

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 29/04/2022

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	114.617.440,41	100%										
Benchmark:	CDI					0,83%	2,53%	4,68%	3,28%	7,08%	9,38%	15,07%
Multiestatégia	114.617.440,41	100%			0,53%	1,03%	3,91%	6,53%	4,43%	7,65%	12,72%	18,85%
ATLANTIDA FI MULT	58.681.998,65	51,20%	ITAU	100%	0,40%	1,29%	4,32%	6,80%	4,75%	9,04%	14,75%	22,41%
ITAPEMA FI MULT	55.935.441,76	48,80%	TAG INVEST	100%	0,72%	0,76%	3,47%	6,25%	4,08%	6,30%	10,32%	14,78%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					1,40%	4,83%	8,38%	5,78%	17,16%	30,66%	39,84%
Total	114.614.424,51	100%			0,53%	1,02%	3,89%	6,51%	4,41%	7,63%	12,46%	18,50%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					1,40%	4,83%	8,38%	5,78%	17,16%	30,66%	39,84%

* 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.

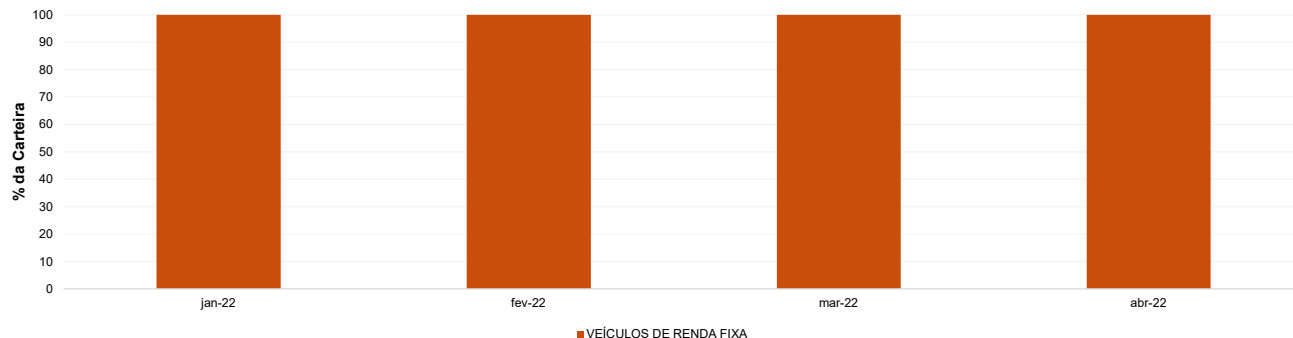
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

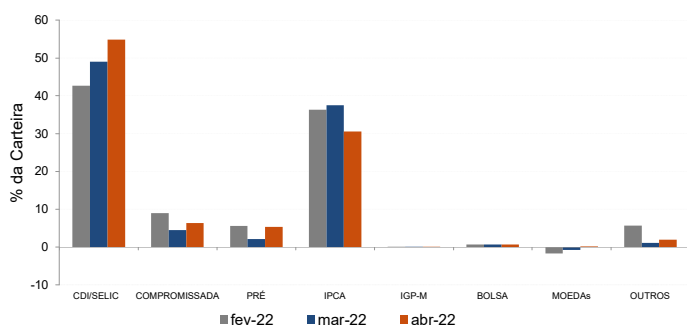
Distribuição da Carteira

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.

