

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	126.469.951,55	100%										
Benchmark:	CDI					0,75%	2,26%	3,81%	1,49%	5,65%	8,15%	14,19%
Multiestatégia	126.469.951,55	100%		1,23%	0,56%	2,01%	1,99%	1,22%	3,05%	5,18%	14,47%	
ATLANTIDA 2 FI MULT	64.665.255,51	51,13%	ITAU	101,41%	1,56%	0,94%	2,09%	3,04%	1,39%	-	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	61.804.696,04	48,87%	TAG INVEST	98,57%	1,03%	0,19%	1,93%	0,93%	1,04%	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					1,42%	3,68%	8,60%	2,42%	16,65%	29,38%	41,93%
Total	126.469.126,58	100%		1,23%	0,56%	2,00%	1,97%	1,21%	3,20%	5,21%	15,78%	
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					1,42%	3,68%	8,60%	2,42%	16,65%	29,38%	41,93%

* 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.

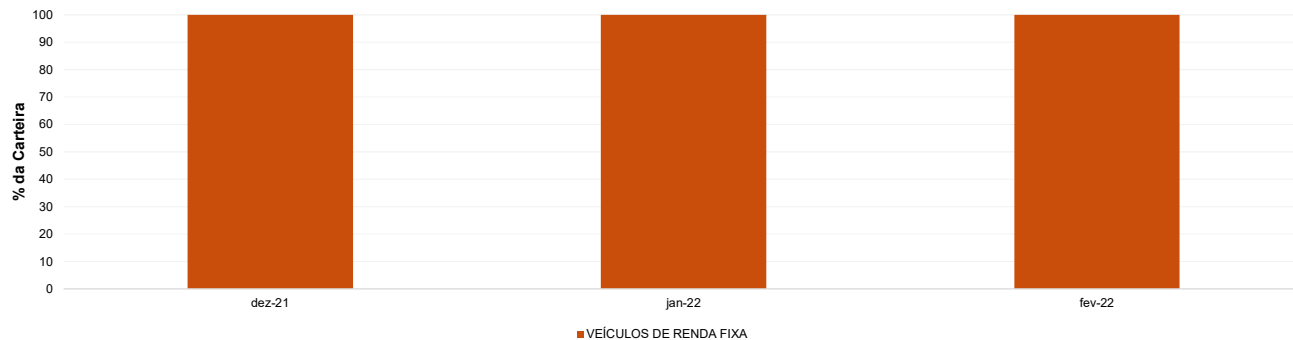
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

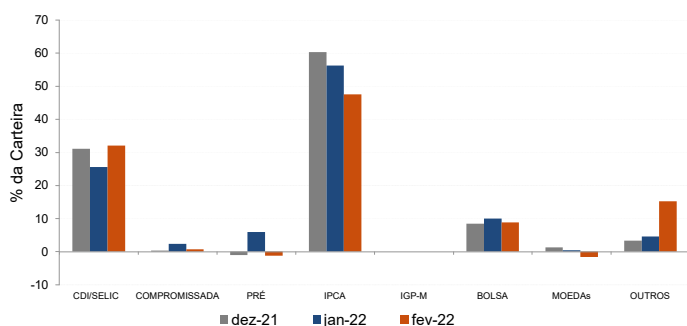
Distribuição da Carteira

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.

