

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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 | 143.031.776,63 | 100% | | | | | | | | | | |
| Benchmark: | IPCA + 1% a.a. | | | | | 1,33% | 3,57% | 6,26% | 9,13% | 11,77% | 17,30% | 21,48% |
| Multiestatégia | 143.031.776,63 | 100% | | | 1,41% | -1,38% | -1,72% | -0,98% | -0,30% | 1,46% | 3,10% | 14,20% |
| ATLANTIDA 2 FI MULT | 71.529.176,03 | 50,01% | ITAU | 100% | 1,45% | -1,27% | -1,41% | -0,68% | - | - | - | - |
| ITAPEMA 2 FI MULT | 71.502.600,60 | 49,99% | TAG INVEST | 100% | 1,46% | -1,49% | -2,02% | -1,35% | - | - | - | - |
| Benchmark: | IPCA + 2.55% a.a. | | | | | 1,45% | 3,97% | 7,08% | 10,51% | 13,47% | 20,90% | 27,13% |
| Total | 143.030.892,62 | 100% | | | 1,41% | -1,38% | -1,72% | -1,00% | -0,78% | 3,05% | 3,15% | 16,47% |
| Benchmark: | IPCA + 2.55% a.a. | | | | | 1,45% | 3,97% | 7,08% | 10,51% | 13,47% | 20,90% | 27,13% |

* 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.

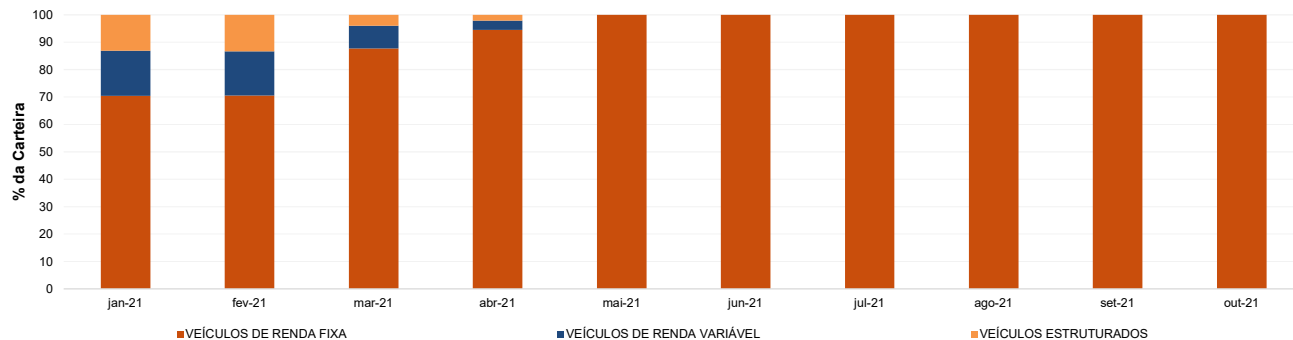
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

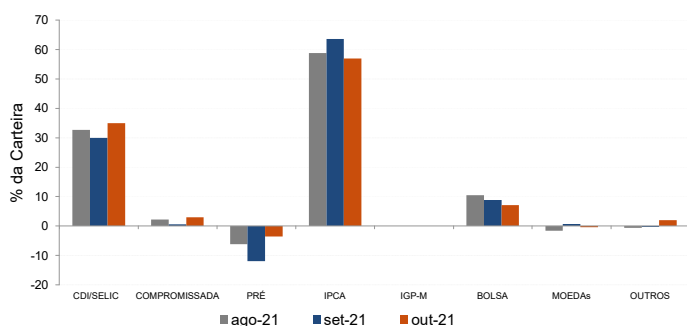
Distribuição da Carteira

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.

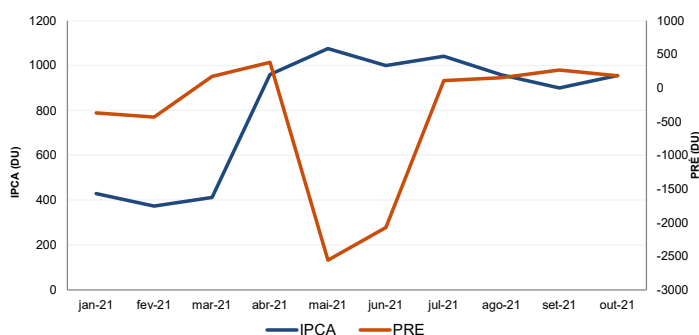
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | 520,64 | 4,57 | 540,89 | 4,86 |
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 444,19 | 3,90 | 448,04 | 4,03 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 392,31 | 3,44 | 330,12 | 2,97 |
| PETR3 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 302,00 | 2,65 | 261,70 | 2,35 |
| JBSS3 | Alimentos Processados | 245,13 | 2,15 | 170,84 | 1,54 |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 221,86 | 1,95 | 382,42 | 3,44 |
| B3SA3 | Serviços Financeiros Diversos | 189,50 | 1,66 | 170,75 | 1,53 |
| ENGI11 | Energia Elétrica | 189,17 | 1,66 | 39,15 | 0,35 |
| BPAC11 | Intermediários Financeiros | 188,12 | 1,65 | 246,15 | 2,21 |
| CESP6 | Energia Elétrica | 183,67 | 1,61 | 51,78 | 0,47 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

