

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/05/2022

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	115.152.197,27	100%										
Benchmark:	CDI					1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%
Multiestatégia	115.152.197,27	100%			0,27%	0,95%	3,86%	6,11%	5,42%	8,11%	13,09%	18,56%
ATLANTIDA FI MULT	59.225.662,39	51,43%	ITAU	100%	0,20%	0,93%	4,01%	6,37%	5,73%	9,41%	15,18%	22,16%
ITAPEMA FI MULT	55.926.534,87	48,57%	SUL AMERICA	100%	0,38%	0,98%	3,71%	5,82%	5,10%	6,77%	10,63%	14,46%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					0,86%	4,32%	7,90%	6,69%	16,76%	31,82%	40,31%
Total	115.149.179,44	100%			0,27%	0,95%	3,85%	6,08%	5,40%	8,07%	12,87%	18,26%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					0,86%	4,32%	7,90%	6,69%	16,76%	31,82%	40,31%

* 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.

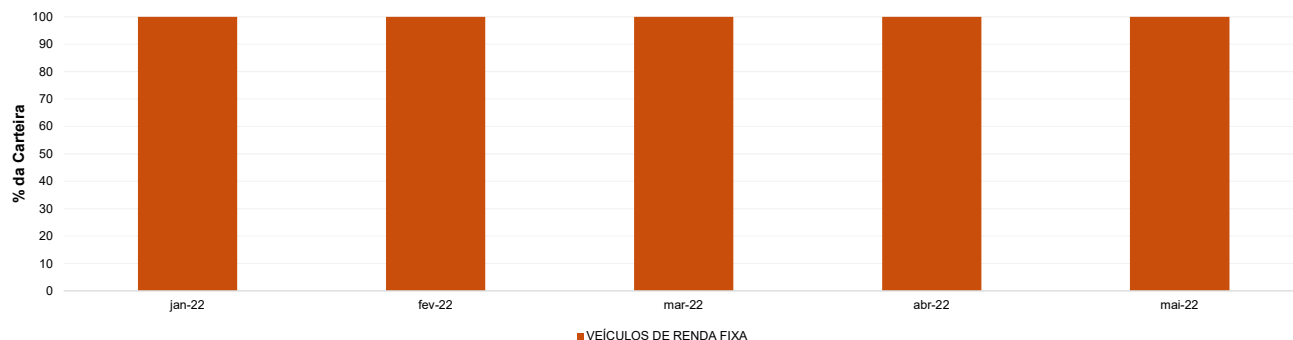
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

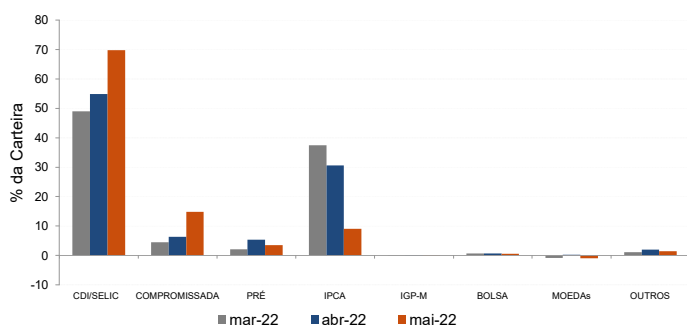
Distribuição da Carteira

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.

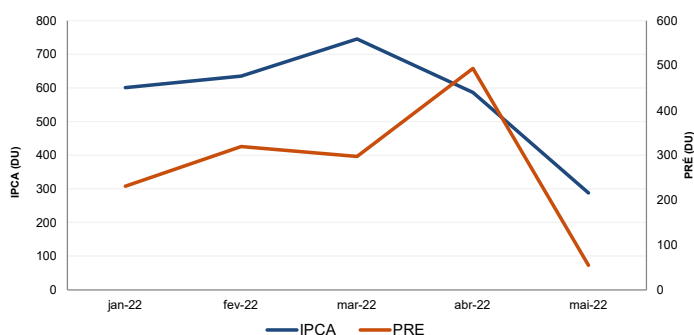
Evolução do Patrimônio Líquido



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	90,77	5,87	64,99	4,48
BOVA11	Fundos	83,47	5,40	72,87	5,03
ASAI3	Comércio e Distribuição	79,66	5,15	73,23	5,05
LREN3	Comércio	78,41	5,07	34,39	2,37
SBSP3	Água e Saneamento	74,57	4,82	52,28	3,61
BBAS3	Intermediários Financeiros	65,31	4,22	29,28	2,02
BOVV11	Fundos	64,63	4,18	22,10	1,52
HYPE3	Comércio e Distribuição	63,17	4,09	47,88	3,30
SUZB3	Madeira e Papel	56,68	3,67	52,83	3,64
VALE3	Mineração	55,85	3,61	52,20	3,60

