

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	222.972.013,69	84,33%				0,34%	0,54%	2,52%	0,54%	4,41%	11,11%	18,49%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,02%	2,30%	5,76%	2,30%	7,15%	11,81%	18,08%
Renda Fixa Total Return	216.045.423,05	81,71%			0,44%	0,30%	0,43%	2,36%	0,43%	4,23%	10,83%	18,42%
ATLANTIDA FI MULT	123.247.590,60	46,61%	ITAU	100%	0,66%	0,39%	0,64%	3,14%	0,64%	4,91%	12,88%	21,82%
ITAPEMA FI MULT	92.797.832,44	35,10%	SUL AMERICA	100%	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 Fixa ALM	6.095.514,67	2,31%										
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.095.514,67	2,31%		100%		1,78%	4,05%	8,73%	4,05%	12,86%	25,17%	38,83%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					1,33%	3,12%	7,50%	3,12%	10,72%	19,44%	30,34%
Renda Fixa CDI	831.075,98	0,31%			0,06%	0,17%	0,76%	1,31%	0,76%	1,56%	5,55%	13,06%
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	223.962,56	0,08%	BRADESCO	0,00%	0,06%	0,20%	0,46%	0,91%	0,46%	1,98%	7,47%	14,22%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	607.113,42	0,23%	ITAU	0,00%	0,07%	0,16%	0,42%	0,88%	0,42%	1,93%	7,30%	13,94%
Benchmark:	CDI					0,20%	0,48%	0,96%	0,48%	2,23%	7,80%	14,63%
Renda Variável	11.239.223,73	4,25%				1,72%	-1,94%	14,79%	-1,94%	58,06%	23,19%	41,49%
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	4,25%			10,16%	1,72%	-1,94%	14,79%	-1,94%	58,06%	23,20%	40,52%
AZ QUEST ACOES FC FIA	3.378.851,77	1,28%	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	1,27%	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	1,70%	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	9.928.163,24	3,75%				0,32%	0,48%	3,04%	0,48%	5,90%	10,98%	16,08%
Benchmark:	CDI + 3% a.a.					0,47%	1,20%	2,44%	1,20%	5,27%	14,36%	25,23%
Multimercado Estruturado	9.928.163,24	3,75%			1,01%	0,32%	0,48%	3,04%	0,48%	5,90%	10,98%	15,63%
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	5.566.213,36	2,11%	ABSOLUTE	0,62%	0,81%	0,31%	0,48%	0,84%	0,48%	1,82%	9,54%	19,30%
ITAU GLOBAL DINAMICO PLUS MULT FICFI	4.361.949,87	1,65%	ITAU	0,10%	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	264.413.854,33	100%			0,76%	0,47%	0,29%	3,54%	0,29%	7,38%	11,83%	19,34%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					1,33%	3,12%	7,50%	3,12%	10,72%	19,44%	30,34%

* 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.

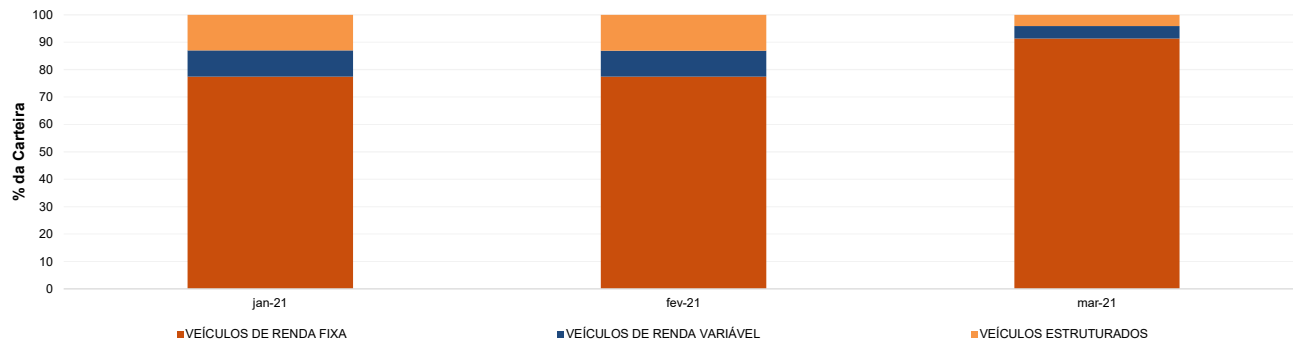
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

