

## RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>252.888.304,04</b>	<b>100%</b>				<b>0,59%</b>	<b>2,78%</b>	<b>1,97%</b>	<b>0,59%</b>	<b>3,47%</b>	<b>6,42%</b>	<b>15,76%</b>
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
<b>Multiestratégia Perfil Moderado</b>	<b>128.442.060,06</b>	<b>50,79%</b>			<b>1,34%</b>	<b>0,65%</b>	<b>2,92%</b>	<b>1,15%</b>	<b>0,65%</b>	<b>2,44%</b>	<b>5,14%</b>	<b>14,34%</b>
ATLANTIDA 2 FI MULT	64.514.099,58	25,51%	ITAU	100%	1,43%	0,45%	3,30%	1,85%	0,45%	-	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	63.927.960,48	25,28%	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%
<b>Multiestratégia Perfil Conservador</b>	<b>116.546.874,54</b>	<b>46,09%</b>			<b>0,70%</b>	<b>0,50%</b>	<b>2,53%</b>	<b>2,72%</b>	<b>0,50%</b>	<b>4,16%</b>	<b>7,12%</b>	<b>16,51%</b>
ATLANTIDA FI MULT	59.207.564,81	23,41%	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	22,67%	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%
<b>Renda Fixa ALM</b>	<b>7.116.482,19</b>	<b>2,81%</b>			<b>0,01%</b>							
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	7.116.482,19	2,81%		100%	0,01%	1,20%	4,37%	9,26%	1,20%	17,42%	30,94%	45,86%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,90%	3,36%	7,94%	0,90%	15,23%	25,70%	36,75%
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>782.887,24</b>	<b>0,31%</b>			<b>0,02%</b>	<b>0,77%</b>	<b>2,13%</b>	<b>3,61%</b>	<b>0,77%</b>	<b>5,29%</b>	<b>5,75%</b>	<b>11,77%</b>
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	782.887,24	0,31%	BRADESCO	0,01%	0,02%	0,77%	2,13%	3,61%	0,77%	5,11%	7,53%	13,71%
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
<b>Total</b>	<b>252.883.091,32</b>	<b>100%</b>			<b>0,96%</b>	<b>0,59%</b>	<b>2,78%</b>	<b>1,97%</b>	<b>0,59%</b>	<b>3,67%</b>	<b>5,87%</b>	<b>16,44%</b>
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,90%	3,36%	7,94%	0,90%	15,23%	25,70%	36,75%

\* 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.

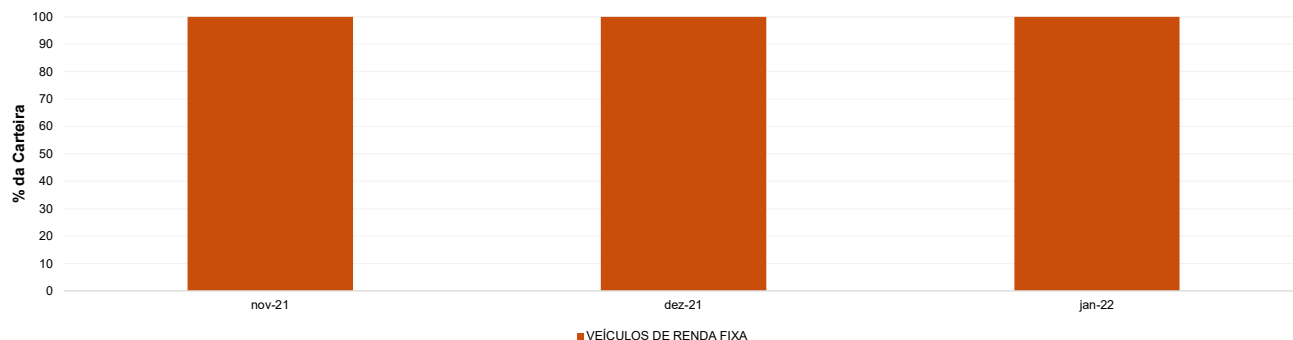
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

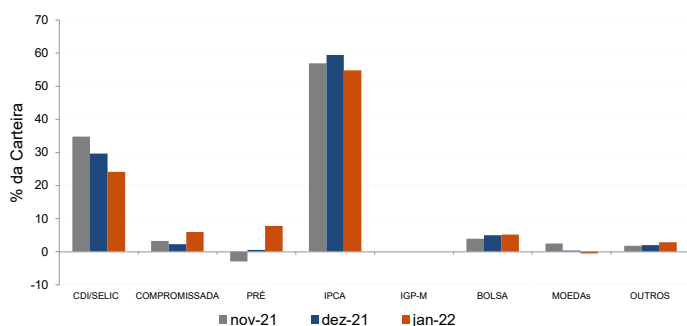
## Distribuição da Carteira

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.

