

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	145.419.905,72	100%										
Benchmark:	IPCA + 1% a.a.					1,24%	3,28%	5,28%	7,70%	11,34%	15,98%	20,53%
Multiestatégia	145.419.905,72	100%			1,09%	-0,08%	-0,68%	0,66%	1,09%	3,03%	5,68%	17,43%
ATLANTIDA 2 FI MULT	72.639.341,56	49,95%	ITAU	100%	1,32%	0,09%	-0,43%	-	-	-	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	72.780.564,16	50,05%	TAG INVEST	100%	1,14%	-0,24%	-0,93%	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 2.55% a.a.					1,37%	3,69%	6,09%	8,93%	13,05%	19,56%	26,15%
Total	145.419.006,63	100%			1,09%	-0,08%	-0,69%	0,70%	0,60%	4,51%	5,86%	21,24%
Benchmark:	IPCA + 2.55% a.a.					1,37%	3,69%	6,09%	8,93%	13,05%	19,56%	26,15%

* 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.

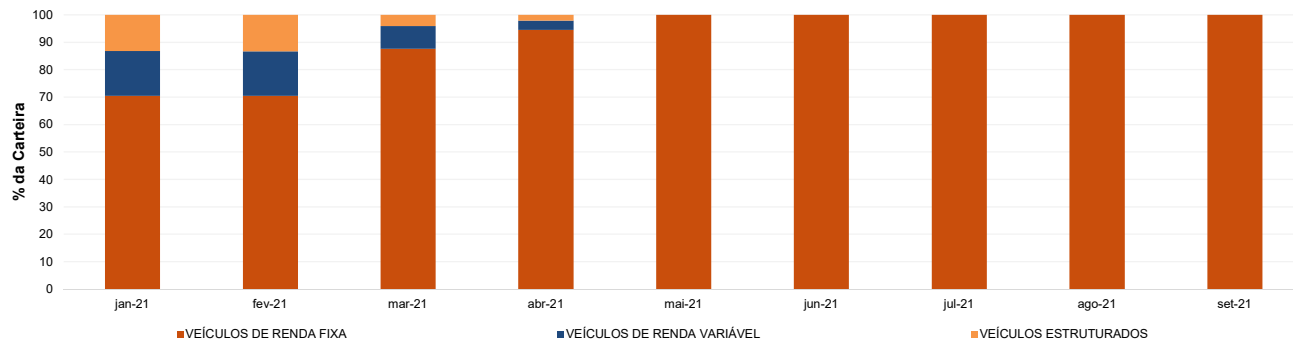
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

Distribuição da Carteira

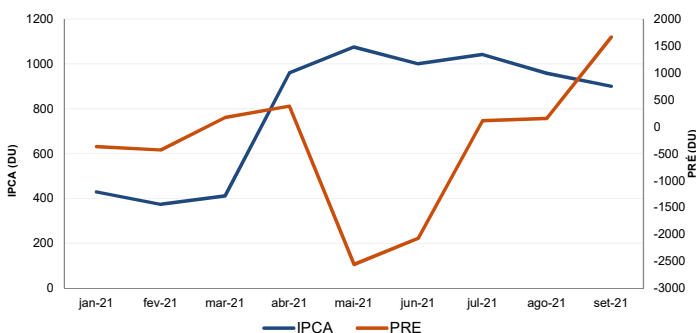
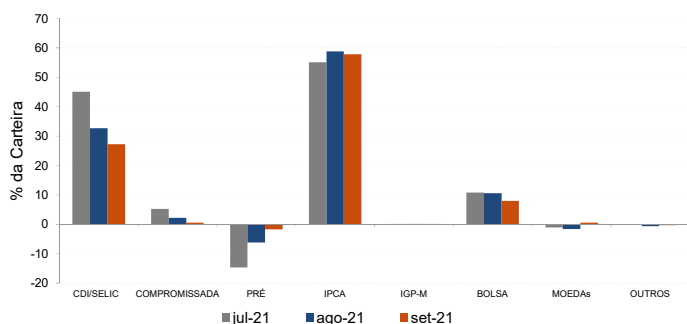
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais 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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	540,89	4,86	699,06	5,65
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	448,04	4,03	414,47	3,35
BBDC4	Intermediários Financeiros	382,42	3,44	412,25	3,33
ITUB4	Intermediários Financeiros	330,12	2,97	380,28	3,07
ITSA4	Intermediários Financeiros	273,02	2,45	312,74	2,53
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	261,70	2,35	314,98	2,55
BPAC11	Intermediários Financeiros	246,15	2,21	323,33	2,61
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	216,93	1,95	214,59	1,74
GNDI3	Análises e Diagnósticos	183,33	1,65	193,11	1,56
LREN3	Comércio	174,72	1,57	176,55	1,43

