

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 29/10/2021

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	100.334.067,23	100%										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,33%	3,57%	6,26%	9,13%	11,77%	17,30%	21,48%
Multiestatégia	100.334.067,23	100%			1,09%	-0,75%	0,19%	1,05%	1,75%	3,55%	5,47%	16,83%
ATLANTIDA FI MULT	51.154.531,78	50,99%	ITAU	100%	1,05%	-0,53%	0,81%	2,09%	3,13%	5,20%	8,42%	20,23%
ITAPEMA FI MULT	49.179.535,45	49,02%	TAG INVEST	100%	1,22%	-0,97%	-0,45%	0,05%	0,39%	1,89%	2,08%	12,94%
Benchmark:	IPCA + 1.2% a.a.					1,35%	3,62%	6,37%	9,31%	11,99%	17,76%	22,20%
Total	100.331.354,42	100%			1,09%	-0,75%	0,17%	1,05%	1,71%	3,62%	5,22%	16,23%
Benchmark:	IPCA + 1.2% a.a.					1,35%	3,62%	6,37%	9,31%	11,99%	17,76%	22,20%

* 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.

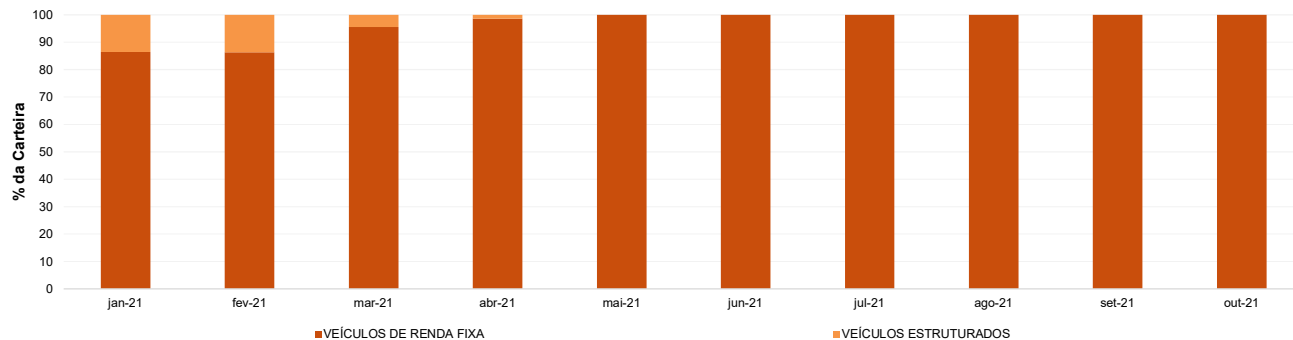
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

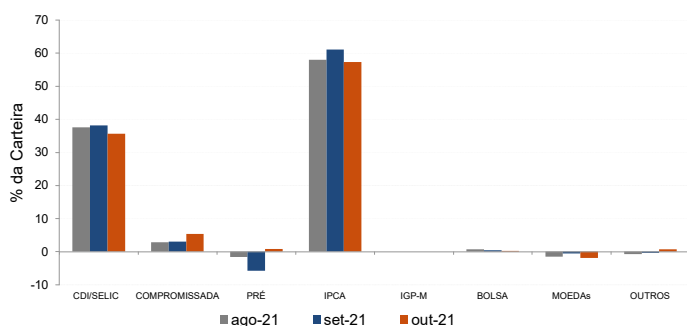
Distribuição da Carteira

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.

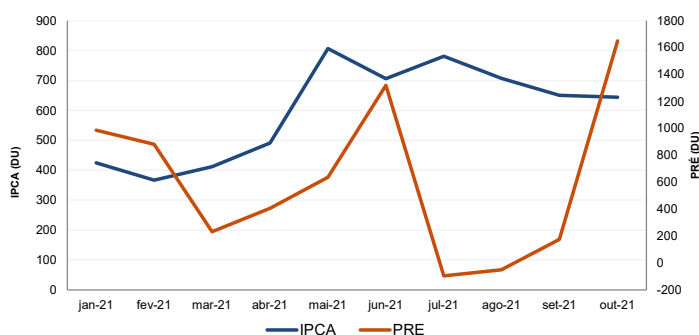
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
BOVA11	Fundos	74,77	6,84	79,93	6,55
JBSS3	Alimentos Processados	73,16	6,69	49,68	4,07
BRAP4	Mineração	63,86	5,84	3,70	0,30
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	60,65	5,55	91,20	7,48
ITUB4	Intermediários Financeiros	60,41	5,53	39,88	3,27
LREN3	Comércio	59,24	5,42	54,16	4,44
SUZB3	Madeira e Papel	52,79	4,83	61,82	5,07
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	47,46	4,34	38,13	3,13
USIM5	Siderurgia e Metalurgia	46,69	4,27	37,70	3,09
ASAI3	Comércio e Distribuição	45,42	4,16	82,66	6,78

