

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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 | ALOCÇÃO (R\$) | | GESTOR | % PL FUNDO | RISCO DE MERCADO | RENTABILIDADE* | | | | | | |
|---|-----------------------|---------------|------------|------------|------------------|----------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|
| | | | | | | 1M | 3M | 6M | ANO | 12M | 24M | 36M |
| Renda Fixa | 254.775.596,03 | 100% | | | | 0,31% | 0,21% | 1,39% | 1,93% | 3,95% | 6,81% | 18,53% |
| Benchmark: | IPCA + 1% a.a. | | | | | 1,24% | 3,28% | 5,28% | 7,70% | 11,34% | 15,98% | 20,53% |
| Multiestratégia - Perfil Moderado | 145.419.905,72 | 57,08% | | | 1,09% | -0,08% | -0,68% | 0,66% | 1,09% | 3,03% | 5,68% | 17,43% |
| ATLANTIDA 2 FI MULT | 72.639.341,56 | 28,51% | ITAU | 100% | 1,32% | 0,09% | -0,43% | - | - | - | - | - |
| ITAPEMA 2 FI MULT | 72.780.564,16 | 28,57% | 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% |
| Multiestratégia - Perfil Conservador | 101.537.422,15 | 39,85% | | | 0,66% | 0,77% | 1,22% | 2,07% | 2,51% | 4,50% | 7,42% | 19,37% |
| ATLANTIDA FI MULT | 51.651.989,02 | 20,27% | ITAU | 100% | 0,57% | 1,02% | 1,90% | 3,02% | 3,68% | 6,26% | 10,17% | 22,92% |
| ITAPEMA FI MULT | 49.885.433,13 | 19,58% | TAG INVEST | 100% | 0,83% | 0,52% | 0,51% | 1,19% | 1,36% | 2,71% | 4,20% | 15,33% |
| Benchmark: | IPCA + 1,2% a.a. | | | | | 1,26% | 3,34% | 5,38% | 7,85% | 11,56% | 16,44% | 21,24% |
| Renda Fixa ALM | 6.781.028,26 | 2,66% | | | 0,01% | | | | | | | |
| RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF | 6.781.028,26 | 2,66% | | 100% | 0,01% | 1,70% | 4,40% | 7,98% | 12,35% | 17,40% | 28,77% | 41,87% |
| Benchmark: | IPCA + 4,39% a.a. | | | | | 1,52% | 4,17% | 7,04% | 10,38% | 15,07% | 23,88% | 33,04% |
| Renda Fixa CDI | 1.037.239,89 | 0,41% | | | 0,02% | 0,47% | 1,31% | 2,06% | 2,84% | 3,39% | 4,40% | 11,43% |
| BRAM FI RF REF DI FEDERAL II | 1.037.239,89 | 0,41% | BRADESCO | 0,02% | 0,02% | 0,47% | 1,31% | 2,08% | 2,54% | 3,00% | 6,41% | 13,04% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,44% | 1,22% | 2,01% | 2,51% | 2,99% | 6,65% | 13,35% |
| Total | 254.770.428,67 | 100% | | | 0,88% | 0,31% | 0,21% | 1,57% | 1,86% | 5,16% | 7,12% | 20,10% |
| Benchmark: | IPCA + 4,39% a.a. | | | | | 1,52% | 4,17% | 7,04% | 10,38% | 15,07% | 23,88% | 33,04% |

* 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.

