

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	129.766.168,38	100%										
Benchmark:	CDI					0,92%	2,42%	4,31%	2,42%	6,41%	8,78%	14,71%
Multiestatégia	129.766.168,38	100%			1,74%	2,74%	3,99%	4,87%	3,99%	5,56%	10,01%	16,96%
ATLANTIDA 2 FI MULT	66.631.922,69	51,35%	ITAU	101,41%	2,03%	3,22%	4,65%	6,26%	4,65%	-	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	63.134.245,69	48,65%	TAG INVEST	98,56%	1,60%	2,25%	3,31%	3,45%	3,31%	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					2,10%	4,57%	9,11%	4,57%	17,42%	31,38%	43,24%
Total	129.765.380,17	100%			1,74%	2,74%	3,99%	4,85%	3,99%	5,58%	10,09%	18,47%
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					2,10%	4,57%	9,11%	4,57%	17,42%	31,38%	43,24%

* 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.

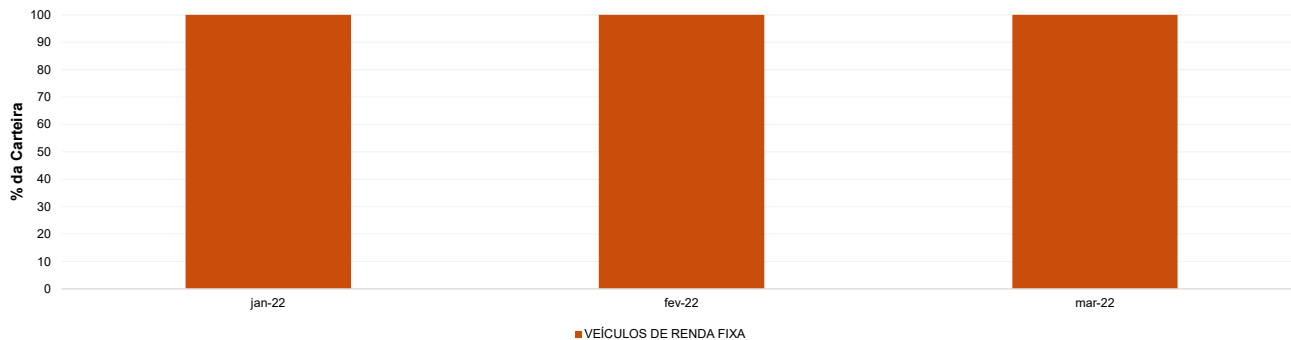
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

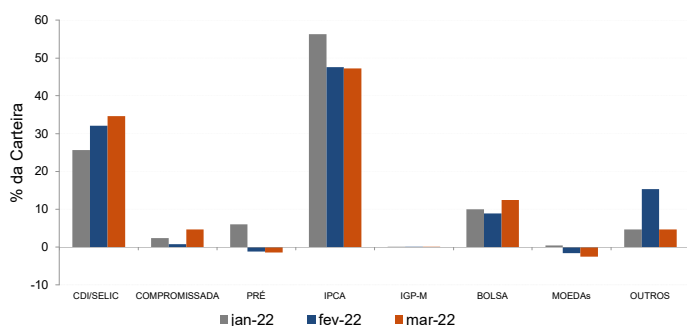
Distribuição da Carteira

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.

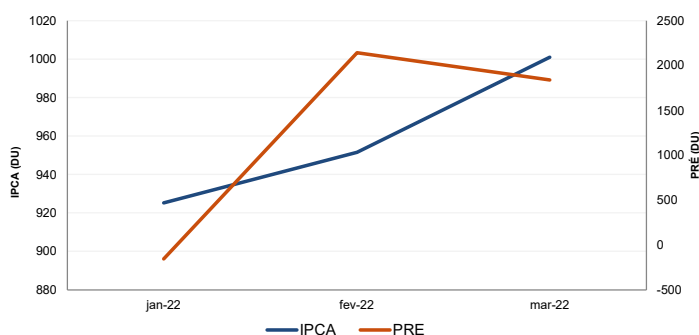
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
ENGI11	Energia Elétrica	651,36	3,85	480,11	3,84
EQTL3	Energia Elétrica	595,81	3,52	445,62	3,57
VALE3	Mineração	565,06	3,34	299,19	2,39
MULT3	Exploração de Imóveis	454,56	2,69	398,73	3,19
AURE3	Fundos	444,75	2,63	0,00	
CPFE3	Energia Elétrica	430,42	2,54	421,69	3,37
ITUB4	Intermediários Financeiros	411,29	2,43	240,54	1,92
RAIL3	Transporte	407,41	2,41	342,61	2,74
IGTI11	Telecomunicações	396,17	2,34	341,10	2,73
ELET3	Energia Elétrica	392,32	2,32	310,25	2,48