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

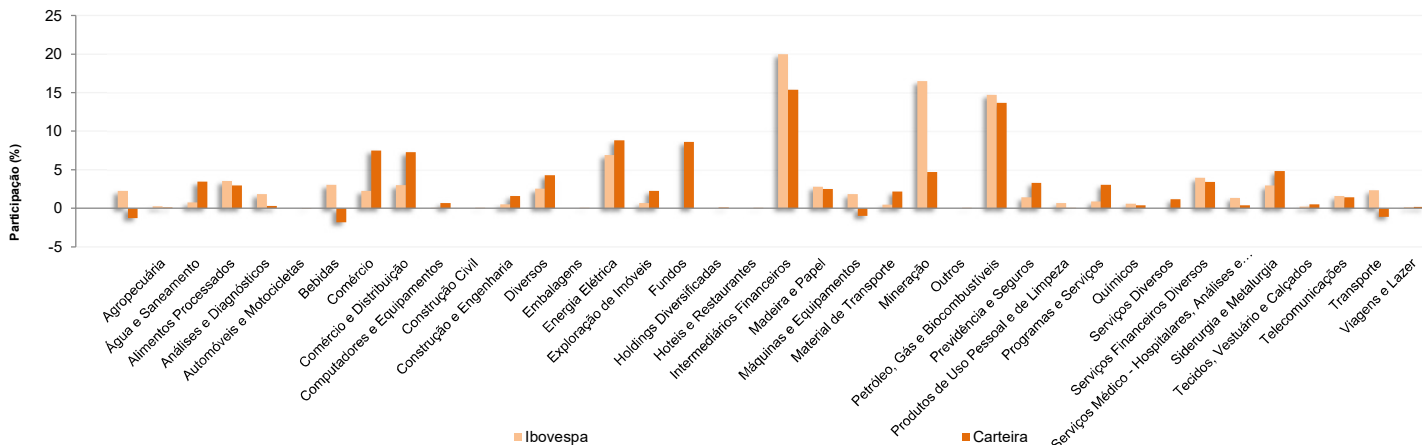
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
ITUB4	90,77	5,87	0,00	1
ASAI3	79,66	5,15	0,00	1
LREN3	78,41	5,07	0,00	1
SBSP3	74,57	4,82	0,00	1
BBAS3	65,31	4,22	0,00	1
HYPE3	63,17	4,09	0,00	1
SUZB3	56,68	3,67	0,00	1
VALE3	55,85	3,61	0,00	1
EQLT3	53,12	3,44	0,00	1
ELET3	52,53	3,40	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

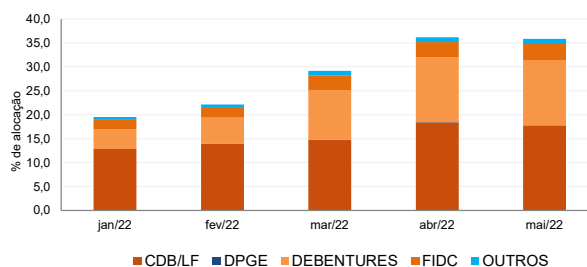
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	5.956,45	5,17	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	3.917,36	3,40	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.177,06	1,89	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.207,77	1,05	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	795,14	0,69	Faixa 1
BCO TOYOTA BRASIL SA	738,92	0,64	Faixa 1
BANCO CSF SA	587,28	0,51	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	570,02	0,50	Faixa 2
APICE SECURITIZADORA IMOBILIARIA SA	555,97	0,48	Sem Faixa
BCO DAYCOVAL SA	549,73	0,48	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
BBML13	194,01	BBM LOGISTICA SA	Sem Faixa	Faixa 4	20-dez-26	CDI	4,31%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
CRI RBRA 1 510	90,32	RB CAPITAL COMPANHIA SECURITIZACAO	Sem Faixa	Faixa 3	22-abr-25	CDI	2,07%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
LCAMB4	6,45	CIA LOCAAO AMERICAS	Sem Faixa	Faixa 1	10-mai-27	CDI	1,89%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
LCAMB4	78,35	CIA LOCAAO AMERICAS	Sem Faixa	Faixa 1	10-mai-27	CDI	1,92%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
RDORB3	5,57	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-mai-32	CDI	1,98%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/05/2022

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
LF CDI	08-nov-24	50.390	0,04%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	10-mai-22	1,15%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	11-mai-25	50.363	0,04%	CDI	BCO CNH CAPITAL SA	11-mai-22	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA 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	17.706.069	15,38%	Selic		26-mai-22	0,03%	0,03%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	187.397	0,16%	Selic		16-mai-22	7,00%	0,07%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	105.411	0,09%	Selic		06-mai-22	0,08%	0,08%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2024-09-01	01-set-24	491.162	0,43%	Selic		18-mai-22	0,12%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	6.788.179	5,90%	Selic		25-mai-22	0,12%	0,12%	ATLANTIDA FI MULT