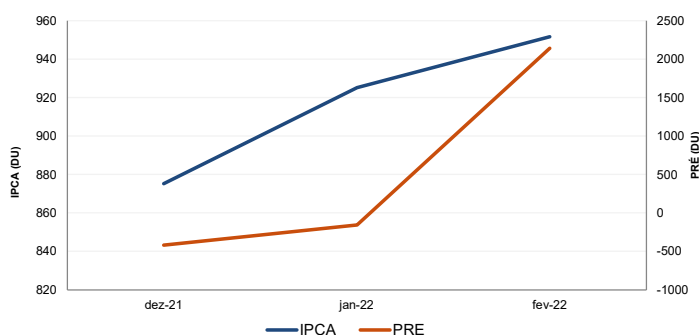
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
ENG11	Energia Elétrica	480,11	3,84	324,74	2,35
EQTL3	Energia Elétrica	445,62	3,57	289,66	2,10
CESP6	Energia Elétrica	431,00	3,45	248,46	1,80
CPFE3	Energia Elétrica	421,69	3,37	270,77	1,96
MULT3	Exploração de Imóveis	398,73	3,19	284,36	2,06
RAIL3	Transporte	342,61	2,74	277,96	2,01
IGTI11	Telecomunicações	341,10	2,73	226,30	1,64
BRML3	Exploração de Imóveis	328,84	2,63	225,29	1,63
ALUP11	Energia Elétrica	328,79	2,63	213,63	1,55
ELET3	Energia Elétrica	310,25	2,48	202,77	1,47

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

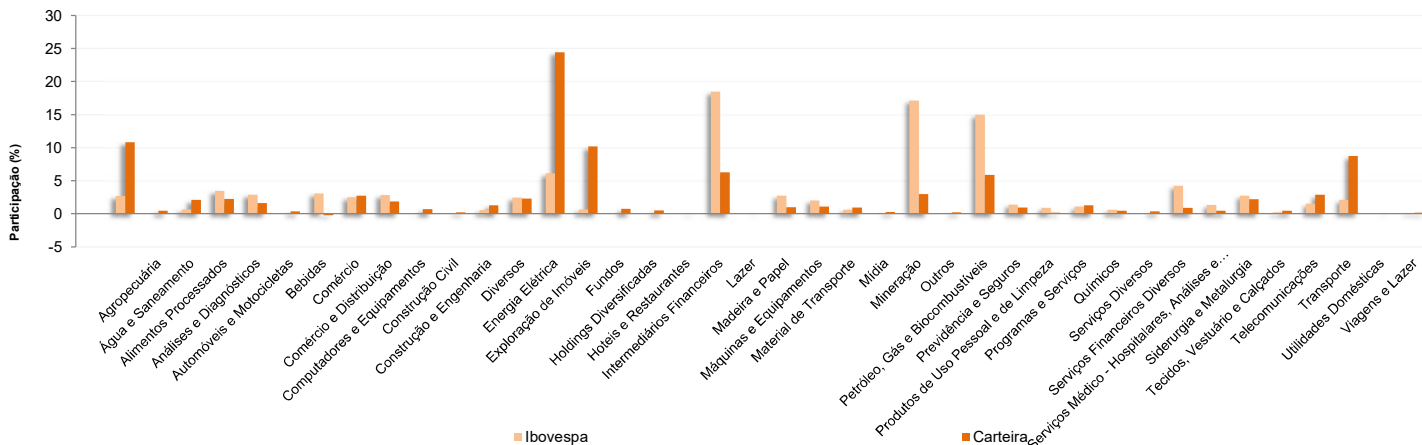
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
OMGE3	6,22	0,05	0,00	Sem Liquidez
LAME4	-0,43	0,00	0,00	Sem Liquidez
SCAR3	26,60	0,21	0,00	2
BAUH4	19,36	0,15	0,02	2
CRPG6	8,29	0,07	0,00	2
ENG11	480,11	3,84	0,00	1
EQTL3	445,62	3,57	0,00	1
CESP6	431,00	3,45	0,01	1
CPFE3	421,69	3,37	0,01	1
MULT3	398,73	3,19	0,01	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.



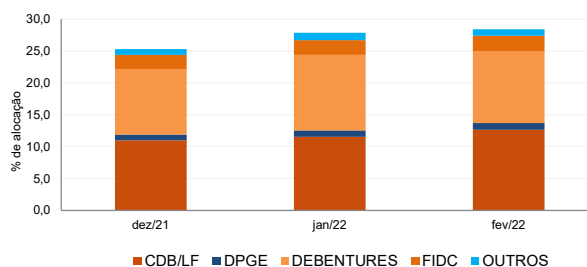
Análises de Contrapartes

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	4.237,15	3,41	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	3.018,44	2,43	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.693,52	2,17	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.330,23	1,07	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.121,61	0,90	Faixa 1
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.096,88	0,88	Faixa 4
CIA LOCAÇÃO AMERICAS	960,03	0,77	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	778,23	0,63	Faixa 1
ENERGISA SA	746,50	0,60	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	593,23	0,48	Faixa 1

