

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/09/2021

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	101.537.422,15	100%									
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.				1,24%	3,28%	5,28%	7,70%	11,34%	15,98%	20,53%
Multiestatégia	101.537.422,15	100%		0,66%	0,77%	1,22%	2,07%	2,51%	4,50%	7,42%	19,37%
ATLANTIDA FI MULT	51.651.989,02	50,87%	ITAU	100%	0,57%	1,02%	1,90%	3,02%	3,68%	6,26%	10,17%
ITAPEMA FI MULT	49.885.433,13	49,13%	TAG INVEST	100%	0,83%	0,52%	0,51%	1,19%	1,36%	2,71%	4,20%
Benchmark:	IPCA + 1.2% a.a.				1,26%	3,34%	5,38%	7,85%	11,56%	16,44%	21,24%
Total	101.534.705,34	100%		0,66%	0,77%	1,20%	2,08%	2,47%	4,51%	7,18%	18,78%
Benchmark:	IPCA + 1.2% a.a.				1,26%	3,34%	5,38%	7,85%	11,56%	16,44%	21,24%

* 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.

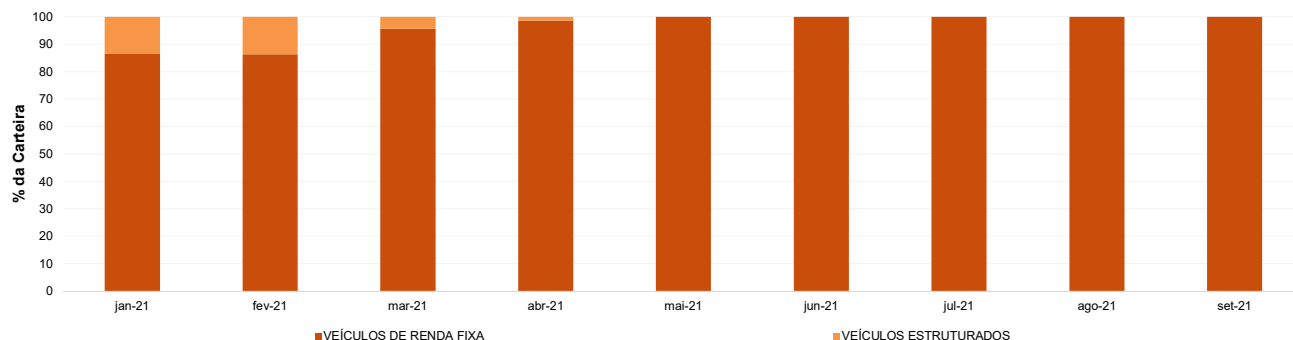
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

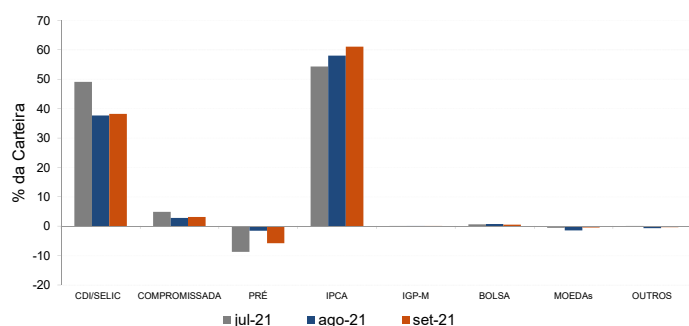
Distribuição da Carteira

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.

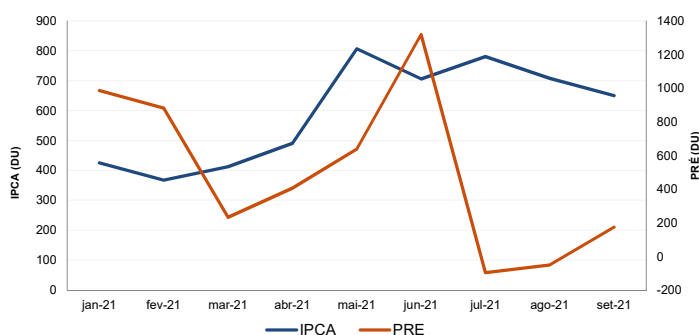
Evolução do Patrimônio Líquido



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	91,20	7,48	68,16	5,03
ASAI3	Comércio e Distribuição	82,66	6,78	50,98	3,76
BOVA11	Fundos	79,93	6,55	71,74	5,30
BOVV11	Fundos	75,20	6,17	60,70	4,48
RECV3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	66,29	5,44	60,27	4,45
SUZB3	Madeira e Papel	61,82	5,07	-1,49	-0,11
LREN3	Comércio	54,16	4,44	37,71	2,78
BRKM5	Químicos	52,00	4,26	63,98	4,72
JBSS3	Alimentos Processados	49,68	4,07	23,39	1,73
DESK3	Telecomunicações	48,06	3,94	70,42	5,20

