

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/01/2022

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	116.546.874,54	100%										
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
Multiestatégia	116.546.874,54	100%			0,70%	0,50%	2,53%	2,72%	0,50%	4,16%	7,12%	16,51%
ATLANTIDA FI MULT	59.207.564,81	50,80%	ITAU	100%	0,59%	0,42%	2,38%	3,22%	0,42%	5,38%	9,56%	19,46%
ITAPEMA FI MULT	57.339.309,74	49,20%	TAG INVEST	100%	0,89%	0,59%	2,68%	2,22%	0,59%	2,97%	4,26%	13,08%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					0,91%	3,39%	8,00%	0,91%	15,35%	25,97%	37,18%
Total	116.544.165,52	100%			0,70%	0,50%	2,53%	2,71%	0,50%	4,25%	6,74%	16,02%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					0,91%	3,39%	8,00%	0,91%	15,35%	25,97%	37,18%

* 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.

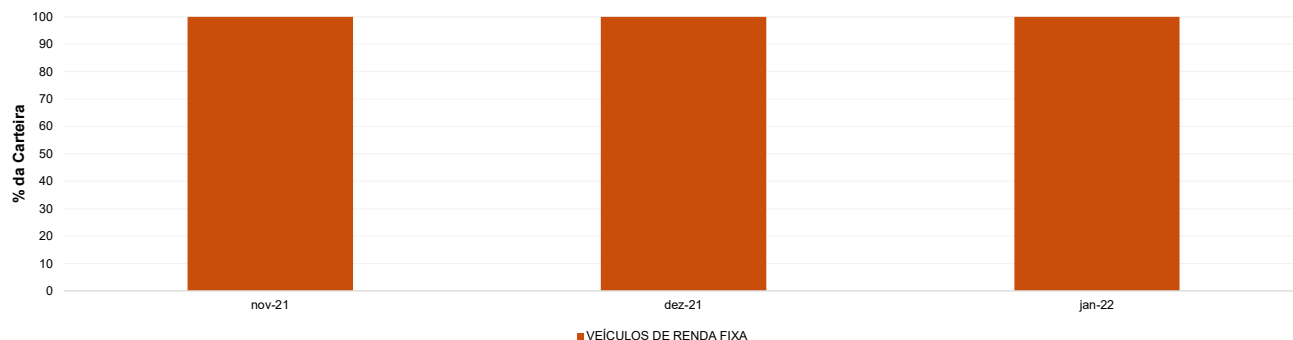
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

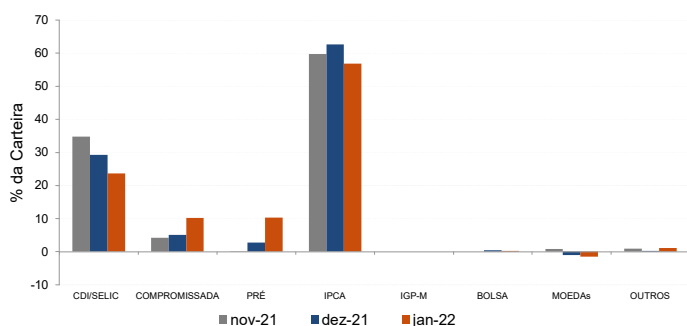
Distribuição da Carteira

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.

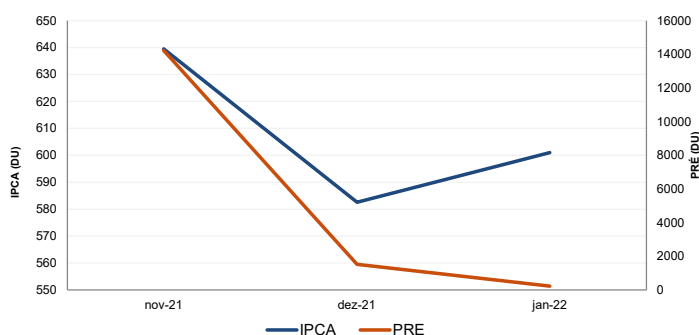
Evolução do Patrimônio Líquido



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	184,58	15,80	158,28	15,16
SUZB3	Madeira e Papel	100,59	8,61	81,56	7,81
BOVA11	Fundos	86,26	7,39	80,55	7,71
BOVV11	Fundos	82,87	7,10	74,89	7,17
ITUB4	Intermediários Financeiros	73,38	6,28	47,24	4,52
DIRR3	Construção e Engenharia	44,93	3,85	40,90	3,92
GNDI3	Análises e Diagnósticos	42,05	3,60	44,80	4,29
CPFE3	Energia Elétrica	41,35	3,54	34,28	3,28
RAIL3	Transporte	40,38	3,46	11,87	1,14
ENGI11	Energia Elétrica	39,73	3,40	33,50	3,21