* 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	1,92	BCBF PARTICIPACOES SA	Faixa 2	Faixa 1	07-out-27	CDI	1,45%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
HYPEA2	180,47	HYPERMARCAS SA	Sem Faixa	Faixa 1	04-fev-27	CDI	1,54%	ATLANTIDA 2 FI MULT
IPIL11	83,52	IP SUL CONCESSIONÁRIA DE ILUMINAÇÃO PÚBLIC	Sem Faixa	Faixa 2	15-dez-35	IPCA	7,38%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
MEAL11	0,69	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	6,45%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	0,01	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	7,75%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	0,57	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	8,52%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	0,30	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	9,55%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	3,88	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	5,07%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	0,30	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	4,30%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL11	0,78	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-24	CDI	2,84%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL12	0,10	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	16,20%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
MEAL12	0,04	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	17,74%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
MEAL12	0,34	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	4,30%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL12	0,34	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	4,54%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL12	0,66	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	4,47%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
MEAL21	0,42	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	6,75%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL21	1,05	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	6,95%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL21	0,04	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	17,44%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
MEAL21	1,14	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	8,81%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL21	1,65	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	8,82%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL21	0,26	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	8,82%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEAL21	0,29	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO S	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	7,19%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MEZ511	132,31	MEZ 5 ENERGIA S.A.	Sem Faixa	Faixa 1	15-jan-46	IPCA	7,07%	ATLANTIDA 2 FI MULT
PASN12	41,31	PARANAGUA SANEAMENTO SA	Faixa 2	Faixa 3	15-jul-30	IPCA	6,22%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
PASN12	100,64	PARANAGUA SANEAMENTO SA	Faixa 2	Faixa 3	15-jul-30	IPCA	8,08%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	180.467	0,15%	CDI	HYPERMARCAS SA	04-fev-22	1,54%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	13-mai-24	203.733	0,16%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	11-fev-22	1,20%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	11-jun-24	152.800	0,12%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	11-fev-22	1,20%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	26-ago-24	50.750	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	23-fev-22	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	11-ago-25	101.910	0,08%	CDI	BCO SAFRA SA	10-fev-22	1,15%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	10-fev-27	152.878	0,12%	CDI	BCO SAFRA SA	10-fev-22	1,35%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
MEZ511	15-jan-46	132.309	0,11%	IPCA	MEZ 5 ENERGIA S.A.	17-fev-22	7,07%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
TAEEC1	15-jan-27	106.050	0,09%	CDI	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELET	01-fev-22	1,36%	Faixa 1	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	855.393	0,69%	Selic		15-fev-22	0,02%	0,02%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	543.290	0,44%	Selic		25-fev-22	0,01%	0,01%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	2.911.931	2,34%	Selic		07-fev-22	5,00%	0,05%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	127.891	0,10%	IPCA		09-fev-22	6,93%	7,15%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	15.745	0,01%	IPCA		15-fev-22	6,47%	6,33%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	90.038	0,07%	IPCA		16-fev-22	5,61%	5,63%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	3.915	0,00%	IPCA		15-fev-22	5,74%	5,61%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	114.871	0,09%	IPCA		15-fev-22	5,41%	5,31%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	47.533	0,04%	IPCA		16-fev-22	5,32%	5,35%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	11.883	0,01%	IPCA		15-fev-22	5,41%	5,31%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	114.969	0,09%	IPCA		15-fev-22	5,49%	5,45%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	51.538	0,04%	IPCA		16-fev-22	5,44%	5,45%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	269.980	0,22%	IPCA		15-fev-22	5,57%	5,53%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	95.287	0,08%	IPCA		16-fev-22	5,52%	5,53%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	3.970	0,00%	IPCA		15-fev-22	5,60%	5,53%	ATLANTIDA 2 FI MULT