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

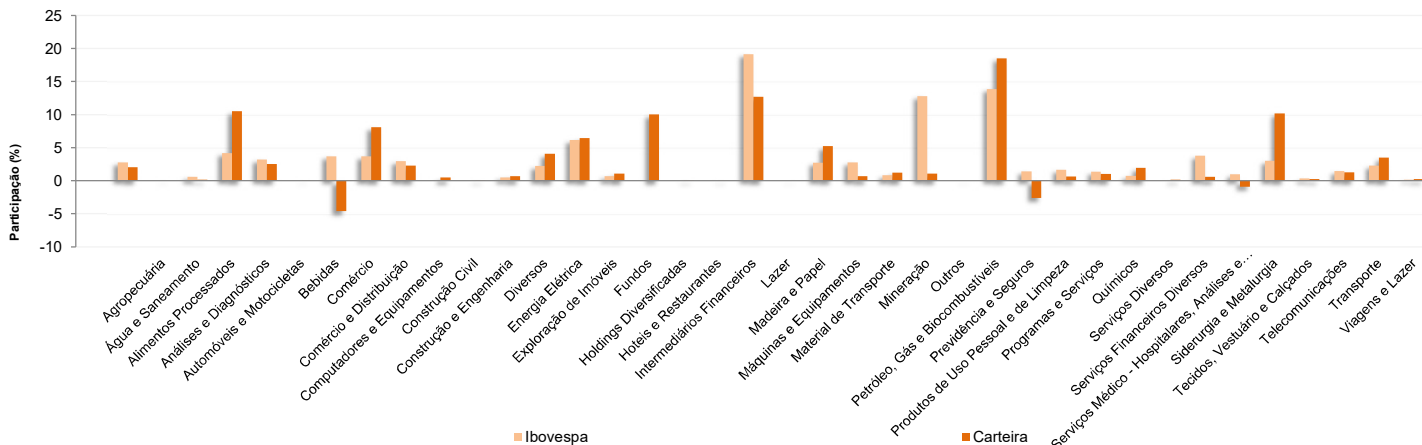
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
JBSS3	73,16	6,69	0,00	1
BRAP4	63,86	5,84	0,00	1
PETR4	60,65	5,55	0,00	1
ITUB4	60,41	5,53	0,00	1
LREN3	59,24	5,42	0,00	1
SUZB3	52,79	4,83	0,00	1
GGBR4	47,46	4,34	0,00	1
USIM5	46,69	4,27	0,00	1
ASAI3	45,42	4,16	0,00	1
EQTL3	37,13	3,40	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

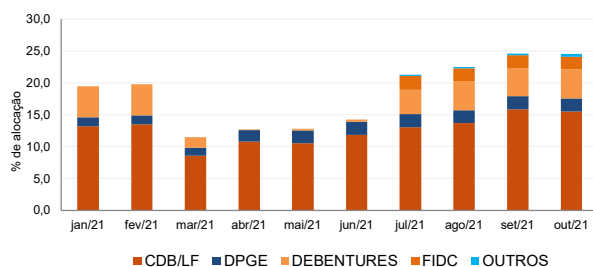
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	5.868,85	5,89	Faixa 1
BCO SAFRA SA	4.158,67	4,18	Faixa 1
BANCO C6 S.A.	2.096,37	2,11	Sem Faixa
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.172,70	1,18	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	935,44	0,94	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	752,94	0,76	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	551,13	0,55	Faixa 2
PORTOSEG S/A CREDITO, FINANCIAMENTO E INV	407,83	0,41	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	407,79	0,41	Faixa 1
TRUE SECURITIZADORA S.A.	355,05	0,36	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
CART13	0,61	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-dez-35	IPCA	6,81%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
TCII11	154,77	AES TUCANO HOLDING II S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-41	IPCA	6,24%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 29/10/2021

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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2022-03-01	01-mar-22	243.803	0,24%	Selic	25-out-21	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-09-01	01-set-22	753.515	0,76%	Selic	22-out-21	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2022-09-01	01-set-22	55.406	0,06%	Selic	28-out-21	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	753.421	0,76%	Selic	21-out-21	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.748.371	1,76%	Selic	13-out-21	0,10%	0,10%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	2.025.057	2,03%	IPCA	13-out-21	3,64%	3,66%	ATLANTIDA FI MULT