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

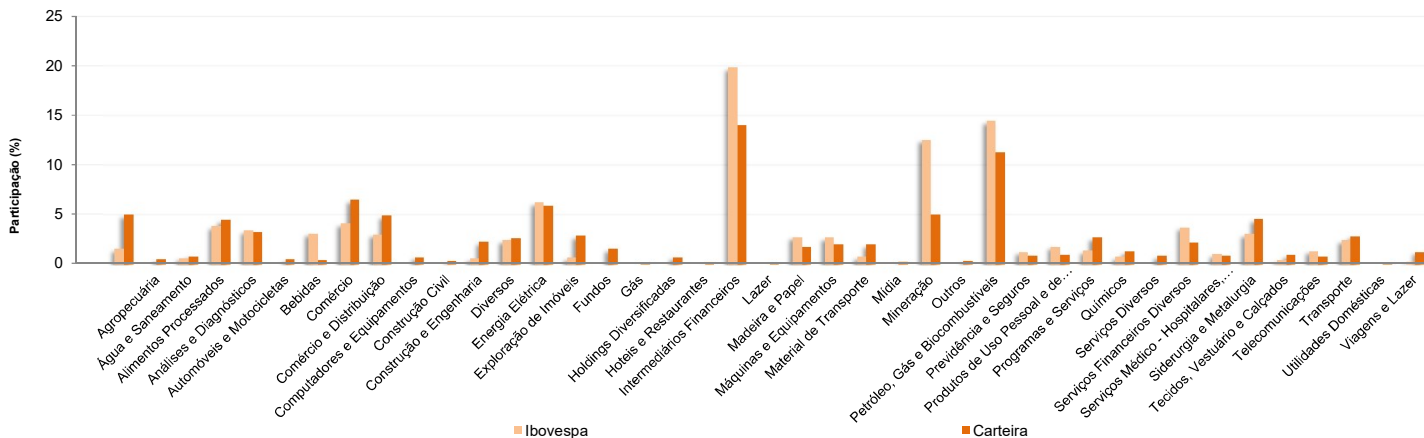
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BAUH4	23,00	0,21	0,02	15
VALE3	540,89	4,86	0,00	1
PETR4	448,04	4,03	0,00	1
BBDC4	382,42	3,44	0,00	1
ITUB4	330,12	2,97	0,00	1
ITSA4	273,02	2,45	0,00	1
PETR3	261,70	2,35	0,00	1
BPAC11	246,15	2,21	0,00	1
GGBR4	216,93	1,95	0,00	1
GNDI3	183,33	1,65	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.



Este 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.

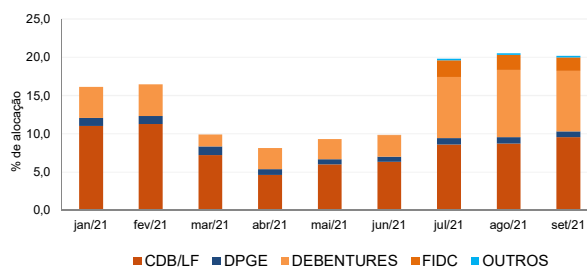
Análises de Contrapartes

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	4.023,42	2,52	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	2.936,06	1,84	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.402,49	1,51	Faixa 1
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.222,51	1,39	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	1.756,00	1,10	Faixa 2
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.039,23	0,65	Faixa 4
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	990,84	0,62	Faixa 2
BANCO VOTORANTIM S.A.	914,69	0,57	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	765,86	0,48	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	709,95	0,45	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
JSMLA5	16,68	SIMPAR S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-jan-31	CDI	3,50%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
JSMLA5	0,65	SIMPAR S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-jan-31	CDI	3,50%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
JSMLB5	112,92	SIMPAR S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-31	IPCA	8,22%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
JSMLB5	0,46	SIMPAR S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-31	IPCA	7,97%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
MOVI17	19,02	MOVIDA PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-26	CDI	2,71%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
MOVI17	0,51	MOVIDA PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-26	CDI	2,70%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
MOVI27	0,38	MOVIDA PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-29	CDI	2,90%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
MOVI37	0,45	MOVIDA PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-31	IPCA	7,64%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
USIM27	0,04	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2,45%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
USIM27	0,05	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2,42%	SPX NIMITZ 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	0,01	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	0,23	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2,45%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
USIM27	0,21	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	1,93%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
USIM27	0,25	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	1,84%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	0,03%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	03-set-21	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	02-set-24	50.246	0,03%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	02-set-21	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF IPCA	08-ago-22	1.999.865	1,25%	IPCA	BCO ITAU SA	16-set-21	3,07%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2022-09-01	01-set-22	143.353	0,09%	Selic		30-set-21	0,03%	0,03%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	66.131	0,04%	Selic		01-set-21	0,10%	0,09%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	186.962	0,12%	Selic		22-set-21	0,16%	0,16%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	2.194.161	1,38%	Selic		15-set-21	0,24%	0,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	261.766	0,16%	IPCA		02-set-21	2,73%	2,58%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	261.766	0,16%	IPCA		02-set-21	2,74%	2,58%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	483.188	0,30%	IPCA		14-set-21	4,50%	4,51%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	125.984	0,08%	IPCA		09-set-21	4,76%	4,66%	ATLANTIDA 2 FI MULT