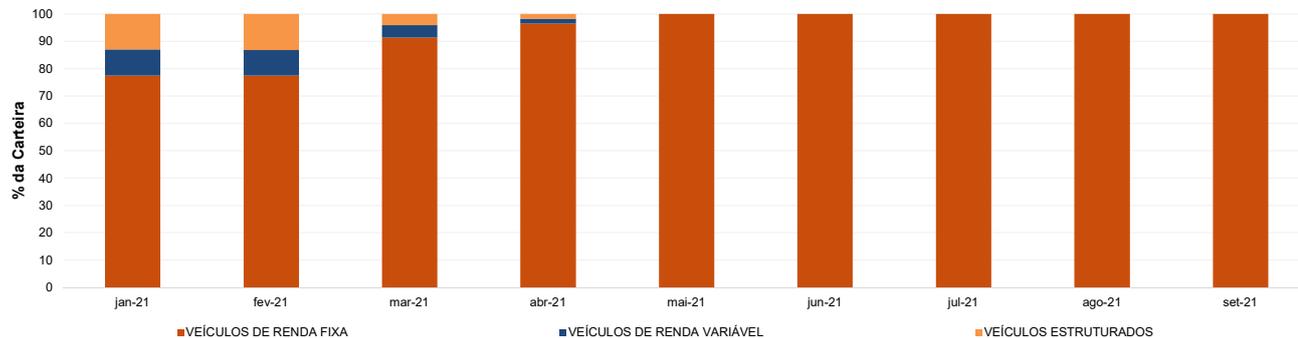
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

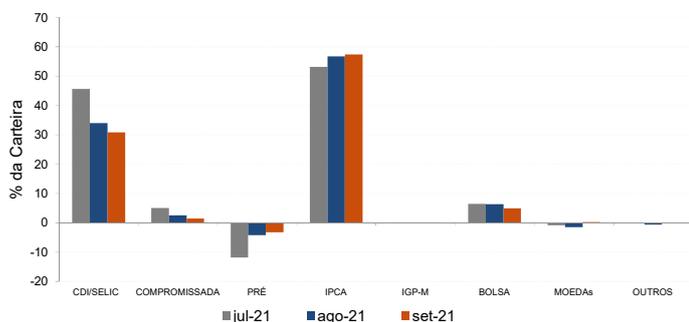
Distribuição da Carteira

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.

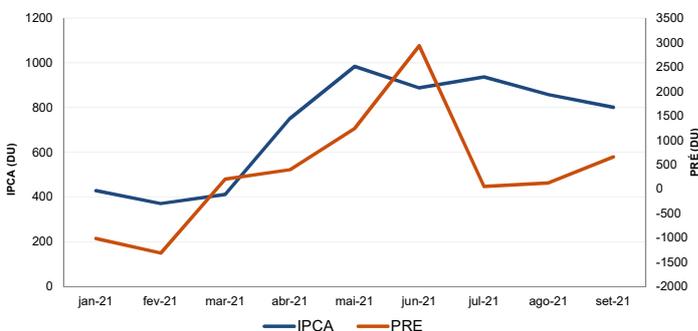
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | 556,78 | 4,51 | 749,10 | 5,46 |
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 539,24 | 4,37 | 482,63 | 3,52 |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 384,10 | 3,11 | 404,56 | 2,95 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 370,00 | 3,00 | 400,21 | 2,92 |
| ITSA4 | Intermediários Financeiros | 290,97 | 2,36 | 332,74 | 2,42 |
| PETR3 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 290,68 | 2,35 | 346,77 | 2,53 |
| BPAC11 | Intermediários Financeiros | 284,85 | 2,31 | 375,91 | 2,74 |
| GGBR4 | Siderurgia e Metalurgia | 255,05 | 2,07 | 228,09 | 1,66 |
| ASAI3 | Comércio e Distribuição | 238,98 | 1,94 | 152,12 | 1,11 |
| LREN3 | Comércio | 228,88 | 1,85 | 214,27 | 1,56 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