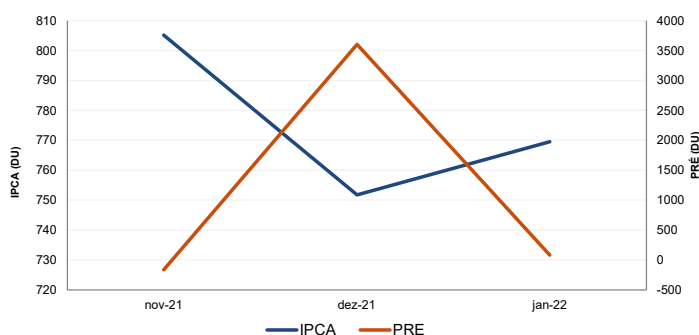
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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	856,34	5,72	767,44	5,52
VALE3	Mineração	695,13	4,65	743,94	5,35
ITUB4	Intermediários Financeiros	537,14	3,59	394,84	2,84
SUZB3	Madeira e Papel	366,57	2,45	346,01	2,49
ENGI11	Energia Elétrica	364,48	2,44	335,98	2,41
BBDC4	Intermediários Financeiros	325,29	2,17	284,09	2,04
RAIL3	Transporte	318,34	2,13	296,07	2,13
CPFE3	Energia Elétrica	312,13	2,09	287,19	2,06
MULT3	Exploração de Imóveis	293,82	1,96	259,84	1,87
EQTL3	Energia Elétrica	283,45	1,89	248,52	1,79

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

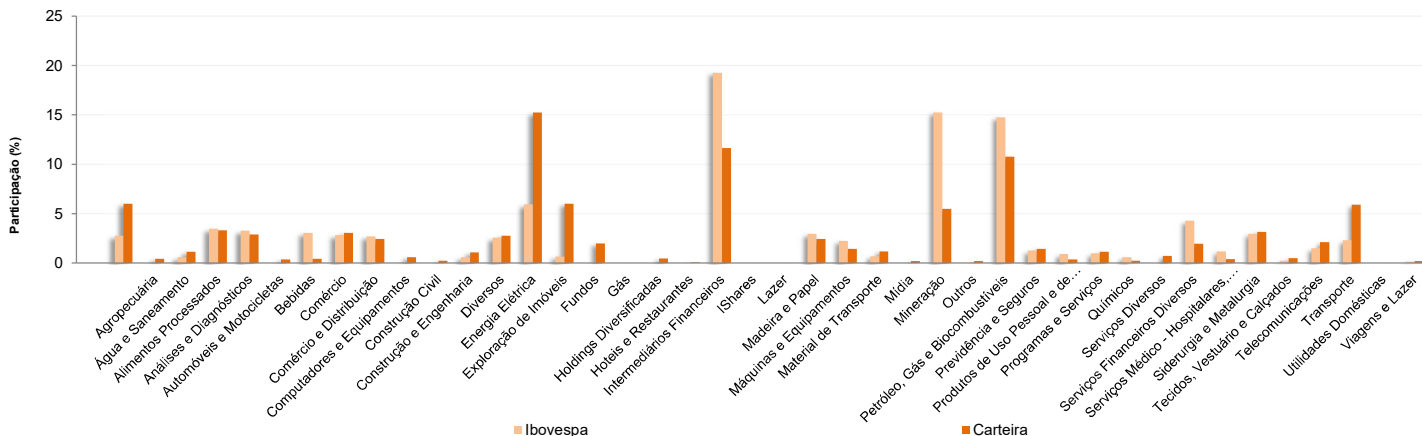
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
OMGE3	6,33	0,04	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	20,15	0,13	0,02	3
CRPG6	9,58	0,06	0,00	3
CRDE3	0,08	0,00	0,00	2
PETR4	856,34	5,72	0,00	1
VALE3	695,13	4,65	0,00	1
ITUB4	537,14	3,59	0,00	1
SUZB3	366,57	2,45	0,00	1
ENGI11	364,48	2,44	0,00	1
BBDC4	325,29	2,17	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