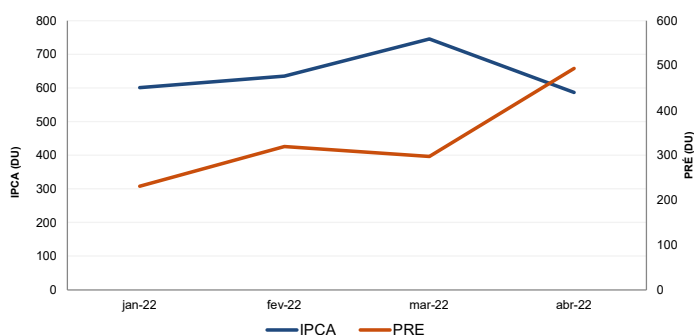
Evolução do Patrimônio Líquido



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	88,91	6,13	75,82	6,29
ASAI3	Comércio e Distribuição	73,23	5,05	46,36	3,85
BOVA11	Fundos	72,87	5,03	80,16	6,65
ITUB4	Intermediários Financeiros	64,99	4,48	90,71	7,53
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	53,33	3,68	19,76	1,64
SUZB3	Madeira e Papel	52,83	3,64	85,25	7,07
SBSP3	Água e Saneamento	52,28	3,61	33,37	2,77
VALE3	Mineração	52,20	3,60	50,28	4,17
EQTL3	Energia Elétrica	52,00	3,59	3,01	0,25
BBDC4	Intermediários Financeiros	48,42	3,34	9,33	0,77

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

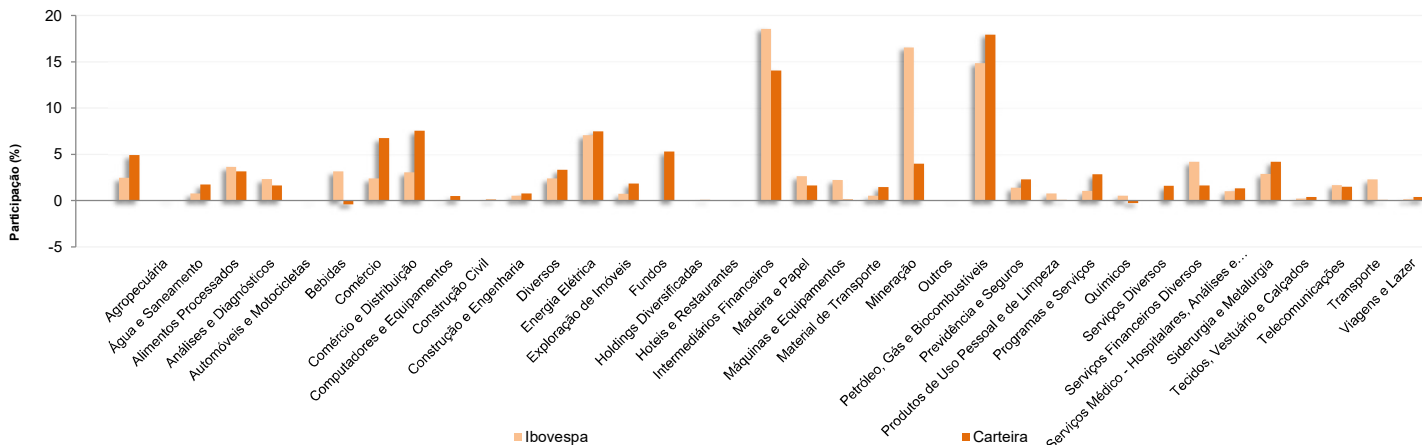
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PETR4	88,91	6,13	0,00	1
ASAI3	73,23	5,05	0,00	1
ITUB4	64,99	4,48	0,00	1
PETR3	53,33	3,68	0,00	1
SUZB3	52,83	3,64	0,00	1
SBSP3	52,28	3,61	0,00	1
VALE3	52,20	3,60	0,00	1
EQTL3	52,00	3,59	0,00	1
BBDC4	48,42	3,34	0,00	1
HYPE3	47,88	3,30	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.



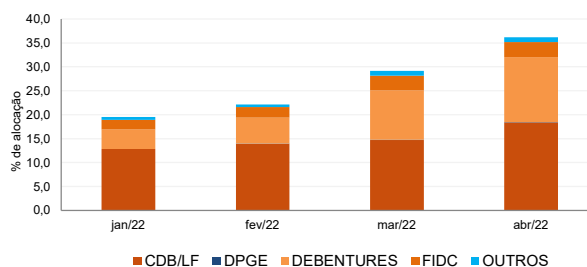
Análises de Contrapartes

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	6.661,56	5,79	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	3.926,37	3,42	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.172,47	1,89	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.164,54	1,01	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	761,87	0,66	Faixa 1
BCO TOYOTA BRASIL SA	730,60	0,64	Faixa 1
BANCO CSF SA	595,86	0,52	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	569,13	0,50	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	534,99	0,47	Faixa 2
APICE SECURITIZADORA IMOBILIARIA SA	513,24	0,45	Sem Faixa

