

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/03/2022

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	115.016.329,61	100%										
Benchmark:	CDI					0,92%	2,42%	4,31%	2,42%	6,41%	8,78%	14,71%
Multiestatégia	115.016.329,61	100%			0,70%	1,84%	3,37%	4,66%	3,37%	6,83%	11,53%	18,64%
ATLANTIDA FI MULT	58.542.719,11	50,90%	ITAU	100%	0,69%	1,74%	3,42%	4,88%	3,42%	8,05%	13,35%	21,97%
ITAPEMA FI MULT	56.473.610,50	49,10%	TAG INVEST	100%	0,81%	1,93%	3,30%	4,43%	3,30%	5,67%	9,34%	14,81%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					2,01%	4,32%	8,60%	4,32%	16,31%	28,91%	39,21%
Total	115.013.328,97	100%			0,70%	1,83%	3,35%	4,65%	3,35%	6,82%	11,45%	18,24%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					2,01%	4,32%	8,60%	4,32%	16,31%	28,91%	39,21%

* 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.

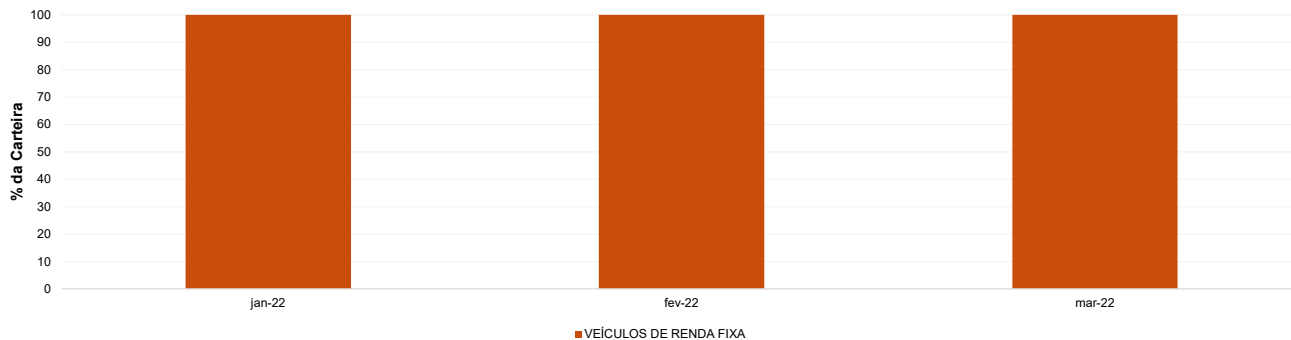
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

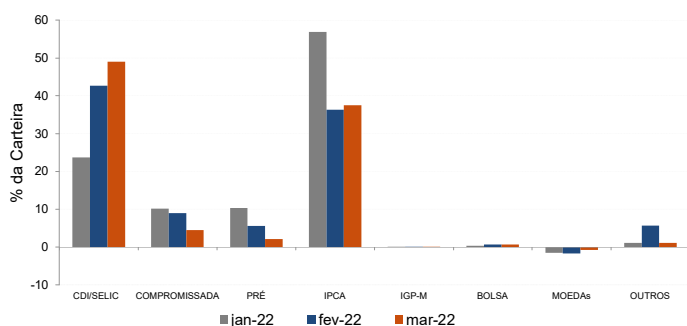
Distribuição da Carteira

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.

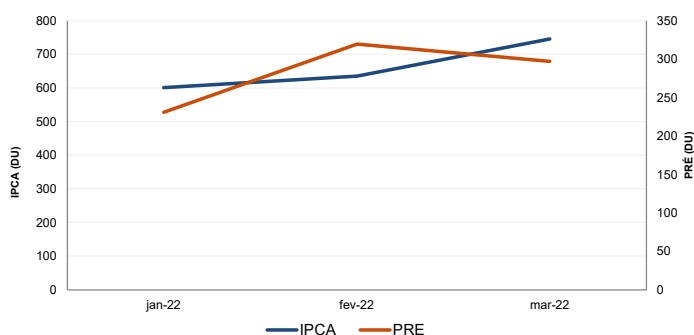
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
ITUB4	Intermediários Financeiros	90,71	7,53	70,36	5,91
SUZB3	Madeira e Papel	85,25	7,07	85,54	7,18
BOVA11	Fundos	80,16	6,65	65,90	5,53
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	75,82	6,29	100,41	8,43
BOVV11	Fundos	72,04	5,98	57,09	4,79
VALE3	Mineração	50,28	4,17	45,45	3,81
ASAI3	Comércio e Distribuição	46,36	3,85	19,10	1,60
ENG11	Energia Elétrica	46,29	3,84	41,01	3,44
ARZZ3	Comércio	38,79	3,22	22,70	1,90
DIRR3	Construção e Engenharia	34,31	2,85	34,98	2,94

