

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	253.334.140,34	100%				1,42%	0,67%	0,65%	2,30%	3,26%	6,30%	16,66%
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,03%	3,65%	6,38%	10,25%	11,84%	17,82%	22,89%
Multiestratégia - Perfil Moderado	144.000.248,88	56,84%			1,60%	1,45%	-0,02%	-0,59%	1,14%	2,08%	4,88%	15,17%
ATLANTIDA 2 FI MULT	72.505.357,69	28,62%	ITAU	100%	1,63%	2,14%	0,94%	0,47%	-	-	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	71.494.891,19	28,22%	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%
Multiestratégia - Perfil Conservador	101.420.019,02	40,03%			1,18%	1,36%	1,38%	1,89%	3,13%	4,09%	7,16%	17,71%
ATLANTIDA FI MULT	51.698.941,69	20,41%	ITAU	100%	0,98%	1,33%	1,82%	2,86%	4,50%	5,62%	9,85%	21,10%
ITAPEMA FI MULT	49.721.077,32	19,63%	TAG INVEST	100%	1,51%	1,39%	0,93%	0,90%	1,78%	2,56%	4,05%	13,83%
Benchmark:	IPCA + 1,2% a.a.					1,05%	3,70%	6,49%	10,45%	12,06%	18,28%	23,62%
Renda Fixa ALM	6.939.132,39	2,74%			0,02%							
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.939.132,39	2,74%		100%	0,02%	1,77%	5,08%	9,27%	16,08%	18,10%	31,25%	44,04%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					1,29%	4,48%	8,15%	13,59%	15,56%	25,79%	35,61%
Renda Fixa CDI	974.740,06	0,38%			0,03%	0,59%	1,59%	2,77%	3,99%	4,23%	4,92%	11,38%
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	974.740,06	0,38%	BRADESCO	0,02%	0,03%	0,59%	1,59%	2,77%	3,69%	3,91%	6,69%	13,14%
Benchmark:	CDI					0,59%	1,51%	2,62%	3,60%	3,77%	6,87%	13,38%
Total	253.329.153,88	100%			1,37%	1,42%	0,67%	0,65%	2,23%	3,73%	6,46%	17,80%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.					1,29%	4,48%	8,15%	13,59%	15,56%	25,79%	35,61%

* 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.

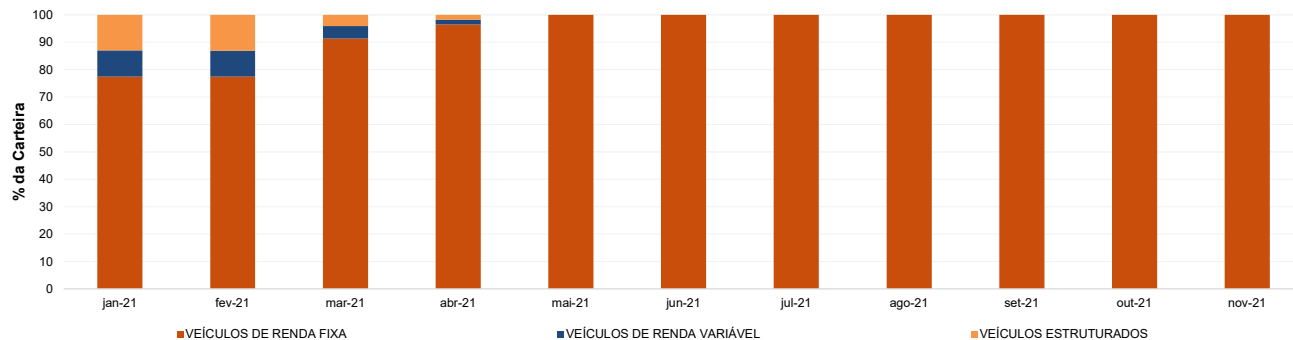
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