* 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
CMDT33	0,81	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	6,71%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
CMDT33	1,61	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	6,71%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
CMDT33	0,36	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	6,58%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
CTEEA2	100,82	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELETRICA PA	Sem Faixa	Faixa 1	15-abr-29	CDI	1,55%	ATLANTIDA FI MULT
DESK13	8,47	DESKTOP S.A.	Sem Faixa	Faixa 3	17-nov-28	CDI	2,71%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
DESK13	37,21	DESKTOP S.A.	Sem Faixa	Faixa 3	17-nov-28	CDI	2,60%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
DESK13	8,98	DESKTOP S.A.	Sem Faixa	Faixa 3	17-nov-28	CDI	2,60%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
DESK13	26,71	DESKTOP S.A.	Sem Faixa	Faixa 3	17-nov-28	CDI	2,52%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
DESK13	51,41	DESKTOP S.A.	Sem Faixa	Faixa 3	17-nov-28	CDI	2,57%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
IRJS12	50,47	IGUÁ RIO DE JANEIRO S.A.	Sem Faixa	Faixa 3	31-jul-25	CDI	3,80%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
LMTI15	30,55	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	2,60%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
LMTI15	8,74	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	2,22%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
LMTI15	38,86	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	2,67%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LMTI15	93,48	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	3,44%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LMTI15	17,40	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	2,20%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
LMTI15	17,33	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	2,67%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LMTI15	0,31	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	3,40%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LMTI15	0,93	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	3,33%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LMTI15	2,21	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	3,33%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LMTI15	2,86	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	3,33%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LMTI15	1,03	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	3,37%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
LMTI15	2,36	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	3,37%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
TFLEB0	15,30	LOCALIZA FLEET SA	Sem Faixa	Faixa 1	05-abr-28	CDI	1,82%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
VCCS11	62,06	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA C	Sem Faixa	Faixa 1	16-abr-29	CDI	1,95%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
VCCS11	19,07	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA C	Sem Faixa	Faixa 1	16-abr-29	CDI	1,99%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
VCCS11	14,39	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA C	Sem Faixa	Faixa 1	16-abr-29	CDI	1,95%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 29/04/2022

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
BKBR19	24-abr-27	86.092	0,07%	CDI	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA REE	28-abr-22	1,90%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
CEEBA4	15-abr-27	56.405	0,05%	CDI	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COEL	20-abr-22	1,55%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CEEBA4	15-abr-29	56.308	0,05%	CDI	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COEL	20-abr-22	1,68%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CEPEA2	15-abr-27	56.405	0,05%	CDI	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	20-abr-22	1,55%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CEPEB2	15-abr-29	55.225	0,05%	CDI	CIA ENERGETICA PERNAMBUCO CELPE	20-abr-22	1,68%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CTEEA2	15-abr-29	100.822	0,09%	CDI	CTEEP CIA TRANSMISSAO ENERGIA ELE	18-abr-22	1,55%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
IOCHB1	15-abr-27	161.270	0,14%	CDI	IOCHPE MAXION SA	29-abr-22	2,62%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	22-abr-24	100.289	0,09%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	20-abr-22	1,10%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	13-out-24	100.486	0,09%	CDI	BANCO YAMAHA MOTOR BRASIL S.A.	13-abr-22	1,20%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	22-abr-25	651.877	0,57%	CDI	BCO SAFRA SA	20-abr-22	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	29-abr-25	100.096	0,09%	CDI	BANCO CSF SA	27-abr-22	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	21-jul-25	200.579	0,17%	CDI	BCO SAFRA SA	20-abr-22	1,12%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	13-out-25	100.492	0,09%	CDI	BANCO YAMAHA MOTOR BRASIL S.A.	13-abr-22	1,35%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	12-abr-27	905.507	0,79%	CDI	BCO BRADESCO SA	12-abr-22	3,00%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
MVLV19	05-abr-27	40.083	0,03%	CDI	MOVIDA LOCACAO VEICULOS SA	05-abr-22	2,95%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2024-03-01	01-mar-24	69.461	0,06%	Selic		18-abr-22	0,08%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	12.222	0,01%	IPCA		04-abr-22	5,35%	5,18%	ATLANTIDA FI MULT