

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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 | ALOCÇÃO (R\$) | | GESTOR | % PL FUNDO | RISCO DE MERCADO | RENTABILIDADE* | | | | | | |
|---|-----------------------|---------------|------------|------------|------------------|----------------|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|---------------|
| | | | | | | 1M | 3M | 6M | ANO | 12M | 24M | 36M |
| Renda Fixa | 251.222.799,78 | 100% | | | | -1,04% | -0,78% | 0,06% | 0,87% | 2,67% | 4,59% | 15,71% |
| Benchmark: | IPCA + 1% a.a. | | | | | 1,33% | 3,57% | 6,26% | 9,13% | 11,77% | 17,30% | 21,48% |
| Multiestratégia - Perfil Moderado | 143.031.776,63 | 56,94% | | | 1,41% | -1,38% | -1,72% | -0,98% | -0,30% | 1,46% | 3,10% | 14,20% |
| ATLANTIDA 2 FI MULT | 71.529.176,03 | 28,47% | ITAU | 100% | 1,45% | -1,27% | -1,41% | -0,68% | - | - | - | - |
| ITAPEMA 2 FI MULT | 71.502.600,60 | 28,46% | 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% |
| Multiestratégia - Perfil Conservador | 100.334.067,23 | 39,94% | | | 1,09% | -0,75% | 0,19% | 1,05% | 1,75% | 3,55% | 5,47% | 16,83% |
| ATLANTIDA FI MULT | 51.154.531,78 | 20,36% | 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 | 19,58% | 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% |
| Renda Fixa ALM | 6.884.076,55 | 2,74% | | | 0,02% | | | | | | | |
| RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF | 6.884.076,55 | 2,74% | | 100% | 0,02% | 1,52% | 4,69% | 8,50% | 14,06% | 17,59% | 29,96% | 42,43% |
| Benchmark: | IPCA + 4.39% a.a. | | | | | 1,60% | 4,43% | 8,04% | 12,14% | 15,49% | 25,24% | 34,06% |
| Renda Fixa CDI | 972.879,37 | 0,39% | | | 0,03% | 0,53% | 1,45% | 2,45% | 3,38% | 3,77% | 4,56% | 11,34% |
| BRAM FI RF REF DI FEDERAL II | 972.879,37 | 0,39% | BRADESCO | 0,02% | 0,03% | 0,53% | 1,45% | 2,47% | 3,08% | 3,44% | 6,47% | 13,03% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,48% | 1,35% | 2,29% | 3,00% | 3,32% | 6,65% | 13,28% |
| Total | 251.217.744,29 | 100% | | | 1,22% | -1,04% | -0,78% | 0,20% | 0,80% | 3,96% | 4,82% | 16,86% |
| Benchmark: | IPCA + 4.39% a.a. | | | | | 1,60% | 4,43% | 8,04% | 12,14% | 15,49% | 25,24% | 34,06% |

* 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.

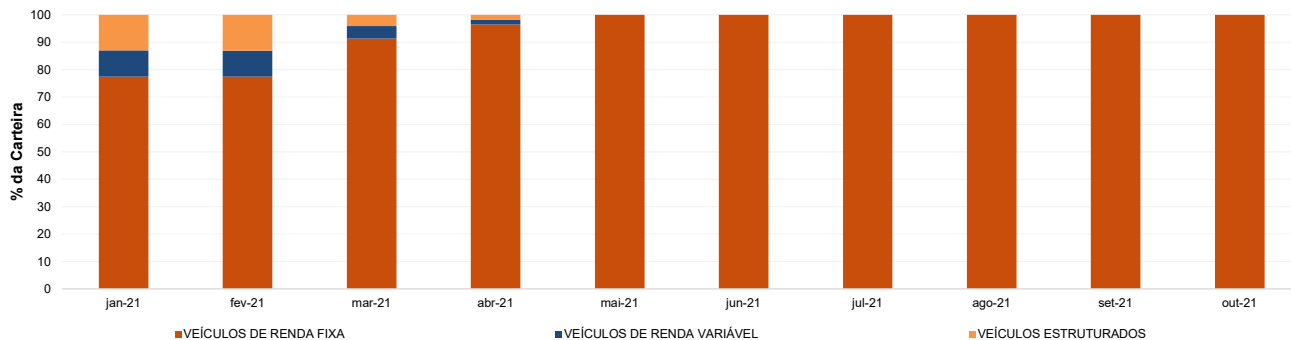
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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