Distribuição da Carteira

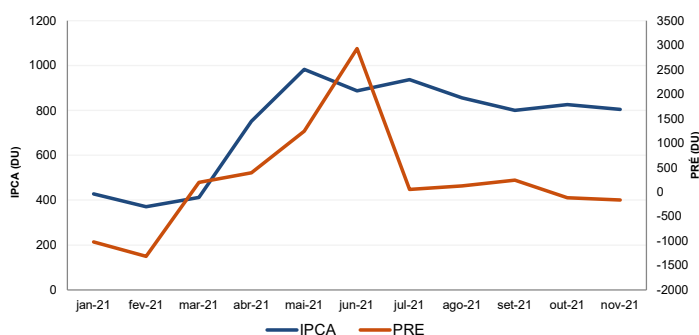
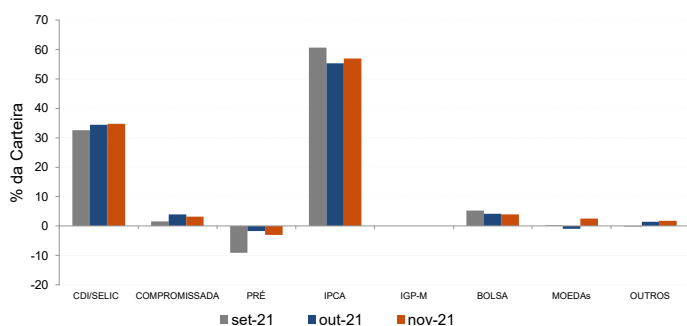
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais 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	733,68	5,99	504,84	4,04
VALE3	Mineração	523,66	4,28	479,48	3,84
ITUB4	Intermediários Financeiros	415,70	3,39	452,72	3,62
BBDC4	Intermediários Financeiros	295,24	2,41	231,81	1,86
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	283,58	2,32	323,75	2,59
ENGI11	Energia Elétrica	282,82	2,31	193,08	1,55
MULT3	Exploração de Imóveis	260,84	2,13	161,10	1,29
SUZB3	Madeira e Papel	245,11	2,00	230,27	1,84
JBSS3	Alimentos Processados	207,01	1,69	318,28	2,55
LREN3	Comércio	190,80	1,56	235,52	1,88

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

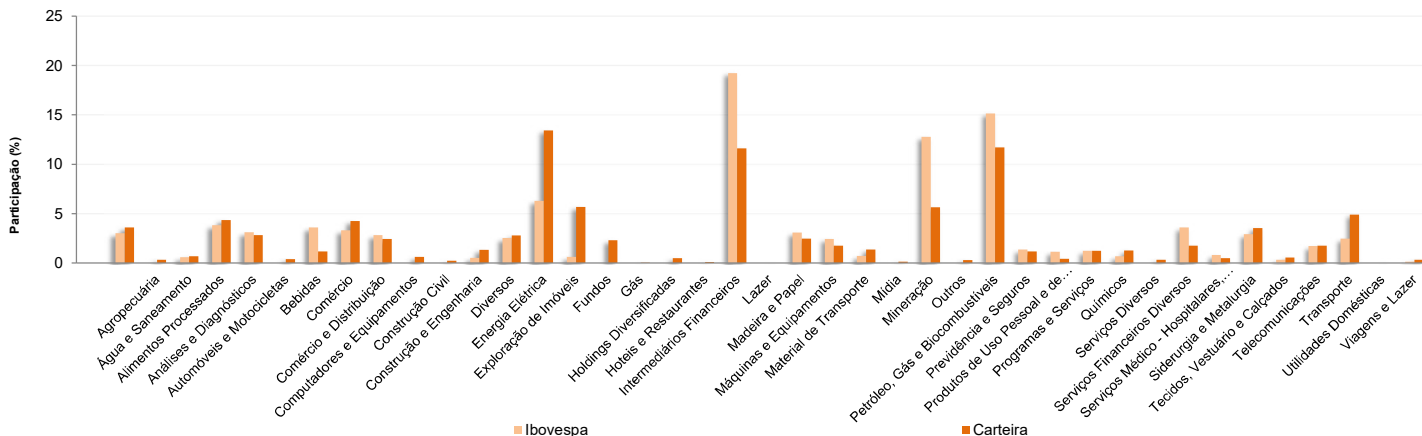
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
IRDM12	0,00	0,00	0,00	Sem Liquidez
CRPG6	10,57	0,09	0,00	4
BAUH4	19,30	0,16	0,02	3
PETR4	733,68	5,99	0,00	1
VALE3	523,66	4,28	0,00	1
ITUB4	415,70	3,39	0,00	1
BBDC4	295,24	2,41	0,00	1
PETR3	283,58	2,32	0,00	1
ENGI11	282,82	2,31	0,00	1
MULT3	260,84	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.