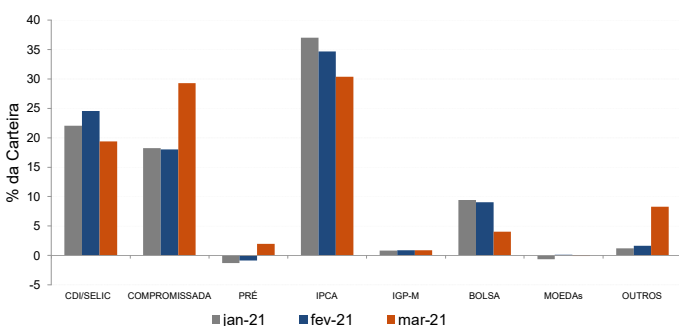
Distribuição da Carteira

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.

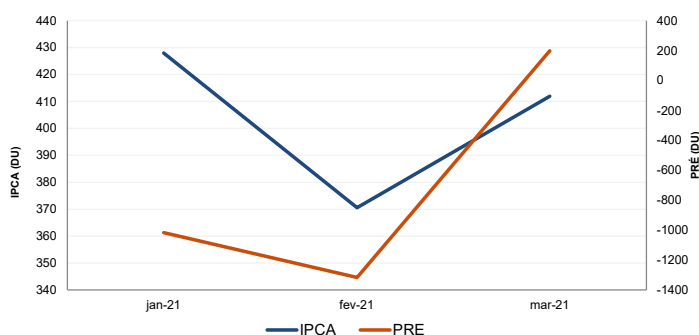
Evolução do Patrimônio Líquido



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	1.092,60	9,21	2.187,62	8,44
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	970,27	8,18	447,08	1,72
ITUB4	Intermediários Financeiros	889,82	7,50	247,11	0,95
BBDC4	Intermediários Financeiros	882,21	7,43	753,17	2,90
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	692,78	5,84	744,80	2,87
LREN3	Comércio	456,32	3,84	471,92	1,82
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	418,29	3,52	89,87	0,35
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	329,08	2,77	303,07	1,17
ENG11	Energia Elétrica	312,68	2,63	288,79	1,11
JBSS3	Alimentos Processados	304,09	2,56	244,40	0,94

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

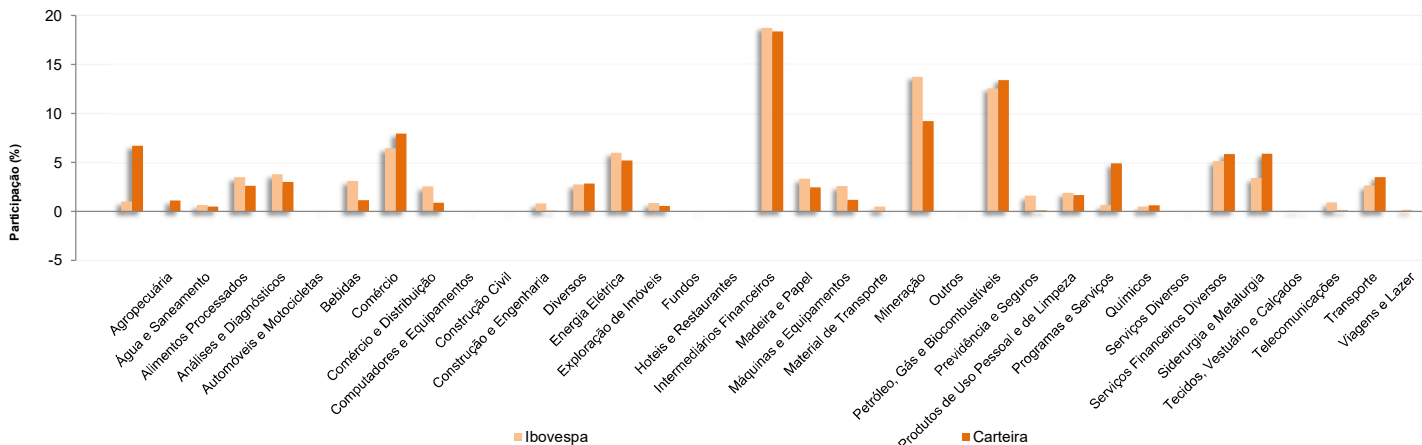
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
VALE3	1.092,60	9,21	0,00	1
PETR4	970,27	8,18	0,00	1
ITUB4	889,82	7,50	0,00	1
BBDC4	882,21	7,43	0,00	1
B3SA3	692,78	5,84	0,00	1
LREN3	456,32	3,84	0,00	1
GGBR4	418,29	3,52	0,00	1
BRDT3	329,08	2,77	0,00	1
ENG11	312,68	2,63	0,00	1
JBSS3	304,09	2,56	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

