,68% | 49,26% | |
| Renda Variável Ativa | 11.239.223,73 | 7,61% | | | 10,16% | 1,72% | -1,94% | 14,79% | -1,94% | 58,23% | 23,95% | 41,37% | |
| AZ QUEST ACOES FC FIA | 3.378.851,77 | 2,29% | AZ QUEST | 0,45% | 10,39% | 1,92% | -3,15% | 13,11% | -3,15% | 51,47% | 15,09% | 28,48% | |
| BRADESCO FIA SELECTION | 3.368.907,00 | 2,28% | BRADESCO | 0,46% | 10,53% | 0,16% | -5,50% | 14,00% | -5,50% | 51,45% | 10,58% | 25,01% | |
| ITAU ACOES DUNAMIS INSTITUCIONAL FC | 4.491.464,95 | 3,04% | ITAU | 2,03% | 10,11% | 2,77% | 1,08% | 21,49% | 1,08% | - | - | - | |
| Benchmark: | IBOVESPA + 3% a.a. | | | | | 6,28% | -1,30% | 25,09% | -1,30% | 64,48% | 29,68% | 49,26% | |
| Estruturado | 5.486.694,19 | 3,71% | | | | | | | | | | | |
| Benchmark: | CDI + 3% a.a. | | | | | 0,47% | 1,20% | 2,44% | 1,20% | 5,27% | 14,36% | 25,23% | |
| Multimercado Estruturado | 5.486.694,19 | 3,71% | | | 1,05% | 0,32% | 0,44% | 3,02% | 0,44% | 6,05% | 11,10% | 15,77% | |
| ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT | 2.710.042,13 | 1,83% | ABSOLUTE | 0,30% | 0,81% | 0,31% | 0,48% | 0,84% | 0,48% | 1,82% | 9,54% | 19,30% | |
| ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI | 2.776.652,05 | 1,88% | ITAU | 0,06% | 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% | |
| Total | 147.708.753,44 | 100% | | | 1,10% | 0,42% | -0,09% | 3,79% | -0,09% | 9,00% | 12,21% | 20,70% | |
| Benchmark: | IPCA + 2,55% a.a. | | | | | 1,16% | 2,68% | 6,56% | 2,68% | 8,78% | 15,27% | 23,59% | |

* 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.

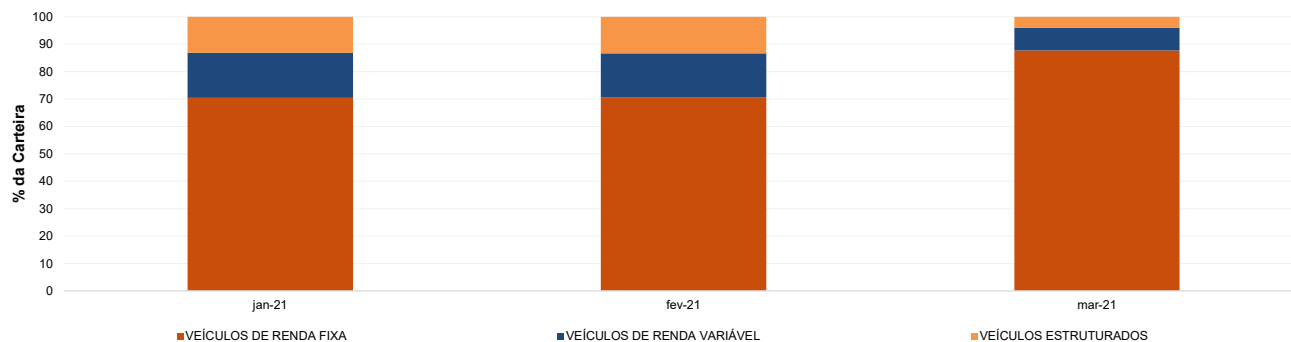
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