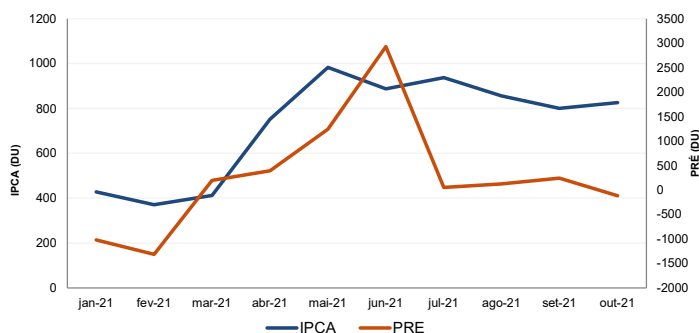
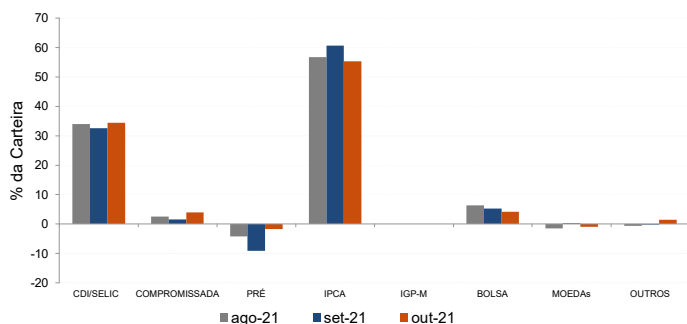
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais 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 | 504,84 | 4,04 | 539,24 | 4,37 |
| VALE3 | Mineração | 479,48 | 3,84 | 556,78 | 4,51 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 452,72 | 3,62 | 370,00 | 3,00 |
| PETR3 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 323,75 | 2,59 | 290,68 | 2,35 |
| JBSS3 | Alimentos Processados | 318,28 | 2,55 | 220,52 | 1,79 |
| LREN3 | Comércio | 235,52 | 1,88 | 228,88 | 1,85 |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 231,81 | 1,86 | 384,10 | 3,11 |
| SUZB3 | Madeira e Papel | 230,27 | 1,84 | 212,11 | 1,72 |
| BPAC11 | Intermediários Financeiros | 220,45 | 1,76 | 284,85 | 2,31 |
| RAIL3 | Transporte | 208,99 | 1,67 | 33,91 | 0,27 |

