

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 25/02/2022

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	116.989.701,61	100%										
Benchmark:	CDI					0,75%	2,26%	3,81%	1,49%	5,65%	8,15%	14,19%
Multiestatégia	116.989.701,61	100%			0,40%	0,99%	2,16%	3,57%	1,50%	5,22%	7,61%	17,15%
ATLANTIDA FI MULT	59.583.343,11	50,93%	ITAU	100%	0,27%	1,23%	2,27%	4,13%	1,65%	6,61%	10,18%	20,50%
ITAPEMA FI MULT	57.406.358,51	49,07%	TAG INVEST	100%	0,55%	0,75%	2,04%	2,99%	1,34%	3,88%	4,63%	13,32%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					1,35%	3,43%	8,09%	2,27%	15,54%	26,94%	37,95%
Total	116.987.125,31	100%			0,40%	0,99%	2,15%	3,56%	1,49%	5,16%	7,43%	16,72%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					1,35%	3,43%	8,09%	2,27%	15,54%	26,94%	37,95%

* 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.

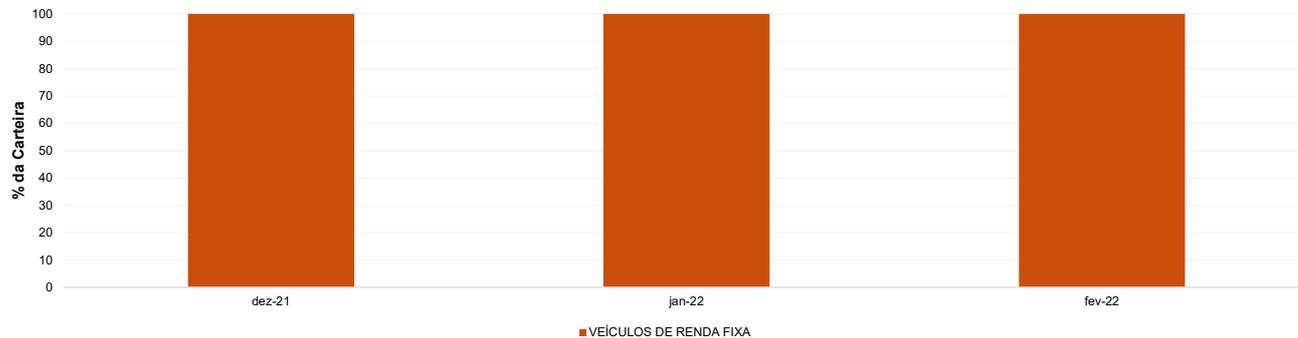
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

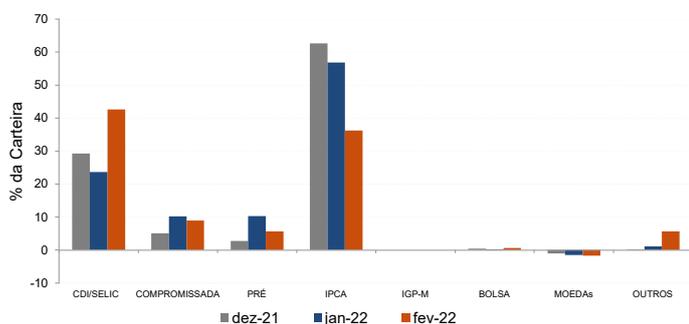
Distribuição da Carteira

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.

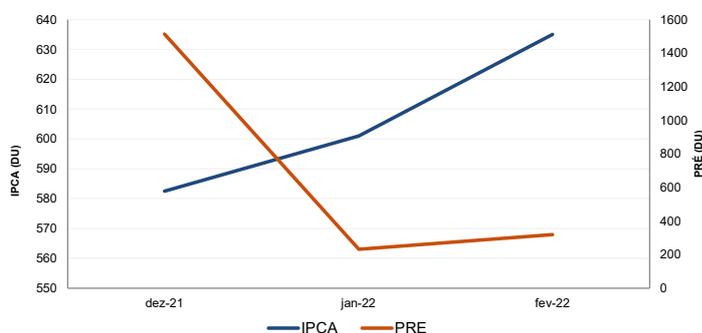
Evolução do Patrimônio Líquido



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	100,41	8,43	184,58	15,80
SUZB3	Madeira e Papel	85,54	7,18	100,59	8,61
ITUB4	Intermediários Financeiros	70,36	5,91	73,38	6,28
BOVA11	Fundos	65,90	5,53	86,26	7,39
BOVV11	Fundos	57,09	4,79	82,87	7,10
VALE3	Mineração	45,45	3,81	-26,05	-2,23
USIM5	Siderurgia e Metalurgia	43,22	3,63	38,57	3,30
LREN3	Comércio	42,06	3,53	31,18	2,67
ENGI11	Energia Elétrica	41,01	3,44	39,73	3,40
CPFE3	Energia Elétrica	38,96	3,27	41,35	3,54

