

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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 | ALOCÇÃO (R\$) | GESTOR | % PL FUNDO | RISCO DE MERCADO | RENTABILIDADE* | | | | | | | |
|-------------------------|-----------------------|--------|-------------|------------------|----------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|
| | | | | | 1M | 3M | 6M | ANO | 12M | 24M | 36M | |
| Renda Fixa | 128.442.060,06 | | 100% | | | | | | | | | |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,73% | 2,10% | 3,47% | 0,73% | 5,00% | 7,66% | 13,90% | |
| Multiestatégia | 128.442.060,06 | | 100% | | 1,34% | 0,65% | 2,92% | 1,15% | 0,65% | 2,44% | 5,14% | 14,34% |
| ATLANTIDA 2 FI MULT | 64.514.099,58 | 50,23% | ITAÚ | 100% | 1,43% | 0,45% | 3,30% | 1,85% | 0,45% | - | - | - |
| ITAPEMA 2 FI MULT | 63.927.960,48 | 49,77% | TAG INVEST | 100% | 1,42% | 0,86% | 2,52% | 0,45% | 0,86% | - | - | - |
| Benchmark: | IPCA + 5.5% a.a. | | | | 0,99% | 3,64% | 8,51% | 0,99% | 16,45% | 28,37% | 41,14% | |
| Total | 128.441.196,10 | | 100% | | 1,34% | 0,65% | 2,91% | 1,13% | 0,65% | 2,31% | 3,83% | 15,31% |
| Benchmark: | IPCA + 5.5% a.a. | | | | 0,99% | 3,64% | 8,51% | 0,99% | 16,45% | 28,37% | 41,14% | |

* 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.

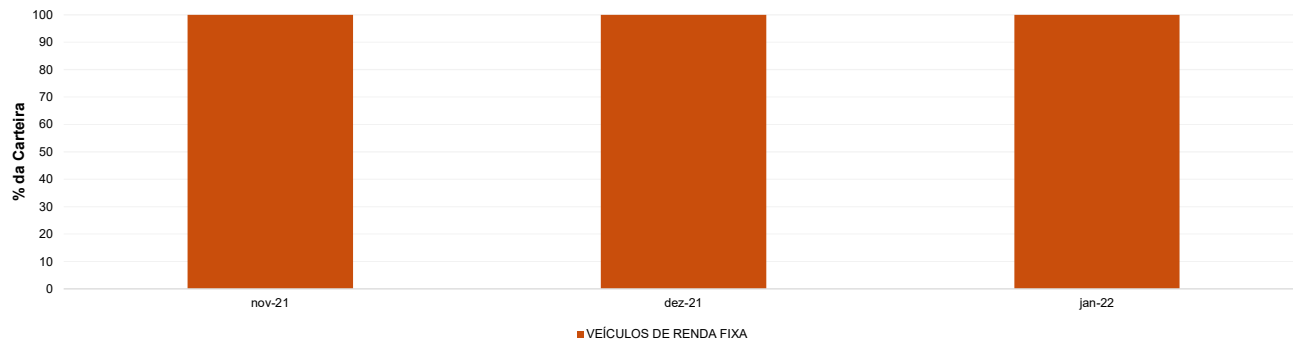
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

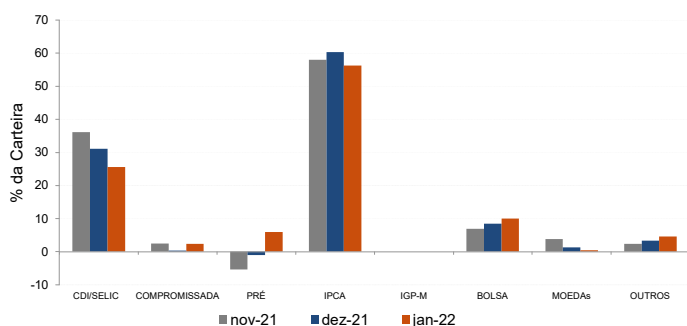
Distribuição da Carteira

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.