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

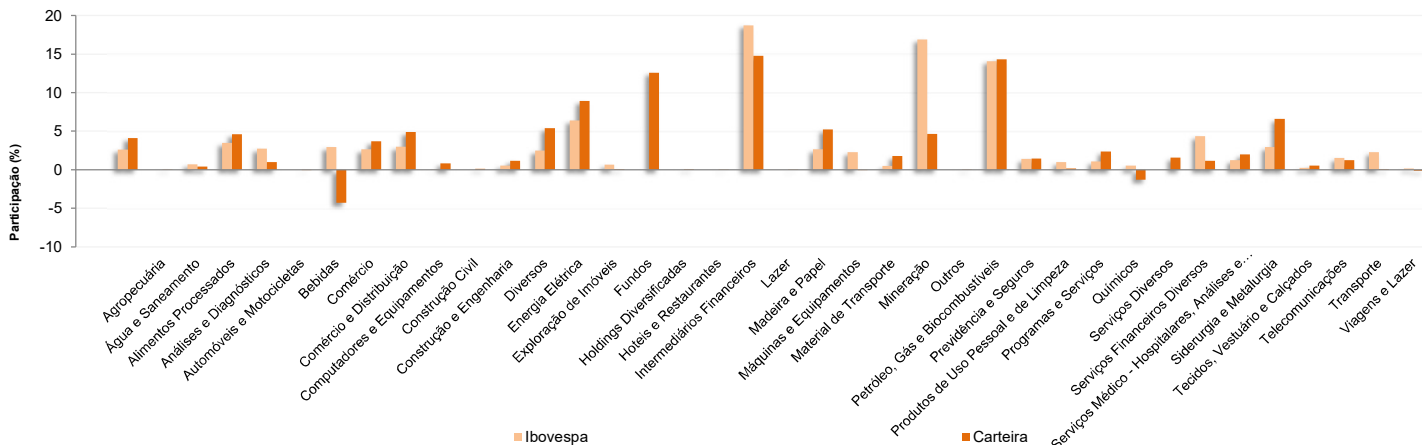
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
GNDI3	1,51	0,12	0,00	Sem Liquidez
AMER1	0,03	0,00	0,00	Sem Liquidez
ITUB4	90,71	7,53	0,00	1
SUZB3	85,25	7,07	0,00	1
PETR4	75,82	6,29	0,00	1
VALE3	50,28	4,17	0,00	1
ASAI3	46,36	3,85	0,00	1
ENG11	46,29	3,84	0,00	1
ARZZ3	38,79	3,22	0,00	1
DIRR3	34,31	2,85	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.