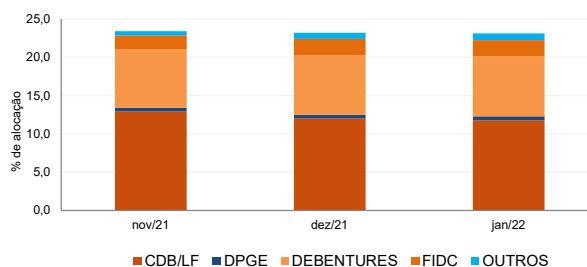
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	10.220,24	4,08	Faixa 1
BCO SAFRA SA	5.137,39	2,05	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	4.164,37	1,66	Faixa 1
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.312,45	0,92	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.731,16	0,69	Faixa 2
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.270,81	0,51	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.157,71	0,46	Faixa 2
APICE SECURITIZADORA IMOBILIARIA SA	1.131,42	0,45	Sem Faixa
CIA LOCAÇAO AMERICAS	1.080,56	0,43	Faixa 2
OMNI SA CRED FINANÇ INVEST	1.072,20	0,43	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
AMBP12	0,03	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS	Sem Faixa	Faixa 2	15-jul-27	CDI	2,61%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
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
AMBP12	0,44	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTOS	Sem Faixa	Faixa 2	15-jul-27	CDI	2,75%	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 PLANO CV

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	0,05%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	25-jan-22	0,97%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
CDB CDI	24-jul-23	106.164	0,04%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	25-jan-22	0,97%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	24-jan-24	150.299	0,06%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	24-jan-22	1,30%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	24-jan-24	150.299	0,06%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	24-jan-22	1,30%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	06-jan-25	100.289	0,04%	CDI	BCO TRIANGULO SA	20-jan-22	1,65%	Faixa 3	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	06-jan-25	100.289	0,04%	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 2022-03-01	01-mar-22	7.206	0,00%	Selic		21-jan-22	0,03%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	6.990	0,00%	Selic		07-jan-22	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2.882	0,00%	Selic		11-jan-22	6,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1.718	0,00%	Selic		21-jan-22	0,03%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	915	0,00%	Selic		14-jan-22	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	850	0,00%	Selic		04-jan-22	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	14	0,00%	Selic		04-jan-22	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	14.411	0,01%	Selic		31-jan-22	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.441	0,00%	Selic		06-jan-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	721	0,00%	Selic		14-jan-22	4,00%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	3.789.731	1,51%	Selic		04-jan-22	5,00%	0,05%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.911.834	0,76%	Selic		12-jan-22	5,00%	0,04%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.300.952	0,52%	Selic		12-jan-22	5,00%	0,04%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	984.199	0,39%	Selic		13-jan-22	4,00%	0,04%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	859.760	0,34%	Selic		05-jan-22	5,00%	0,05%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	407.255	0,16%	Selic		28-jan-22	0,02%	0,02%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	339.379	0,14%	Selic		28-jan-22	0,02%	0,02%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.522	0,00%	Selic		06-jan-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	144	0,00%	Selic		07-jan-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.108.086	0,44%	Selic		13-jan-22	6,00%	0,06%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	7.201	0,00%	Selic		11-jan-22	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	5.761	0,00%	Selic		12-jan-22	6,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	28.770	0,01%	Selic		18-jan-22	0,10%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	9.350	0,00%	Selic		14-jan-22	0,10%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	7.192	0,00%	Selic		07-jan-22	0,11%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	7.192	0,00%	Selic		11-jan-22	0,10%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.877	0,00%	Selic		06-jan-22	0,11%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	5.746	0,00%	Selic		14-jan-22	0,13%	0,13%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	4.310	0,00%	Selic		14-jan-22	0,13%	0,13%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	10.755	0,00%	Selic		31-jan-22	0,14%	0,14%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	7.170	0,00%	Selic		13-jan-22	0,16%	0,16%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	4.302	0,00%	Selic		14-jan-22	0,16%	0,16%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2026-03-01	01-mar-26	2.862	0,00%	Selic		21-jan-22	0,19%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	960.583	0,38%	IPCA		07-jan-22	5,58%	5,61%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	128.337	0,05%	IPCA		18-jan-22	5,99%	6,14%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	108.892	0,04%	IPCA		19-jan-22	6,12%	6,10%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	42.779	0,02%	IPCA		27-jan-22	6,76%	6,77%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.706.608	0,68%	IPCA		04-jan-22	5,66%	5,78%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	49.744	0,02%	IPCA		27-jan-22	6,18%	6,46%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	330.091	0,13%	IPCA		06-jan-22	5,43%	5,50%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	51.085	0,02%	IPCA		27-jan-22	5,50%	5,67%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	47.156	0,02%	IPCA		31-jan-22	5,67%	5,72%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	23.388	0,01%	IPCA		27-jan-22	5,37%	5,52%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	31.942	0,01%	IPCA		27-jan-22	5,29%	5,40%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	7.985	0,00%	IPCA		28-jan-22	5,37%	5,39%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	120.868	0,05%	IPCA		18-jan-22	5,58%	5,63%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-F 2031-01-01	01-jan-33	190.427	0,08%	PRE		07-jan-22	11,42%	11,38%	ATLANTIDA 2 FI MULT