Distribuição da Carteira

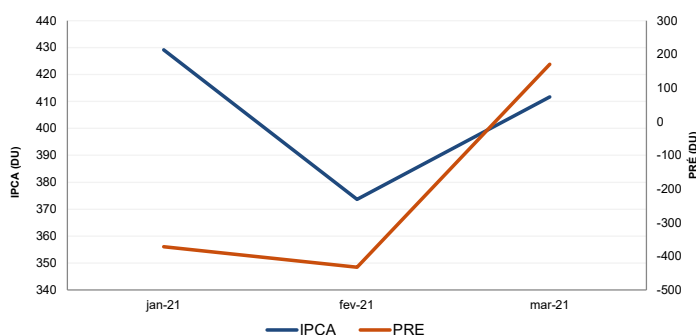
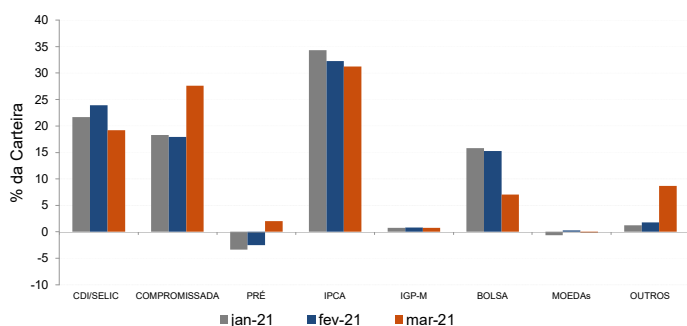
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais 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 | 1.071,60 | 9,37 | 2.126,08 | 8,48 |
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 1.009,13 | 8,82 | 473,58 | 1,89 |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 888,77 | 7,77 | 752,45 | 3,00 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 870,10 | 7,61 | 241,87 | 0,97 |
| B3SA3 | Serviços Financeiros Diversos | 680,33 | 5,95 | 705,59 | 2,82 |
| LREN3 | Comércio | 449,09 | 3,93 | 469,34 | 1,87 |
| GGBR4 | Siderurgia e Metalurgia | 420,03 | 3,67 | 113,67 | 0,45 |
| BRDT3 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 324,72 | 2,84 | 297,03 | 1,19 |
| ENG11 | Energia Elétrica | 309,58 | 2,71 | 287,26 | 1,15 |
| JBSS3 | Alimentos Processados | 301,71 | 2,64 | 240,14 | 0,96 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

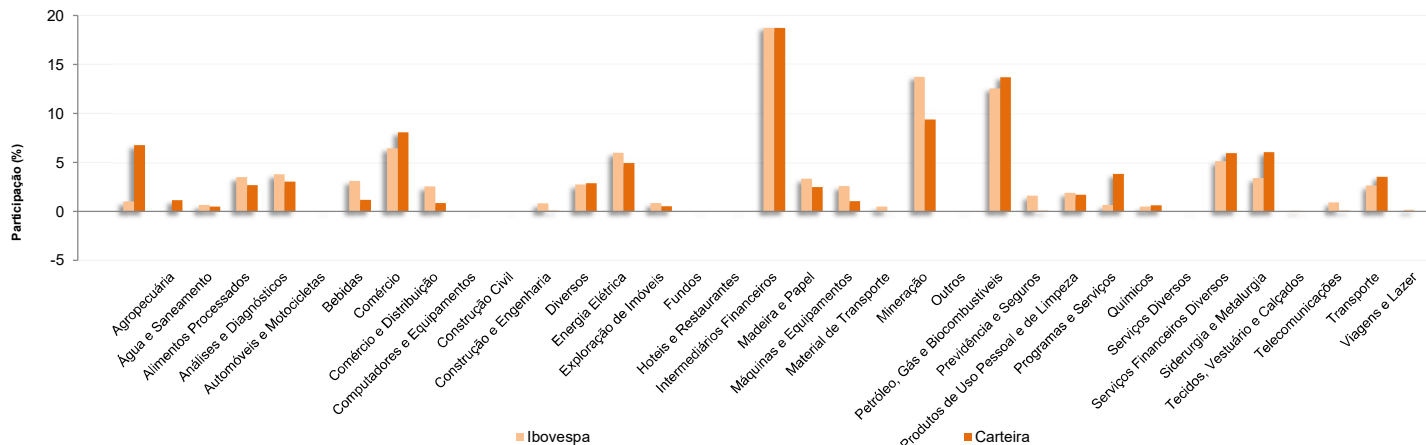
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|-------|----------|------|--------------|--------------------|
| VALE3 | 1.071,60 | 9,37 | 0,00 | 1 |
| PETR4 | 1.009,13 | 8,82 | 0,00 | 1 |
| BBDC4 | 888,77 | 7,77 | 0,00 | 1 |
| ITUB4 | 870,10 | 7,61 | 0,00 | 1 |
| B3SA3 | 680,33 | 5,95 | 0,00 | 1 |
| LREN3 | 449,09 | 3,93 | 0,00 | 1 |
| GGBR4 | 420,03 | 3,67 | 0,00 | 1 |
| BRDT3 | 324,72 | 2,84 | 0,00 | 1 |
| ENG11 | 309,58 | 2,71 | 0,00 | 1 |
| JBSS3 | 301,71 | 2,64 | 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.