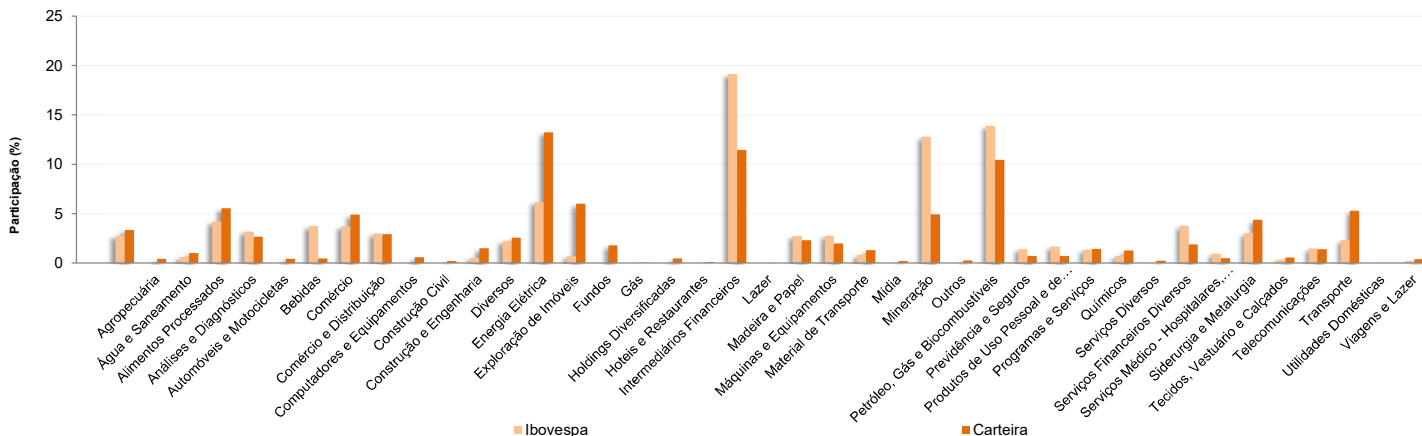
Liquidez da Carteira de Ações

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 | 0,16 | 0,02 | 4 |
| CRPG6 | 18,16 | 0,15 | 0,00 | 2 |
| PETRA | 504,84 | 4,04 | 0,00 | 1 |
| VALE3 | 479,48 | 3,84 | 0,00 | 1 |
| ITUB4 | 452,72 | 3,62 | 0,00 | 1 |
| PETR3 | 323,75 | 2,59 | 0,00 | 1 |
| JBSS3 | 318,28 | 2,55 | 0,00 | 1 |
| LREN3 | 235,52 | 1,88 | 0,00 | 1 |
| BBDC4 | 231,81 | 1,86 | 0,00 | 1 |
| SUZB3 | 230,27 | 1,84 | 0,00 | 1 |

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

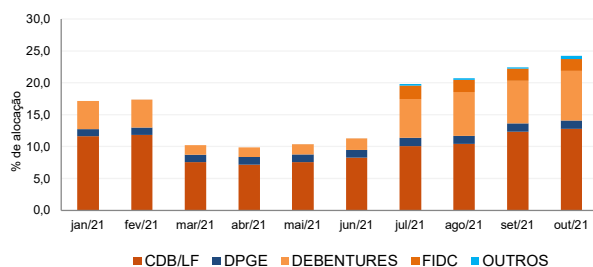
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|----------------------------|----------|------|---------------------------|
| BCO ITAU SA | 9.930,71 | 3,97 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 8.011,23 | 3,21 | Faixa 1 |
| BCO BRADESCO SA | 3.659,25 | 1,46 | Faixa 1 |
| ESTACIO PARTICIPACOES SA | 2.237,90 | 0,90 | Faixa 1 |
| BANCO C6 S.A. | 2.187,69 | 0,88 | Sem Faixa |
| BCO DAYCOVAL SA | 1.737,21 | 0,70 | Faixa 2 |
| BANCO VOTORANTIM S.A. | 1.645,96 | 0,66 | Faixa 2 |
| BCO TOYOTA BRASIL SA | 1.275,25 | 0,51 | Faixa 1 |
| OMNI SA CRED FINANC INVEST | 1.045,64 | 0,42 | Faixa 4 |
| COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS | 1.030,36 | 0,41 | 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 | 0,61 | CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-dez-35 | IPCA | 6,81% | LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT |
| 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 |
| 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 PLANO CV

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 | 0,20% | CDI | BCO SAFRA SA | 25-out-21 | 1,17% | Faixa 1 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 03-fev-25 | 500.597 | 0,20% | CDI | BCO SAFRA SA | 25-out-21 | 1,20% | Faixa 1 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 05-mai-25 | 500.599 | 0,20% | 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 | 0,47% | Selic | | 22-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2022-03-01 | 01-mar-22 | 243.803 | 0,10% | Selic | | 25-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA FI MULT |
| LFT 2022-03-01 | 01-mar-22 | 19.477 | 0,01% | Selic | | 05-out-21 | 0,03% | 0,03% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-03-01 | 01-mar-22 | 19.477 | 0,01% | Selic | | 25-out-21 | 0,02% | 0,02% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 1.385.138 | 0,55% | Selic | | 21-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 753.515 | 0,30% | Selic | | 22-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA FI MULT |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 55.406 | 0,02% | Selic | | 28-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA FI MULT |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 55.406 | 0,02% | Selic | | 19-out-21 | 0,01% | 0,01% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 753.421 | 0,30% | Selic | | 21-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 443.189 | 0,18% | Selic | | 27-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 144.036 | 0,06% | Selic | | 28-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 88.638 | 0,04% | Selic | | 25-out-21 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 15.578 | 0,01% | Selic | | 05-out-21 | 4,00% | 0,04% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 1.803.699 | 0,72% | Selic | | 13-out-21 | 0,10% | 0,10% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 1.748.371 | 0,70% | Selic | | 13-out-21 | 0,10% | 0,10% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 2.025.057 | 0,81% | IPCA | | 13-out-21 | 3,64% | 3,66% | ATLANTIDA 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 | 0,02% | IPCA | | 18-out-21 | 5,01% | 5,04% | ATLANTIDA 2 FI MULT |