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

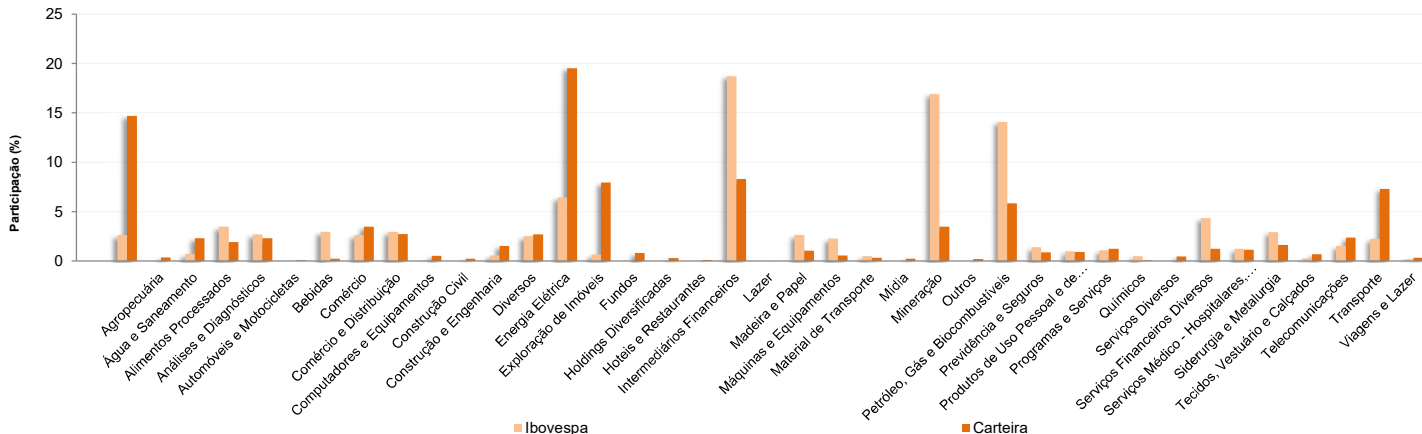
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
AMER1	0,03	0,00	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	18,82	0,11	0,02	3
SCAR3	28,60	0,17	0,00	2
MTSA4	21,85	0,13	0,02	2
ENGI11	651,36	3,85	0,01	1
EQTL3	595,81	3,52	0,00	1
VALE3	565,06	3,34	0,00	1
MULT3	454,56	2,69	0,01	1
AURE3	444,75	2,63	0,00	1
CPFE3	430,42	2,54	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.