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

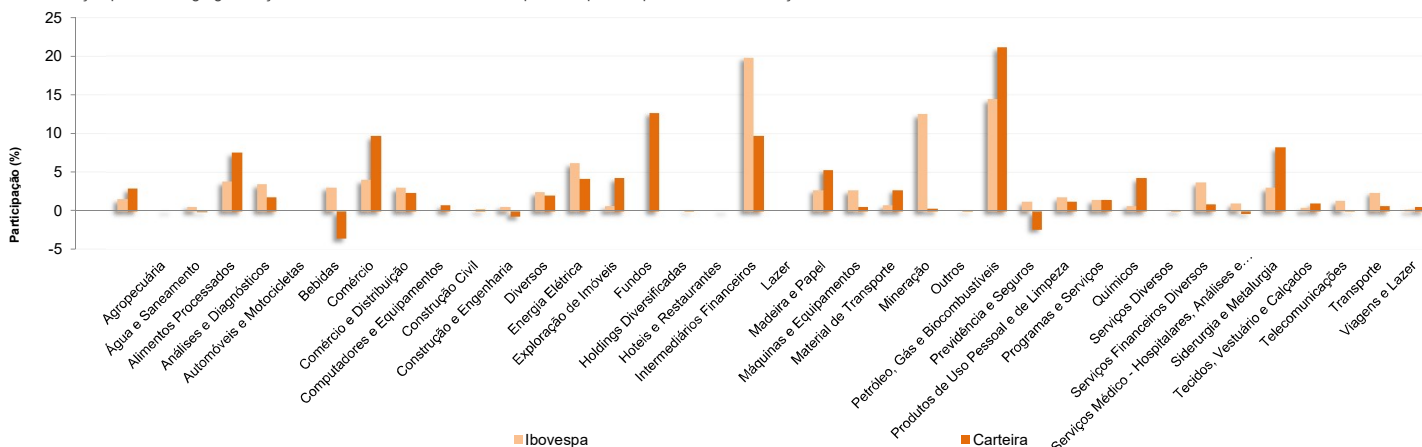
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PETR4	91,20	7,48	0,00	1
ASAI3	82,66	6,78	0,00	1
RECV3	66,29	5,44	0,00	1
SUZB3	61,82	5,07	0,00	1
LREN3	54,16	4,44	0,00	1
BRKM5	52,00	4,26	0,00	1
JBSS3	49,68	4,07	0,00	1
DESK3	48,06	3,94	0,01	1
EQTL3	46,74	3,83	0,00	1
CPLE6	42,64	3,50	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.



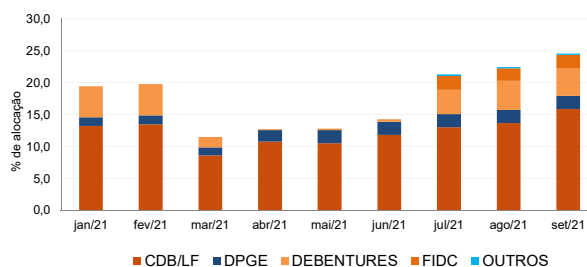
Análises de Contrapartes

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	6.416,11	6,37	Faixa 1
BCO SAFRA SA	4.157,16	4,13	Faixa 1
BANCO C6 S.A.	2.083,89	2,07	Sem Faixa
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.166,32	1,16	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	926,15	0,92	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	753,00	0,75	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	551,07	0,55	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	413,92	0,41	Faixa 1
PORTOSEG S/A CREDITO, FINANCIAMENTO E INV	406,57	0,40	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	405,45	0,40	Faixa 1

* 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
JSMLA5	11,17	SIMPAN S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-jan-31	CDI	3,50%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
JSMLA5	0,43	SIMPAN S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-jan-31	CDI	3,50%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
JSMLB5	75,62	SIMPAN S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-31	IPCA	8,22%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
JSMLB5	0,30	SIMPAN S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-31	IPCA	7,97%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
MOVI17	0,34	MOVIDA PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-26	CDI	2,70%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
MOVI27	0,25	MOVIDA PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-29	CDI	2,90%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
MOVI37	0,30	MOVIDA PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-31	IPCA	7,64%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
USIM27	0,03	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2,45%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
USIM27	0,03	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2,42%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
USIM27	0,02	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2,45%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
USIM27	0,00	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2,50%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
USIM27	0,00	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2,50%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
USIM27	0,16	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2,45%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
USIM27	0,15	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	1,93%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
USIM27	0,18	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	1,84%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/09/2021

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-set-23	50.228	0,05%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	03-set-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	02-set-24	50.246	0,05%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	02-set-21	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF IPCA	08-ago-22	1.999.865	1,99%	IPCA	BCO ITAU SA	16-set-21	3,07%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	280.561	0,28%	IPCA		02-set-21	4,46%	4,49%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	113.004	0,11%	IPCA		02-set-21	4,47%	4,49%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	62.992	0,06%	IPCA		28-set-21	4,78%	4,78%	ATLANTIDA FI MULT