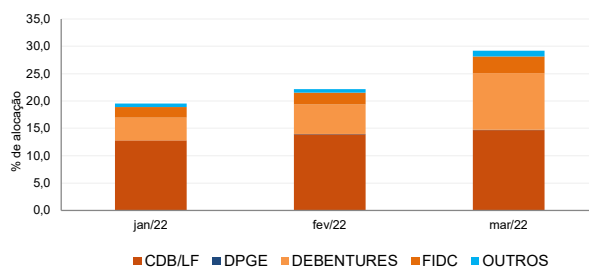
Análises de Contrapartes

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	6.416,35	5,59	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	2.782,87	2,42	Faixa 1
BCO SAFRA SA	1.301,91	1,13	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.158,23	1,01	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	724,53	0,63	Faixa 1
BCO TOYOTA BRASIL SA	723,88	0,63	Faixa 1
APICE SECURITIZADORA IMOBILIARIA SA	577,14	0,50	Sem Faixa
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	569,16	0,50	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	476,06	0,41	Faixa 1
PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	466,07	0,41	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
ARTRA1	160,38	ARTERIS SA	Sem Faixa	Faixa 2	11-mar-27	CDI	1,77%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
ARTRA1	149,53	ARTERIS SA	Sem Faixa	Faixa 2	11-mar-27	CDI	1,66%	ATLANTIDA FI MULT
ARTRA1	24,27	ARTERIS SA	Sem Faixa	Faixa 2	11-mar-27	CDI	1,77%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
ARTRA1	27,15	ARTERIS SA	Sem Faixa	Faixa 2	11-mar-27	CDI	1,66%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
ECHP11	0,14	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	Faixa 3	Faixa 2	15-jun-30	IPCA	5,27%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
ECHP13	0,75	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	Faixa 3	Faixa 2	30-jul-24	CDI	2,20%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
ELDC14	13,70	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	Faixa 3	Faixa 2	20-set-24	CDI	3,00%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
ELDC14	12,79	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	Faixa 3	Faixa 2	20-set-24	CDI	2,43%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
ELDC14	10,10	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	Faixa 3	Faixa 2	20-set-24	CDI	2,47%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
ELDC14	8,78	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	Faixa 3	Faixa 2	20-set-24	CDI	2,55%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
ELDC14	3,78	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	Faixa 3	Faixa 2	20-set-24	CDI	3,00%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
MILS26	167,49	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS ENGENHARIA SA	Sem Faixa	Faixa 3	18-mar-27	CDI	3,13%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
RLOG11	12,67	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,02%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
RLOG11	2,52	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,32%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
RLOG11	1,73	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,27%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
RLOG11	1,77	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,30%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
RLOG11	0,64	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,04%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
RLOG11	0,06	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,01%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
RLOG11	0,01	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,02%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
VIXL14	4,54	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-26	CDI	3,21%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
VIXL14	4,43	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-26	CDI	2,60%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
VIXL14	9,01	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-26	CDI	2,04%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
VIXL14	4,17	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-26	CDI	2,60%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
VIXL14	46,07	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-26	CDI	2,75%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
VIXL15	60,88	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-26	CDI	2,20%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
VIXL15	3,93	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-26	CDI	2,20%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
VIXL25	6,91	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-28	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
VIXL35	3,28	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-26	CDI	2,23%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
VIXL45	7,06	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-28	CDI	2,53%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
VIXL45	54,40	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-28	CDI	2,42%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/03/2022

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
ALSO15	15-mar-27	7.367	0,01%	CDI	ALIANSCOE SONAE SHOPPING CENTERS S	25-mar-22	1,43%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
ALSO25	15-mar-29	38.861	0,03%	CDI	ALIANSCOE SONAE SHOPPING CENTERS S	25-mar-22	1,55%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
ARTRA1	11-mar-27	149.534	0,13%	CDI	ARTERIS SA	24-mar-22	1,66%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	25-mar-24	50.096	0,04%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	25-mar-22	1,10%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	09-abr-24	100.192	0,09%	CDI	BANCO CSF SA	25-mar-22	1,05%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	24-mar-25	250.722	0,22%	CDI	BCO SAFRA SA	23-mar-22	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	29-mar-26	100.097	0,09%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	29-mar-22	1,25%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	17-set-27	1.708.393	1,49%	CDI	BCO BRADESCO SA	17-mar-22	1,40%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LORTA9	25-fev-27	8.584	0,01%	CDI	LOCALIZA RENT A CAR SA	11-mar-22	1,60%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LORTB9	25-fev-29	9.996	0,01%	CDI	LOCALIZA RENT A CAR SA	11-mar-22	2,00%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
SBSPH0	15-mar-29	11.890	0,01%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	18-mar-22	1,58%	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	34.515	0,03%	Selic		08-mar-22	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	885.874	0,77%	Selic		18-mar-22	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	460.194	0,40%	Selic		30-mar-22	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	833.608	0,73%	IPCA		07-mar-22	5,85%	5,90%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	254.052	0,22%	IPCA		18-mar-22	5,75%	5,54%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	246.113	0,21%	IPCA		25-mar-22	5,17%	4,97%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	154.813	0,13%	IPCA		22-mar-22	5,51%	5,40%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	138.935	0,12%	IPCA		11-mar-22	5,80%	5,79%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	119.087	0,10%	IPCA		10-mar-22	5,76%	5,77%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	79.391	0,07%	IPCA		21-mar-22	5,66%	5,49%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	39.696	0,03%	IPCA		02-mar-22	5,82%	5,75%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	230.544	0,20%	IPCA		30-mar-22	5,28%	5,36%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	36.402	0,03%	IPCA		02-mar-22	5,65%	5,68%	ATLANTIDA FI MULT