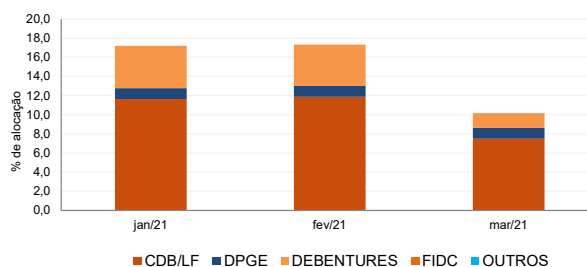
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	6.414,38	2,43	Faixa 2
BCO SAFRA SA	4.854,57	1,84	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	2.954,82	1,12	Faixa 2
BCO VOTORANTIM SA	2.369,19	0,90	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.196,15	0,83	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	2.052,47	0,78	Faixa 2
BANCO C6 S.A.	2.027,46	0,77	Sem Faixa
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.193,95	0,45	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.102,37	0,42	Faixa 2
VALE SA	1.092,60	0,41	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 PLANO CV

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	200.395	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	2.313.412	0,88%	Selic		15-mar-21	4,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.740.464	0,66%	Selic		18-mar-21	4,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	735.103	0,28%	Selic		01-mar-21	6,00%	0,05%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	64.862	0,02%	Selic		19-mar-21	4,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	158	0,00%	Selic		25-mar-21	0,03%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	127	0,00%	Selic		18-mar-21	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	5.656	0,00%	Selic		29-mar-21	0,10%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	4.807	0,00%	Selic		05-mar-21	0,12%	0,12%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2.828	0,00%	Selic		26-mar-21	0,12%	0,10%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	396	0,00%	Selic		04-mar-21	0,12%	0,12%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	198	0,00%	Selic		04-mar-21	0,12%	0,12%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	187	0,00%	Selic		29-mar-21	0,10%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	154	0,00%	Selic		30-mar-21	0,09%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	58	0,00%	Selic		30-mar-21	0,09%	0,09%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.021	0,00%	Selic		09-mar-21	0,14%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.530	0,00%	Selic		09-mar-21	0,14%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	4.223	0,00%	Selic		25-mar-21	0,18%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.408	0,00%	Selic		01-mar-21	0,17%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.081	0,00%	Selic		09-mar-21	0,17%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.975	0,00%	Selic		09-mar-21	0,19%	0,19%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.653	0,00%	Selic		09-mar-21	0,19%	0,19%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	82.439	0,03%	IPCA		22-mar-21	1,13%	1,15%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	32.475.158	12,30%	IPCA		15-mar-21	1,63%	1,68%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	38.551	0,01%	IPCA		22-mar-21	1,97%	2,00%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	51.347	0,02%	IPCA		03-mar-21	2,96%	2,93%	ATLANTIDA FI MULT