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

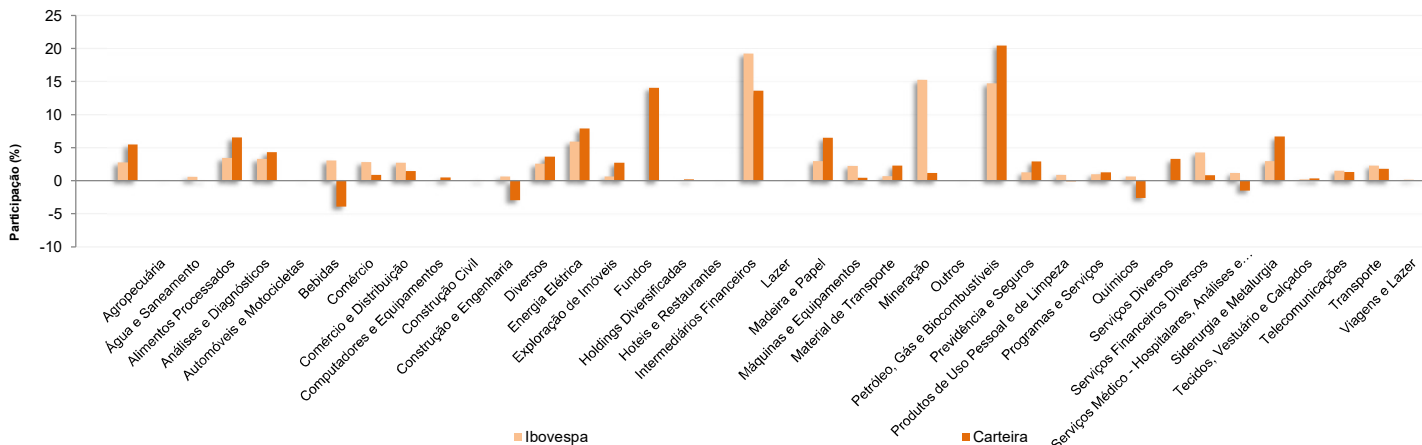
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PETR4	184,58	15,80	0,00	1
SUZB3	100,59	8,61	0,00	1
ITUB4	73,38	6,28	0,00	1
DIRR3	44,93	3,85	0,00	1
GNDI3	42,05	3,60	0,00	1
CPFE3	41,35	3,54	0,00	1
RAIL3	40,38	3,46	0,00	1
ENGI11	39,73	3,40	0,00	1
USIM5	38,57	3,30	0,00	1
BRAP4	38,25	3,27	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

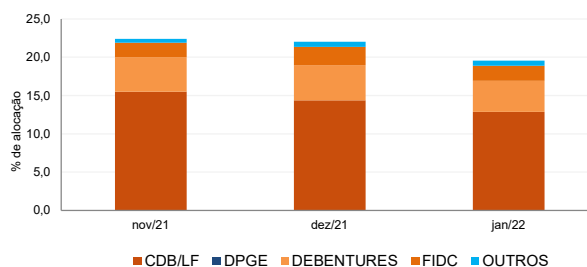
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	6.042,11	5,21	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.757,68	2,38	Faixa 1
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.165,80	1,01	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	954,17	0,82	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	754,22	0,65	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	551,74	0,48	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	417,64	0,36	Faixa 1
PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	413,23	0,36	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	399,30	0,34	Faixa 1
APICE SECURITIZADORA IMOBILIARIA SA	390,95	0,34	Sem Faixa

* 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
AMBP12	0,44	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS	Sem Faixa	Faixa 2	15-jul-27	CDI	2,75%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
AMBP12	0,03	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS	Sem Faixa	Faixa 2	15-jul-27	CDI	2,61%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT



RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/01/2022

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
CDB CDI	24-jul-23	106.164	0,09%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	25-jan-22	0,97%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	24-jan-24	150.299	0,13%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	24-jan-22	1,30%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	06-jan-25	100.289	0,09%	CDI	BCO TRIANGULO SA	20-jan-22	1,65%	Faixa 3	ATLANTIDA FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-03-01	01-mar-23	3.789.731	3,27%	Selic		04-jan-22	5,00%	0,05%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.300.952	1,12%	Selic		12-jan-22	5,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	859.760	0,74%	Selic		05-jan-22	5,00%	0,05%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	339.379	0,29%	Selic		28-jan-22	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.108.086	0,96%	Selic		13-jan-22	6,00%	0,06%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	960.583	0,83%	IPCA		07-jan-22	5,58%	5,61%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	128.337	0,11%	IPCA		18-jan-22	5,99%	6,14%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	330.091	0,28%	IPCA		06-jan-22	5,43%	5,50%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-F 2031-01-01	01-jan-33	190.427	0,16%	PRE		07-jan-22	11,42%	11,38%	ATLANTIDA FI MULT