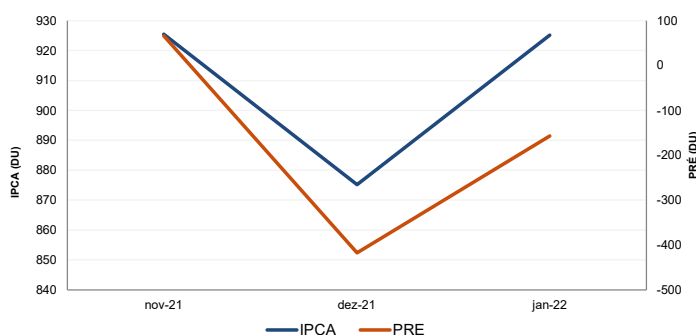
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | 721,18 | 5,23 | 737,35 | 5,73 |
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 671,76 | 4,87 | 609,16 | 4,73 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 463,76 | 3,36 | 347,59 | 2,70 |
| ENGI11 | Energia Elétrica | 324,74 | 2,35 | 302,48 | 2,35 |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 301,55 | 2,19 | 262,66 | 2,04 |
| EQTL3 | Energia Elétrica | 289,66 | 2,10 | 268,76 | 2,09 |
| MULT3 | Exploração de Imóveis | 284,36 | 2,06 | 256,02 | 1,99 |
| RAIL3 | Transporte | 277,96 | 2,01 | 284,21 | 2,21 |
| CPFE3 | Energia Elétrica | 270,77 | 1,96 | 252,90 | 1,97 |
| SUZB3 | Madeira e Papel | 265,98 | 1,93 | 264,45 | 2,05 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

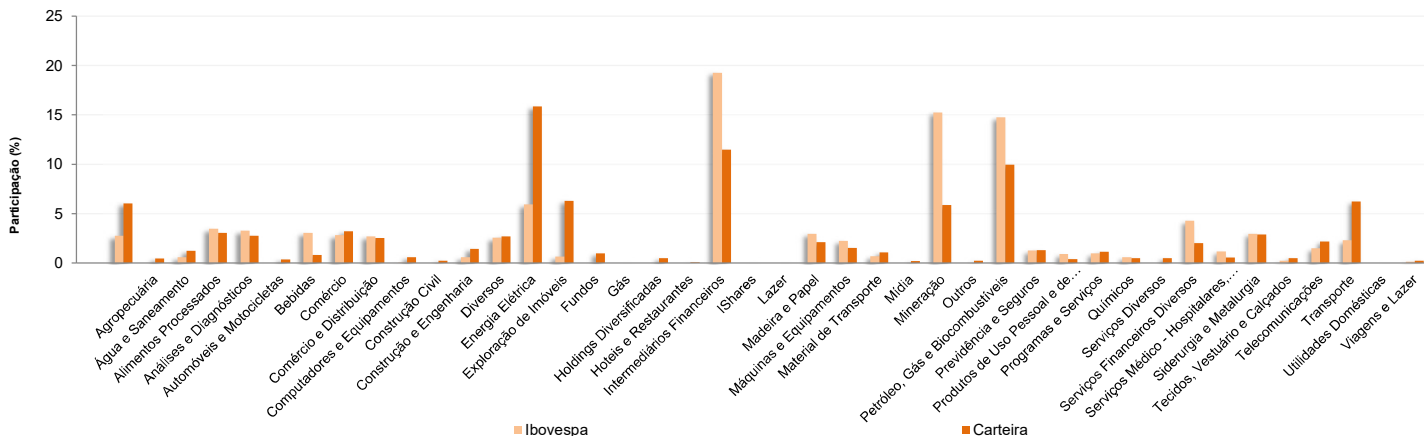
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|--------|--------|------|--------------|--------------------|
| OMGE3 | 6,33 | 0,05 | 0,00 | Sem Liquidez |
| BAUH4 | 20,15 | 0,15 | 0,02 | 3 |
| CRPG6 | 9,58 | 0,07 | 0,00 | 3 |
| CRDE3 | 0,08 | 0,00 | 0,00 | 2 |
| VALE3 | 721,18 | 5,23 | 0,00 | 1 |
| PETR4 | 671,76 | 4,87 | 0,00 | 1 |
| ITUB4 | 463,76 | 3,36 | 0,00 | 1 |
| ENGI11 | 324,74 | 2,35 | 0,00 | 1 |
| BBDC4 | 301,55 | 2,19 | 0,00 | 1 |
| EQTL3 | 289,66 | 2,10 | 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