Análises de Contrapartes

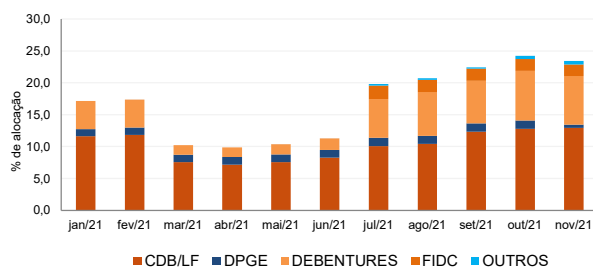
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	10.078,05	3,99	Faixa 1
BCO SAFRA SA	8.037,91	3,18	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	4.061,55	1,61	Faixa 1
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.252,37	0,89	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	1.728,71	0,68	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.640,96	0,65	Faixa 2
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.283,63	0,51	Faixa 1
APICE SECURITIZADORA IMOBILIARIA SA	1.127,17	0,45	Sem Faixa
CIA LOCAÇÃO AMERICAS	1.063,35	0,42	Faixa 2
OMNI SA CRED FINANÇ INVEST	1.053,20	0,42	Faixa 4

* 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
CRA APCS 16 1	21,65	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
SULA19	3,45	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
SULA29	3,54	SUL AMERICA SA	Sem Faixa	Faixa 3	08-nov-28	CDI	1,70%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	0,04%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	25-nov-21	13,23%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
CDB PRE	24-nov-23	51.434	0,02%	PRE	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	25-nov-21	13,23%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	25-nov-24	100.101	0,04%	CDI	BANCO CSF SA	25-nov-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	25-nov-24	100.101	0,04%	CDI	BANCO CSF SA	25-nov-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	01-nov-26	302.179	0,12%	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 2022-03-01	01-mar-22	4.582	0,00%	Selic		22-nov-21	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	234.037	0,09%	Selic		30-nov-21	0,03%	0,04%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2022-09-01	01-set-22	89.157	0,04%	Selic		30-nov-21	0,03%	0,04%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	311.998	0,12%	Selic		01-nov-21	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	100.285	0,04%	Selic		11-nov-21	0,02%	0,02%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	55.714	0,02%	Selic		01-nov-21	0,02%	0,02%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	7.229	0,00%	Selic		09-nov-21	0,22%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	802.765	0,32%	IPCA		16-nov-21	4,21%	4,19%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	441.713	0,17%	IPCA		16-nov-21	4,21%	4,19%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	426.349	0,17%	IPCA		17-nov-21	4,17%	4,27%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	368.734	0,15%	IPCA		17-nov-21	4,16%	4,27%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	299.597	0,12%	IPCA		08-nov-21	5,14%	4,90%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	295.756	0,12%	IPCA		08-nov-21	5,11%	4,90%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	295.756	0,12%	IPCA		10-nov-21	5,07%	4,64%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	234.300	0,09%	IPCA		17-nov-21	4,17%	4,27%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	211.254	0,08%	IPCA		17-nov-21	4,19%	4,27%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	203.572	0,08%	IPCA		17-nov-21	4,16%	4,27%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	165.162	0,07%	IPCA		08-nov-21	5,14%	4,90%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	165.162	0,07%	IPCA		08-nov-21	5,11%	4,90%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	161.321	0,06%	IPCA		16-nov-21	4,24%	4,19%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	149.798	0,06%	IPCA		10-nov-21	5,07%	4,64%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	149.798	0,06%	IPCA		10-nov-21	5,10%	4,64%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	119.070	0,05%	IPCA		17-nov-21	4,19%	4,27%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	88.343	0,03%	IPCA		16-nov-21	4,24%	4,19%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	80.661	0,03%	IPCA		24-nov-21	4,91%	4,59%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	80.661	0,03%	IPCA		16-nov-21	4,23%	4,19%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	76.820	0,03%	IPCA		10-nov-21	5,10%	4,64%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	46.092	0,02%	IPCA		16-nov-21	4,23%	4,19%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	596.395	0,24%	IPCA		17-nov-21	5,13%	5,21%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	197.532	0,08%	IPCA		01-nov-21	5,64%	5,55%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	136.753	0,05%	IPCA		17-nov-21	5,13%	5,21%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	2.017.101	0,80%	IPCA		12-nov-21	5,33%	5,23%	ATLANTIDA FI MULT