

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
<b>Renda Fixa</b>	<b>130.218.605,27</b>	<b>100%</b>										
Benchmark:	CDI					1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%
<b>Multiestatégia</b>	<b>130.218.605,27</b>	<b>100%</b>			<b>1,20%</b>	<b>0,77%</b>	<b>3,61%</b>	<b>5,70%</b>	<b>4,88%</b>	<b>5,08%</b>	<b>10,30%</b>	<b>15,57%</b>
ATLANTIDA 2 FI MULT	66.778.321,55	51,28%	ITAU	100%	1,04%	0,85%	5,07%	7,27%	6,53%	7,77%	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	63.440.283,72	48,72%	TAG INVESTIMENTOS	100%	1,47%	0,64%	2,05%	4,02%	3,11%	2,31%	-	-
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					0,94%	4,57%	8,41%	7,10%	17,88%	34,35%	44,37%
<b>Total</b>	<b>130.217.831,70</b>	<b>100%</b>			<b>1,20%</b>	<b>0,75%</b>	<b>3,57%</b>	<b>5,64%</b>	<b>4,83%</b>	<b>5,00%</b>	<b>13,15%</b>	<b>16,80%</b>
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					0,94%	4,57%	8,41%	7,10%	17,88%	34,35%	44,37%

\* 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.

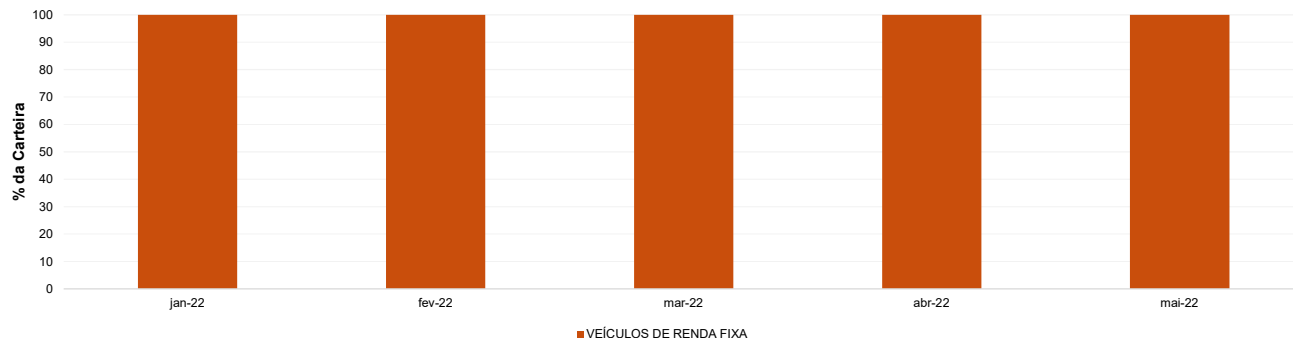
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

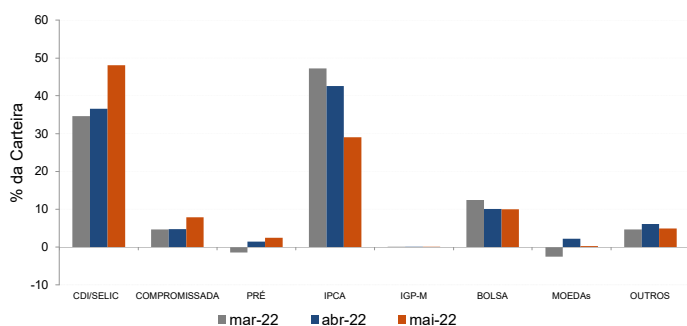
## Distribuição da Carteira

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.

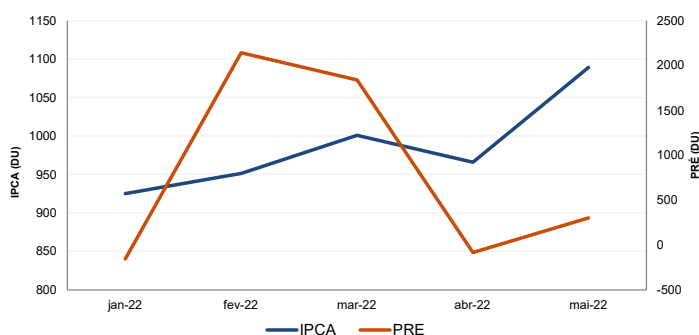
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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*	%
VALE3	Mineração	510,33	3,57	481,38	3,37
EQTL3	Energia Elétrica	488,37	3,42	441,88	3,10
ENGI11	Energia Elétrica	402,79	2,82	470,79	3,30
ITUB4	Intermediários Financeiros	393,65	2,75	318,26	2,23
ELET3	Energia Elétrica	375,05	2,62	359,49	2,52
AURE3	Energia Elétrica	363,31	2,54	378,27	2,65
MULT3	Exploração de Imóveis	345,71	2,42	332,53	2,33
BPAC11	Intermediários Financeiros	319,56	2,24	294,81	2,06
IGTI11	Exploração de Imóveis	311,71	2,18	292,59	2,05
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	311,27	2,18	375,78	2,63