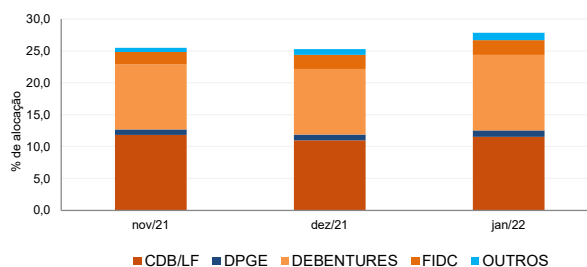
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|-------------------------------------|----------|------|---------------------------|
| BCO ITAU SA | 4.178,12 | 3,29 | Faixa 1 |
| BCO BRADESCO SA | 3.210,20 | 2,53 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 2.379,72 | 1,87 | Faixa 1 |
| ESTACIO PARTICIPACOES SA | 2.312,45 | 1,82 | Faixa 1 |
| OMNI SA CRED FINANC INVEST | 1.072,20 | 0,84 | Faixa 4 |
| CIA LOCACAO AMERICAS | 1.021,14 | 0,80 | Faixa 2 |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 1.002,56 | 0,79 | Faixa 2 |
| BANCO VOTORANTIM S.A. | 976,95 | 0,77 | Faixa 2 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 803,59 | 0,63 | Faixa 1 |
| APICE SECURITIZADORA IMOBILIARIA SA | 740,47 | 0,58 | 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 | 0,67 | AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-jul-27 | CDI | 2,75% | LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT |
| AMBP12 | 0,04 | AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS | Sem Faixa | Faixa 2 | 15-jul-27 | CDI | 2,61% | LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT |
| NP CDI | 0,01 | CCR SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 03-dez-23 | CDI | 1,40% | BB TOP DI RF REF DI LP FI |
| NP CDI | 0,00 | CCR SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 03-dez-23 | CDI | 1,40% | BB TOP DI RF REF DI LP FI |

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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 | 115.178 | 0,09% | CDI | BCO ABC BRASIL SA | 25-jan-22 | 0,97% | Faixa 2 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 24-jan-24 | 150.299 | 0,12% | CDI | BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC | 24-jan-22 | 1,30% | Faixa 2 | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LF CDI | 06-jan-25 | 100.289 | 0,08% | CDI | BCO TRIANGULO SA | 20-jan-22 | 1,65% | Faixa 3 | ATLANTIDA 2 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 | 1.911.834 | 1,51% | Selic | | 12-jan-22 | 5,00% | 0,04% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 984.199 | 0,78% | Selic | | 13-jan-22 | 4,00% | 0,04% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 407.255 | 0,32% | Selic | | 28-jan-22 | 0,02% | 0,02% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 108.892 | 0,09% | IPCA | | 19-jan-22 | 6,12% | 6,10% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2022-08-15 | 15-ago-22 | 42.779 | 0,03% | IPCA | | 27-jan-22 | 6,76% | 6,77% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 1.706.608 | 1,34% | IPCA | | 04-jan-22 | 5,66% | 5,78% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 49.744 | 0,04% | IPCA | | 27-jan-22 | 6,18% | 6,46% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2024-08-15 | 15-ago-24 | 51.085 | 0,04% | IPCA | | 27-jan-22 | 5,50% | 5,67% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2024-08-15 | 15-ago-24 | 47.156 | 0,04% | IPCA | | 31-jan-22 | 5,67% | 5,72% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 23.388 | 0,02% | IPCA | | 27-jan-22 | 5,37% | 5,52% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2026-08-15 | 15-ago-26 | 31.942 | 0,03% | IPCA | | 27-jan-22 | 5,29% | 5,40% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2026-08-15 | 15-ago-26 | 7.985 | 0,01% | IPCA | | 28-jan-22 | 5,37% | 5,39% | ATLANTIDA 2 FI MULT |
| NTN-B 2030-08-15 | 15-ago-30 | 120.868 | 0,10% | IPCA | | 18-jan-22 | 5,58% | 5,63% | ATLANTIDA 2 FI MULT |