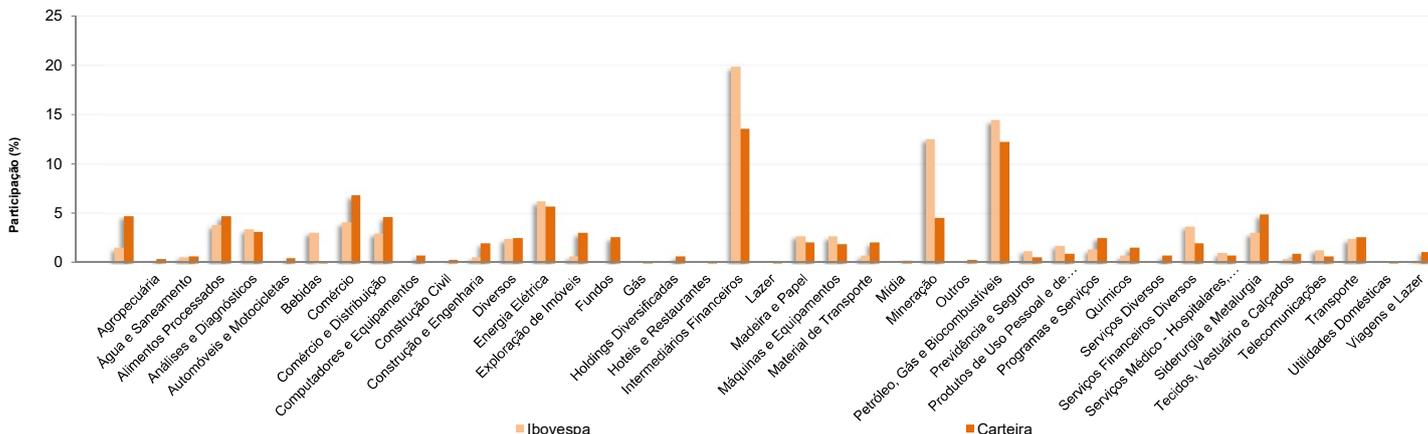
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|--------|--------|------|--------------|--------------------|
| BAUH4 | 23,00 | 0,19 | 0,02 | 15 |
| VALE3 | 556,78 | 4,51 | 0,00 | 1 |
| PETR4 | 539,24 | 4,37 | 0,00 | 1 |
| BBDC4 | 384,10 | 3,11 | 0,00 | 1 |
| ITUB4 | 370,00 | 3,00 | 0,00 | 1 |
| ITSA4 | 290,97 | 2,36 | 0,00 | 1 |
| PETR3 | 290,68 | 2,35 | 0,00 | 1 |
| BPAC11 | 284,85 | 2,31 | 0,00 | 1 |
| GGBR4 | 255,05 | 2,07 | 0,00 | 1 |
| ASAI3 | 238,98 | 1,94 | 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

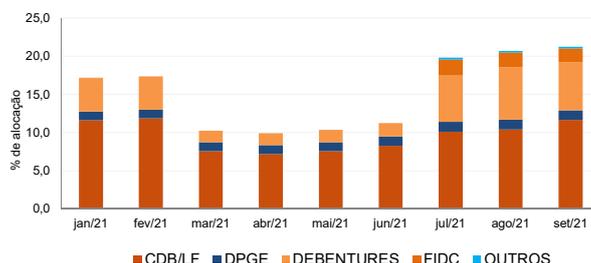
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|----------------------------|-----------|------|---------------------------|
| BCO ITAU SA | 10.439,53 | 3,90 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 6.559,65 | 2,45 | Faixa 1 |
| BCO BRADESCO SA | 3.862,21 | 1,44 | Faixa 1 |
| ESTACIO PARTICIPACOES SA | 2.222,51 | 0,83 | Faixa 1 |
| BANCO C6 S.A. | 2.183,83 | 0,82 | Sem Faixa |
| BCO DAYCOVAL SA | 1.856,40 | 0,69 | Faixa 2 |
| BANCO VOTORANTIM S.A. | 1.667,68 | 0,62 | Faixa 2 |
| BCO TOYOTA BRASIL SA | 1.268,29 | 0,47 | Faixa 1 |
| COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS | 1.043,66 | 0,39 | Faixa 2 |
| OMNI SA CRED FINANC INVEST | 1.039,23 | 0,39 | Faixa 4 |

