

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

Data-base: 30/11/2021

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	144.000.248,88	100%										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,03%	3,65%	6,38%	10,25%	11,84%	17,82%	22,89%
Multiestatégia	144.000.248,88	100%			1,60%	1,45%	-0,02%	-0,59%	1,14%	2,08%	4,88%	15,17%
ATLANTIDA 2 FI MULT	72.505.357,69	50,35%	ITAU	100%	1,63%	2,14%	0,94%	0,47%	-	-	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	71.494.891,19	49,65%	TAG INVEST	100%	1,77%	0,77%	-0,98%	-1,64%	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 2,55% a.a.					1,15%	4,03%	7,20%	11,78%	13,54%	21,43%	28,61%
Total	143.999.367,95	100%			1,60%	1,41%	-0,07%	-0,65%	0,61%	2,44%	4,73%	17,24%
Benchmark:	IPCA + 2,55% a.a.					1,15%	4,03%	7,20%	11,78%	13,54%	21,43%	28,61%

* 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.

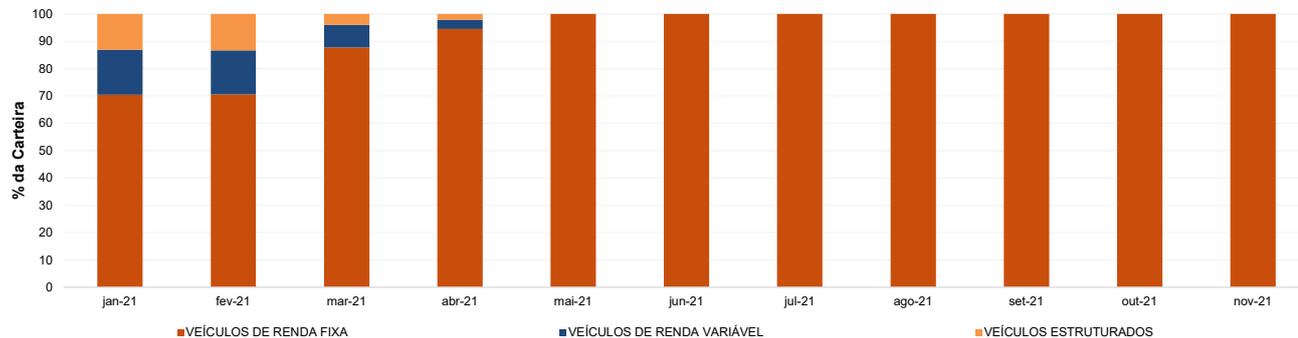
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

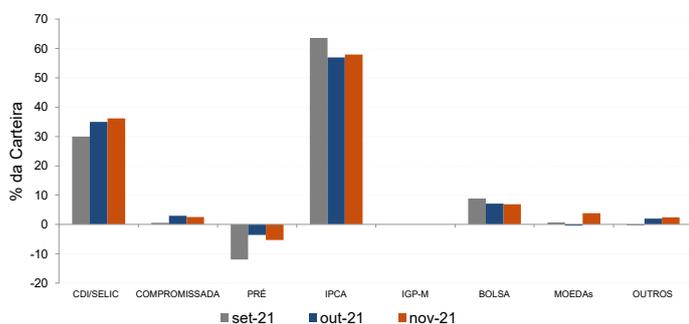
Distribuição da Carteira

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.

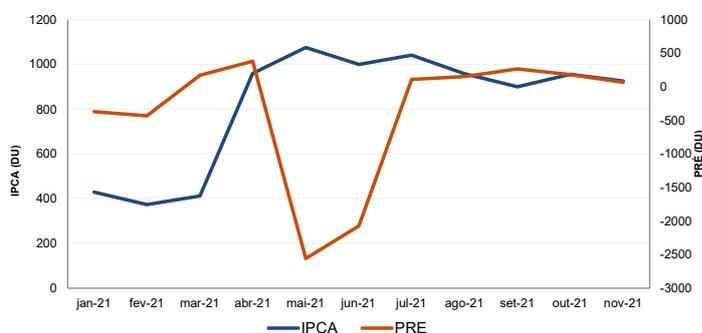
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	606,73	5,41	444,19	3,90
VALE3	Mineração	544,39	4,85	520,64	4,57
ITUB4	Intermediários Financeiros	353,77	3,15	392,31	3,44
BBDC4	Intermediários Financeiros	274,95	2,45	221,86	1,95
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	271,65	2,42	302,00	2,65
ENGI11	Energia Elétrica	249,81	2,23	189,17	1,66
MULT3	Exploração de Imóveis	227,08	2,03	173,29	1,52
SUZB3	Madeira e Papel	200,70	1,79	177,47	1,56
CESP6	Energia Elétrica	174,90	1,56	183,67	1,61
JBSS3	Alimentos Processados	173,31	1,55	245,13	2,15