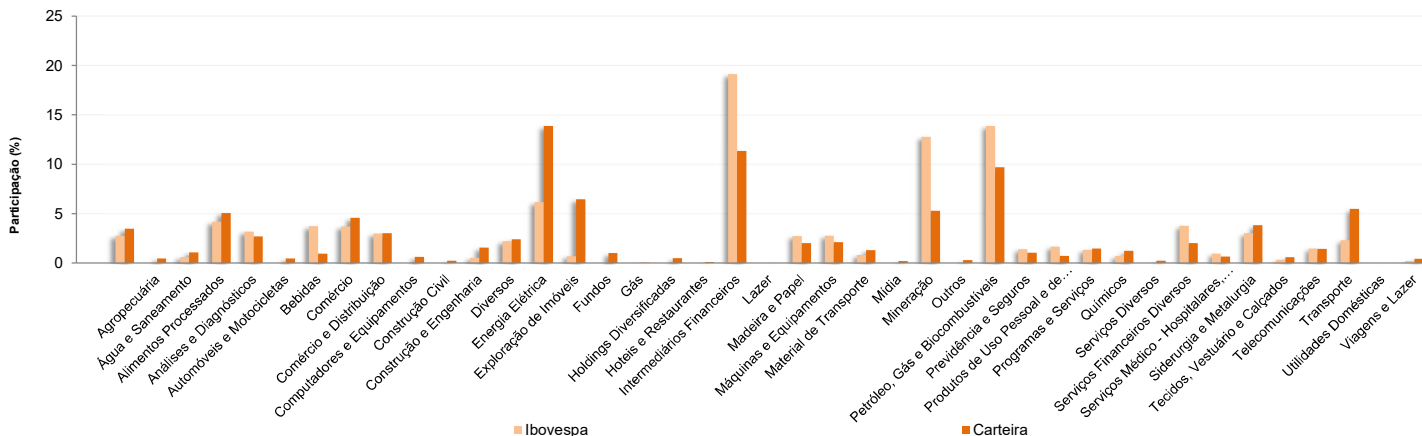
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|--------|--------|------|--------------|--------------------|
| BAUH4 | 20,47 | 0,18 | 0,02 | 4 |
| CRPG6 | 18,16 | 0,16 | 0,00 | 2 |
| VALE3 | 520,64 | 4,57 | 0,00 | 1 |
| PETR4 | 444,19 | 3,90 | 0,00 | 1 |
| ITUB4 | 392,31 | 3,44 | 0,00 | 1 |
| PETR3 | 302,00 | 2,65 | 0,00 | 1 |
| JBSS3 | 245,13 | 2,15 | 0,00 | 1 |
| BBDC4 | 221,86 | 1,95 | 0,00 | 1 |
| B3SA3 | 189,50 | 1,66 | 0,00 | 1 |
| ENGI11 | 189,17 | 1,66 | 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

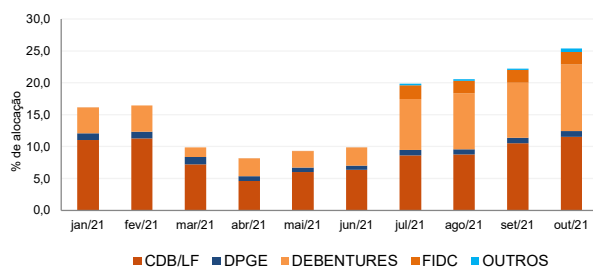
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|----------------------------------|----------|------|---------------------------|
| BCO ITAU SA | 4.061,87 | 2,85 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 3.852,56 | 2,70 | Faixa 1 |
| BCO BRADESCO SA | 2.723,81 | 1,91 | Faixa 1 |
| ESTACIO PARTICIPACOES SA | 2.237,90 | 1,57 | Faixa 1 |
| BCO DAYCOVAL SA | 1.636,80 | 1,15 | Faixa 2 |
| OMNI SA CRED FINANC INVEST | 1.045,64 | 0,73 | Faixa 4 |
| COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS | 983,67 | 0,69 | Faixa 2 |
| BANCO VOTORANTIM S.A. | 893,02 | 0,63 | Faixa 2 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 782,17 | 0,55 | Faixa 1 |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 746,38 | 0,52 | Faixa 2 |

* 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 | 0,93 | CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-dez-35 | IPCA | 6,81% | LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT |
| DIRR18 | 19,65 | DIRECIONAL ENGENHARIA SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 15-out-26 | CDI | 1,74% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| MGLUA0 | 75,03 | MAGAZINE LUIZA SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 15-out-26 | CDI | 1,30% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| TCII11 | 294,49 | 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 MODERADO

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 Privados | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | Emissor | Data Compra | Tx de Compra | Faixa Atual | Veículo |
|------------------|------------|---------|-----------------|-----------|--------------|-------------|--------------|-------------|---------------------|
| LF CDI | 04-nov-24 | 500.594 | 0,35% | CDI | BCO SAFRA SA | 25-out-21 | 1,17% | Faixa 1 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 03-fev-25 | 500.597 | 0,35% | CDI | BCO SAFRA SA | 25-out-21 | 1,20% | Faixa 1 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 05-mai-25 | 500.599 | 0,35% | CDI | BCO SAFRA SA | 25-out-21 | 1,23% | 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 | 1.174.686 | 0,82% | Selic | | 22-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 1.385.138 | 0,97% | Selic | | 21-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 55.406 | 0,04% | Selic | | 19-out-21 | 0,01% | 0,01% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 443.189 | 0,31% | Selic | | 27-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 144.036 | 0,10% | Selic | | 28-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 88.638 | 0,06% | Selic | | 25-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 1.803.699 | 1,27% | Selic | | 13-out-21 | 0,10% | 0,10% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2028-08-15 | 15-ago-28 | 15.445 | 0,01% | IPCA | | 29-out-21 | 5,50% | 5,46% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2030-08-15 | 15-ago-30 | 46.646 | 0,03% | IPCA | | 18-out-21 | 5,01% | 5,04% | ATLANTIDA 2 FI MULT |