* 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 | SIMPAR S.A. | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-jan-31 | CDI | 3,50% | AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV |
| 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 |
| JSMLA5 | 0,43 | SIMPAR S.A. | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-jan-31 | CDI | 3,50% | LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT |
| JSMLB5 | 75,62 | 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 |
| JSMLB5 | 0,30 | SIMPAR S.A. | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-set-31 | IPCA | 7,97% | 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 |
| MOVI17 | 19,02 | MOVIDA PARTICIPACOES | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-set-26 | CDI | 2,71% | ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV |
| MOVI17 | 0,34 | MOVIDA PARTICIPACOES | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-set-26 | CDI | 2,70% | LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT |
| 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 |
| MOVI27 | 0,25 | 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 |
| MOVI37 | 0,30 | MOVIDA PARTICIPACOES | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-set-31 | IPCA | 7,64% | LEGACY CAPITAL 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 |
| 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 | 0,04 | 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 | 0,05 | USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN | Faixa 2 | Faixa 1 | 30-set-25 | CDI | 2,42% | 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 | 0,03 | 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 | 0,16 | 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 | 0,23 | 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 |
| USIM27 | 0,15 | USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN | Faixa 2 | Faixa 1 | 30-set-25 | CDI | 1,93% | SPX NIMITZ MASTER FI MULT |

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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 | 0,02% | CDI | BCO VOLKSWAGEN SA | 03-set-21 | 1,10% | Faixa 1 | ATLANTIDA FI MULT |
| LF CDI | 04-set-23 | 50.228 | 0,02% | CDI | BCO VOLKSWAGEN SA | 03-set-21 | 1,10% | Faixa 1 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 02-set-24 | 50.246 | 0,02% | CDI | BCO VOLKSWAGEN SA | 02-set-21 | 1,25% | Faixa 1 | ATLANTIDA FI MULT |
| LF CDI | 02-set-24 | 50.246 | 0,02% | CDI | BCO VOLKSWAGEN SA | 02-set-21 | 1,25% | Faixa 1 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF IPCA | 08-ago-22 | 1.999.865 | 0,75% | IPCA | BCO ITAU SA | 16-set-21 | 3,07% | Faixa 1 | ATLANTIDA FI MULT |
| LF IPCA | 08-ago-22 | 1.999.865 | 0,75% | 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 2022-03-01 | 01-mar-22 | 3.062 | 0,00% | Selic | | 16-set-21 | 4,00% | 0,03% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 143.353 | 0,05% | Selic | | 30-set-21 | 0,03% | 0,03% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 44.191 | 0,02% | Selic | | 02-set-21 | 0,03% | 0,03% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 12.223 | 0,00% | Selic | | 02-set-21 | 0,03% | 0,03% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 4.702 | 0,00% | Selic | | 02-set-21 | 0,03% | 0,03% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 3.056 | 0,00% | Selic | | 16-set-21 | 0,03% | 0,03% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 66.131 | 0,02% | Selic | | 01-set-21 | 0,10% | 0,09% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 186.962 | 0,07% | Selic | | 22-set-21 | 0,16% | 0,16% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 10.159 | 0,00% | Selic | | 15-set-21 | 0,15% | 0,15% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 9.143 | 0,00% | Selic | | 16-set-21 | 0,15% | 0,16% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 18.271 | 0,01% | Selic | | 01-set-21 | 0,17% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2024-03-01 | 01-mar-24 | 16.241 | 0,01% | Selic | | 28-set-21 | 0,16% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 20.284 | 0,01% | Selic | | 01-set-21 | 0,17% | 0,00% | BRAM FI RF REF DI FEDERAL II |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 2.194.161 | 0,82% | Selic | | 15-set-21 | 0,24% | 0,00% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 261.766 | 0,10% | IPCA | | 02-set-21 | 2,74% | 2,58% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 261.766 | 0,10% | IPCA | | 02-set-21 | 2,73% | 2,58% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2026-08-15 | 15-ago-26 | 483.188 | 0,18% | IPCA | | 14-set-21 | 4,50% | 4,51% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2026-08-15 | 15-ago-26 | 280.561 | 0,10% | IPCA | | 02-set-21 | 4,46% | 4,49% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2026-08-15 | 15-ago-26 | 113.004 | 0,04% | IPCA | | 02-set-21 | 4,47% | 4,49% | ATLANTIDA FI MULT |
| NTN-B 2028-08-15 | 15-ago-28 | 125.984 | 0,05% | IPCA | | 09-set-21 | 4,76% | 4,66% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2028-08-15 | 15-ago-28 | 62.992 | 0,02% | IPCA | | 28-set-21 | 4,78% | 4,78% | ATLANTIDA FI MULT |