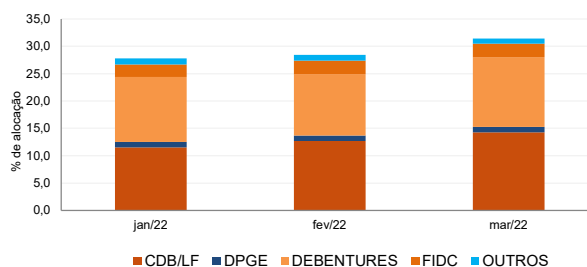
Análises de Contrapartes

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 BRADESCO SA	4.764,83	3,73	Faixa 1
BCO ITAU SA	4.418,35	3,46	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.747,56	2,15	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.292,07	1,01	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.133,21	0,89	Faixa 1
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.108,68	0,87	Faixa 4
CIA LOCAÇÃO AMERICAS	1.094,64	0,86	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	930,79	0,73	Faixa 1
ENERGISA SA	859,91	0,67	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	838,56	0,66	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	Veiculo
ARTRA1	67,27	ARTERIS SA	Sem Faixa	Faixa 2	11-mar-27	CDI	1,77%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
ARTRA1	160,29	ARTERIS SA	Sem Faixa	Faixa 2	11-mar-27	CDI	1,77%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
ARTRA1	21,12	ARTERIS SA	Sem Faixa	Faixa 2	11-mar-27	CDI	1,66%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
ARTRA1	162,40	ARTERIS SA	Sem Faixa	Faixa 2	11-mar-27	CDI	1,66%	ATLANTIDA 2 FI MULT
ECHP11	0,22	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	Faixa 3	Faixa 2	15-jun-30	IPCA	5,27%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
ECHP13	1,12	ECHOENERGIA PARTICIPACOES SA	Faixa 3	Faixa 2	30-jul-24	CDI	2,20%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
ELDC14	10,66	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	Faixa 3	Faixa 2	20-set-24	CDI	3,00%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
ELDC14	9,95	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	Faixa 3	Faixa 2	20-set-24	CDI	2,43%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
ELDC14	5,57	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	Faixa 3	Faixa 2	20-set-24	CDI	3,00%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
ELDC14	7,86	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	Faixa 3	Faixa 2	20-set-24	CDI	2,47%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
ELDC14	6,83	ELDORADO BRASIL CELULOSE SA	Faixa 3	Faixa 2	20-set-24	CDI	2,55%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
MILS26	167,40	MILLS ESTRUTURAS SERVICOS ENGENHARIA SA	Sem Faixa	Faixa 3	18-mar-27	CDI	3,13%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
RLOG11	0,95	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,04%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
RLOG11	0,09	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,01%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
RLOG11	0,02	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,02%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
RLOG11	9,86	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,02%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
RLOG11	1,96	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,32%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
RLOG11	1,35	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,27%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
RLOG11	1,37	COSAN LOGISTICA SA	Faixa 2	Faixa 1	25-ago-25	CDI	2,30%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
VIXL14	12,58	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-26	CDI	3,21%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
VIXL14	3,45	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-26	CDI	2,60%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
VIXL14	7,01	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-26	CDI	2,04%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
VIXL14	6,14	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-26	CDI	2,60%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
VIXL14	46,04	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-26	CDI	2,75%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
VIXL15	60,85	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-26	CDI	2,20%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
VIXL15	10,90	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-26	CDI	2,20%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
VIXL25	5,37	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-28	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
VIXL35	9,09	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-26	CDI	2,23%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
VIXL45	5,50	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-28	CDI	2,53%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
VIXL45	42,33	VIX LOGISTICA SA	Faixa 3	Faixa 2	26-out-28	CDI	2,42%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	8.538	0,01%	CDI	ALIANSCOE SONAE SHOPPING CENTERS S	25-mar-22	1,43%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
ALSO25	15-mar-29	42.694	0,03%	CDI	ALIANSCOE SONAE SHOPPING CENTERS S	25-mar-22	1,55%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
ARTRA1	11-mar-27	162.402	0,13%	CDI	ARTERIS SA	24-mar-22	1,66%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	25-mar-24	50.804	0,04%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	25-mar-22	1,10%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	18-mar-25	101.707	0,08%	CDI	BANCO CSF SA	23-mar-22	1,15%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	29-mar-26	101.511	0,08%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	29-mar-22	1,25%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	17-set-27	1.579.655	1,24%	CDI	BCO BRADESCO SA	17-mar-22	1,40%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LORTA9	25-fev-27	9.793	0,01%	CDI	LOCALIZA RENT A CAR SA	11-mar-22	1,60%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LORTB9	25-fev-29	11.263	0,01%	CDI	LOCALIZA RENT A CAR SA	11-mar-22	2,00%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
SBSPH0	15-mar-29	49.327	0,04%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	18-mar-22	1,58%	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	5.086.973	3,98%	Selic		29-mar-22	0,00%	0,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	966.152	0,76%	IPCA		21-mar-22	5,66%	5,49%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	370.358	0,29%	IPCA		25-mar-22	5,17%	4,97%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	40.256	0,03%	IPCA		18-mar-22	5,75%	5,54%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	16.103	0,01%	IPCA		21-mar-22	5,66%	5,49%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	352.752	0,28%	IPCA		30-mar-22	5,28%	5,36%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	37.096	0,03%	IPCA		04-mar-22	5,75%	5,80%	ATLANTIDA 2 FI MULT