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

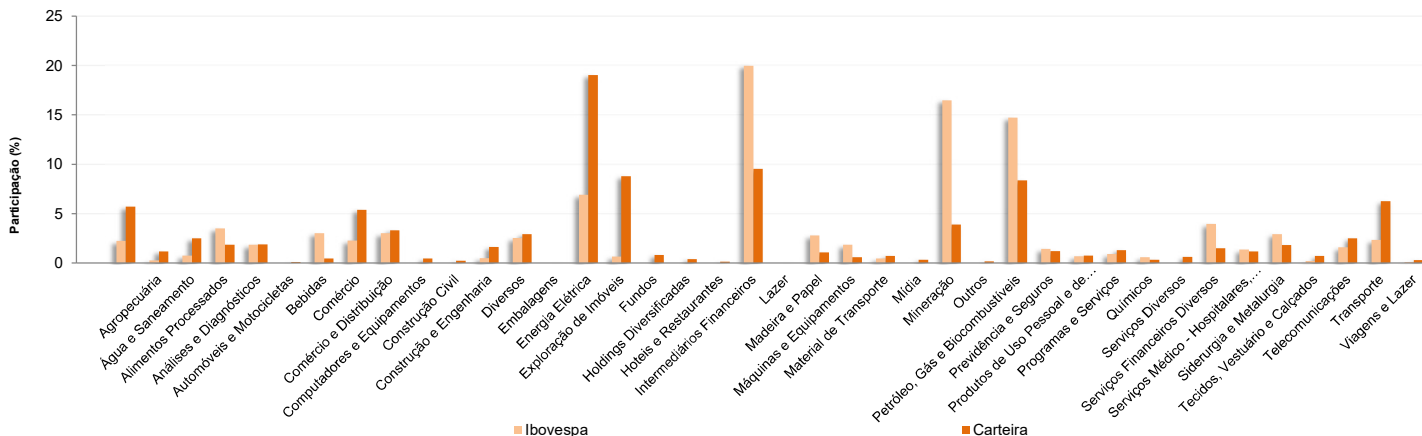
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BAUH4	19,09	0,13	0,02	8
SCAR3	26,18	0,18	0,00	2
MTSA4	22,51	0,16	0,02	2
VALE3	510,33	3,57	0,00	1
EQTL3	488,37	3,42	0,00	1
ENGI11	402,79	2,82	0,00	1
ITUB4	393,65	2,75	0,00	1
ELET3	375,05	2,62	0,00	1
AURE3	363,31	2,54	0,01	1
MULT3	345,71	2,42	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

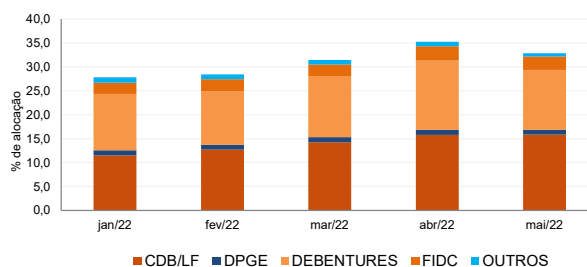
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	5.964,50	4,66	Faixa 1
BCO ITAU SA	4.454,66	3,48	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.748,96	2,15	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.314,26	1,03	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.141,35	0,89	Faixa 1
CIA LOCAÇÃO AMERICAS	1.136,40	0,89	Faixa 2
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.116,82	0,87	Faixa 4
EQUATORIAL ENERGIA SA	799,99	0,62	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	782,79	0,61	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	774,55	0,60	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
BBML13	127,43	BBM LOGISTICA SA	Sem Faixa	Faixa 4	20-dez-26	CDI	4,31%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
CRI RBRA 1 510	43,29	RB CAPITAL COMPANHIA SECURITIZACAO	Sem Faixa	Faixa 3	22-abr-25	CDI	2,07%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
LCAMB4	9,63	CIA LOCAÇÃO AMERICAS	Sem Faixa	Faixa 1	10-mai-27	CDI	1,89%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
LCAMB4	51,46	CIA LOCAÇÃO AMERICAS	Sem Faixa	Faixa 1	10-mai-27	CDI	1,92%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
RDORB3	0,19	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-mai-32	CDI	1,90%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
RDORB3	15,67	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 MODERADO

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 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	257.798	0,20%	Selic		12-mai-22	5,00%	0,05%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.463.054	1,14%	Selic		02-mai-22	0,12%	0,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.455.812	1,92%	Selic		17-mai-22	0,12%	0,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	45.500	0,04%	IPCA		09-mai-22	5,62%	5,66%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	45.500	0,04%	IPCA		27-mai-22	5,54%	5,59%	ATLANTIDA 2 FI MULT