Análises de Contrapartes

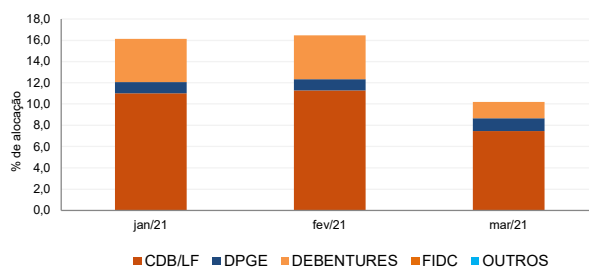
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|----------------------------------|----------|------|---------------------------|
| BCO ITAU SA | 3.402,53 | 2,31 | Faixa 2 |
| BCO SAFRA SA | 2.821,04 | 1,91 | Faixa 2 |
| BCO BRADESCO SA | 2.093,79 | 1,42 | Faixa 2 |
| ESTACIO PARTICIPACOES SA | 1.276,21 | 0,86 | Faixa 1 |
| BCO VOTORANTIM SA | 1.216,58 | 0,82 | Faixa 2 |
| BCO DAYCOVAL SA | 1.192,72 | 0,81 | Faixa 2 |
| BANCO C6 S.A. | 1.178,18 | 0,80 | Sem Faixa |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 1.088,32 | 0,74 | Faixa 2 |
| VALE SA | 1.071,60 | 0,73 | Faixa 1 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 1.046,84 | 0,71 | 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 |
|--------------------------------------|-----------------|-------------|----------------|-------------|-------|--------|------|---------|
| Nenhuma mudança de faixa encontrada. | | | | | | | | |

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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 | 116.452 | 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 | 1.344.351 | 0,91% | Selic | | 15-mar-21 | 4,00% | 0,04% | ATLANTIDA FI MULT |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 1.011.404 | 0,69% | Selic | | 18-mar-21 | 4,00% | 0,04% | ATLANTIDA FI MULT |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 427.177 | 0,29% | Selic | | 01-mar-21 | 6,00% | 0,05% | ATLANTIDA FI MULT |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 37.692 | 0,03% | Selic | | 19-mar-21 | 4,00% | 0,04% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 47.906 | 0,03% | IPCA | | 22-mar-21 | 1,13% | 1,15% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 18.871.693 | 12,79% | IPCA | | 15-mar-21 | 1,63% | 1,68% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 22.402 | 0,02% | IPCA | | 22-mar-21 | 1,97% | 2,00% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 29.838 | 0,02% | IPCA | | 03-mar-21 | 2,96% | 2,93% | ATLANTIDA FI MULT |