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

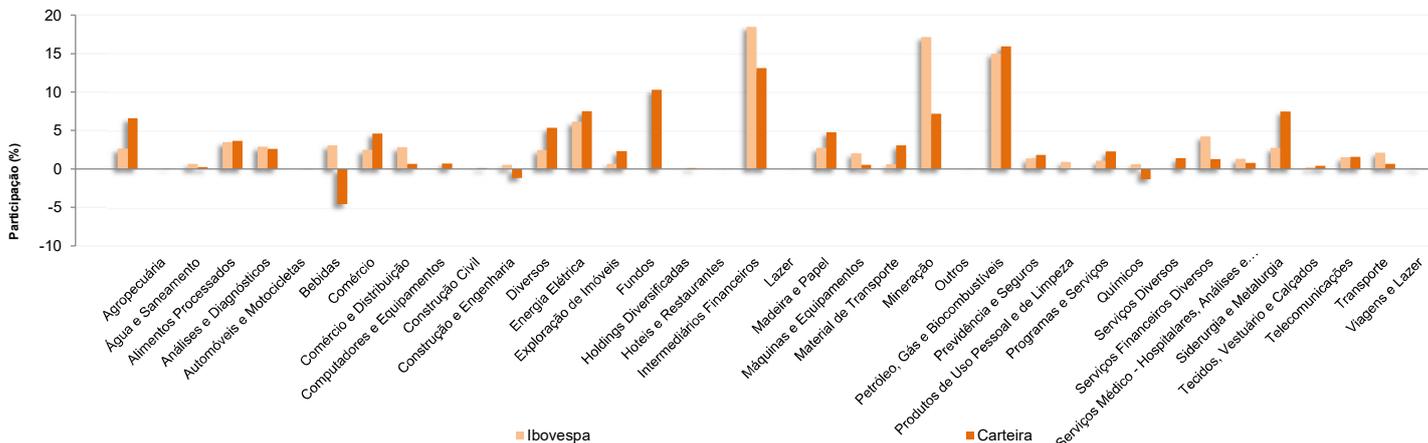
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PETR4	100,41	8,43	0,00	1
SUZB3	85,54	7,18	0,00	1
ITUB4	70,36	5,91	0,00	1
VALE3	45,45	3,81	0,00	1
USIM5	43,22	3,63	0,00	1
LREN3	42,06	3,53	0,00	1
ENGI11	41,01	3,44	0,00	1
CPFE3	38,96	3,27	0,00	1
BRAP4	38,69	3,25	0,00	1
EMBR3	35,34	2,97	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.



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.

Análises de Contrapartes

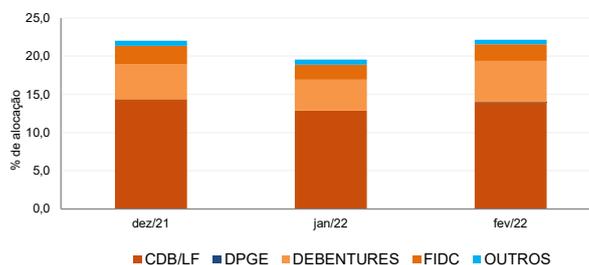
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	6.172,24	5,21	Faixa 1
BCO SAFRA SA	3.044,94	2,57	Faixa 1
BCO TOYOTA BRASIL SA	1.175,32	0,99	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.162,53	0,98	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	1.043,82	0,88	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	568,14	0,48	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	471,20	0,40	Faixa 1
PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	446,00	0,38	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	409,13	0,35	Faixa 1
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	361,53	0,31	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
BCBF16	1,29	BCBF PARTICIPACOES SA	Faixa 2	Faixa 1	07-out-27	CDI	1,45%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
HYPEA2	163,04	HYPERMARCAS SA	Sem Faixa	Faixa 1	04-fev-27	CDI	1,54%	ATLANTIDA FI MULT
IPIL11	44,53	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLIC	Sem Faixa	Faixa 2	15-dez-35	IPCA	7,38%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
MEAL11	0,47	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	6,45%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	0,00	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	7,75%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	0,39	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	8,52%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	0,20	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	9,55%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	2,63	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	5,07%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	0,20	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	4,30%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	0,53	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	2,84%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL12	0,23	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	4,30%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL12	0,23	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	4,54%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL12	0,44	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	4,47%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
MEAL12	0,03	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	17,74%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
MEAL12	0,07	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	16,20%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
MEAL21	0,78	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	8,81%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL21	1,12	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	8,82%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL21	0,18	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	8,82%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL21	0,20	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	7,19%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL21	0,29	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	6,75%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL21	0,71	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	6,95%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL21	0,03	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	17,44%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
MEZ511	120,17	MEZ 5 ENERGIA S.A.	Sem Faixa	Faixa 1	15-jan-46	IPCA	7,07%	ATLANTIDA FI MULT
PASN12	22,02	PARANAGUA SANEAMENTO SA	Faixa 2	Faixa 3	15-jul-30	IPCA	6,22%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
PASN12	53,66	PARANAGUA SANEAMENTO SA	Faixa 2	Faixa 3	15-jul-30	IPCA	8,08%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 25/02/2022

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
HYPEA2	04-fev-27	163.039	0,14%	CDI	HYPERMARCAS SA	04-fev-22	1,54%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	13-mai-24	200.900	0,17%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	11-fev-22	1,20%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	11-jun-24	150.675	0,13%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	11-fev-22	1,20%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	26-ago-24	50.045	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	23-fev-22	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	11-ago-25	100.493	0,08%	CDI	BCO SAFRA SA	10-fev-22	1,15%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	10-fev-27	150.752	0,13%	CDI	BCO SAFRA SA	10-fev-22	1,35%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
MEZ511	15-jan-46	120.169	0,10%	IPCA	MEZ 5 ENERGIA S.A.	17-fev-22	7,07%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
TAEEC1	15-jan-27	96.125	0,08%	CDI	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELET	01-fev-22	1,36%	Faixa 1	ATLANTIDA 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	524.384	0,44%	Selic	21-fev-22	0,01%	0,01%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	68.392	0,06%	Selic	15-fev-22	0,02%	0,02%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	16.727.276	14,13%	Selic	07-fev-22	5,00%	0,05%	ATLANTIDA FI MULT