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

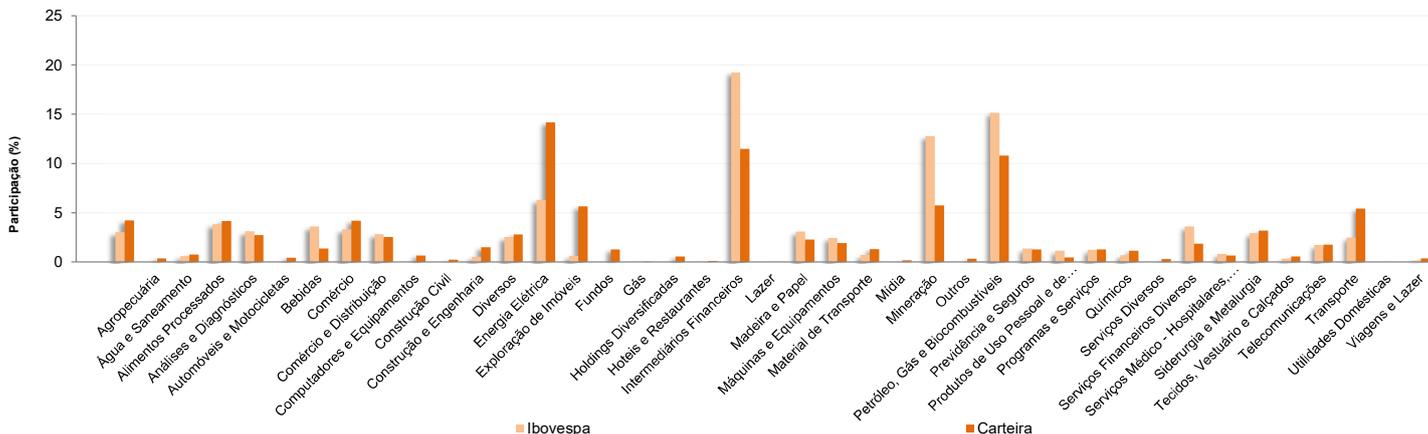
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRPG6	10,57	0,09	0,00	4
BAUH4	19,30	0,17	0,02	3
PETR4	606,73	5,41	0,00	1
VALE3	544,39	4,85	0,00	1
ITUB4	353,77	3,15	0,00	1
BBDC4	274,95	2,45	0,00	1
PETR3	271,65	2,42	0,00	1
ENGI11	249,81	2,23	0,00	1
MULT3	227,08	2,03	0,00	1
SUZB3	200,70	1,79	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

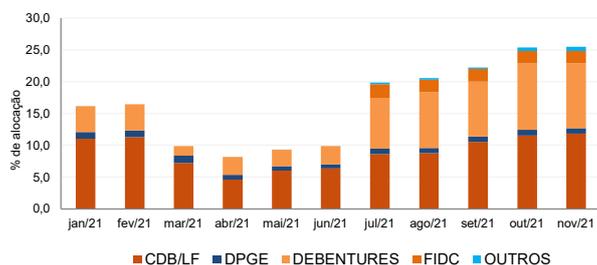
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	4.117,36	2,86	Faixa 1
BCO SAFRA SA	3.878,74	2,70	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	3.119,16	2,17	Faixa 1
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.252,37	1,57	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	1.628,28	1,13	Faixa 2
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.053,20	0,73	Faixa 4
CIA LOCAÇÃO AMERICAS	1.009,02	0,70	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	887,39	0,62	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	878,58	0,61	Faixa 2
APICE SECURITIZADORA IMOBILIARIA SA	737,54	0,51	Sem Faixa

* 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
CRA APCS 16 1	41,20	APICE SECURITIZADORA IMOBILIARIA SA	Sem Faixa	Faixa 3	15-out-26	IPCA	7,45%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
SULA19	5,15	SUL AMERICA SA	Sem Faixa	Faixa 3	08-nov-26	CDI	1,50%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
SULA29	5,28	SUL AMERICA SA	Sem Faixa	Faixa 3	08-nov-28	CDI	1,70%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

Data-base: 30/11/2021

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
CDB PRE	24-nov-23	102.868	0,07%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	25-nov-21	13,23%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	25-nov-24	100.101	0,07%	CDI	BANCO CSF SA	25-nov-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	01-nov-26	302.179	0,21%	CDI	BCO BRADESCO SA	01-nov-21	2,25%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2022-09-01	01-set-22	234.037	0,16%	Selic		30-nov-21	0,03%	0,04%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	100.285	0,07%	Selic		11-nov-21	0,02%	0,02%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	55.714	0,04%	Selic		01-nov-21	0,02%	0,02%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	802.765	0,56%	IPCA		16-nov-21	4,21%	4,19%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	426.349	0,30%	IPCA		17-nov-21	4,17%	4,27%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	368.734	0,26%	IPCA		17-nov-21	4,16%	4,27%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	299.597	0,21%	IPCA		08-nov-21	5,14%	4,90%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	295.756	0,21%	IPCA		08-nov-21	5,11%	4,90%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	295.756	0,21%	IPCA		10-nov-21	5,07%	4,64%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	211.254	0,15%	IPCA		17-nov-21	4,19%	4,27%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	161.321	0,11%	IPCA		16-nov-21	4,24%	4,19%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	149.798	0,10%	IPCA		10-nov-21	5,10%	4,64%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	80.661	0,06%	IPCA		24-nov-21	4,91%	4,59%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	80.661	0,06%	IPCA		16-nov-21	4,23%	4,19%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	136.753	0,10%	IPCA		17-nov-21	5,13%	5,21%	ATLANTIDA 2 FI MULT