

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	254.160.368,94	100%				0,87%	3,76%	5,97%	5,18%	6,66%	11,97%	17,40%
Benchmark:	CDI					1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%
Multiestratégia Perfil Moderado	130.218.605,27	51,24%			1,20%	0,77%	3,61%	5,70%	4,88%	5,08%	10,30%	15,57%
ATLANTIDA 2 FI MULT	66.778.321,55	26,27%	ITAU	100%	1,04%	0,85%	5,07%	7,27%	6,53%	7,77%	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	63.440.283,72	24,96%	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%
Multiestratégia Perfil Conservador	115.152.197,27	45,31%			0,27%	0,95%	3,86%	6,11%	5,42%	8,11%	13,09%	18,56%
ATLANTIDA FI MULT	59.225.662,39	23,30%	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	22,00%	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%
Conservador Vitalício (ALM)	7.834.758,19	3,08%			0,01%							
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	7.834.758,19	3,08%		100%	0,01%	1,51%	5,26%	9,22%	7,77%	19,35%	36,80%	49,07%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,85%	4,29%	7,84%	6,64%	16,64%	31,54%	39,87%
Conservador Vitalício (Fundo)	954.808,21	0,38%			0,08%	1,06%	2,74%	5,14%	4,35%	8,06%	11,14%	13,27%
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	954.808,21	0,38%	BRADESCO	0,02%	0,08%	1,06%	2,74%	5,14%	4,35%	8,06%	10,12%	15,41%
Benchmark:	CDI					1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%
Total	254.154.663,55	100%			0,70%	0,87%	3,76%	5,97%	5,18%	6,66%	14,04%	18,31%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,85%	4,29%	7,84%	6,64%	16,64%	31,54%	39,87%

* 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.

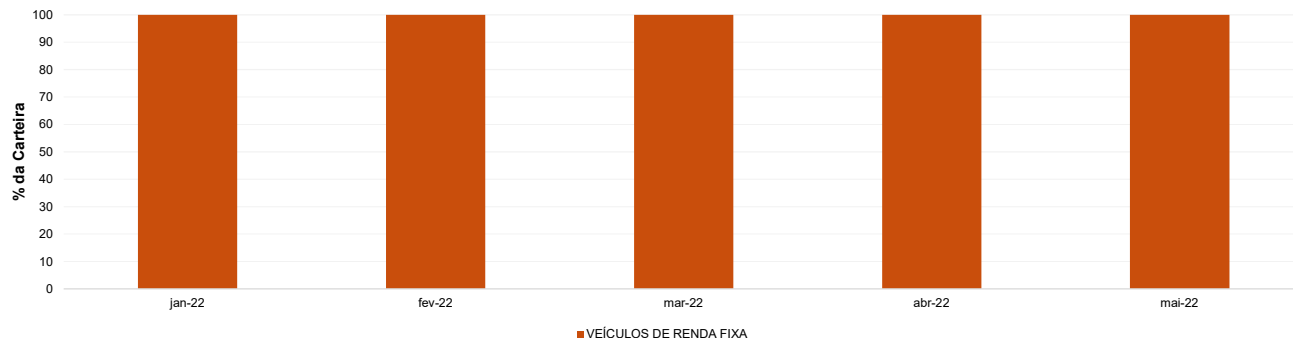
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

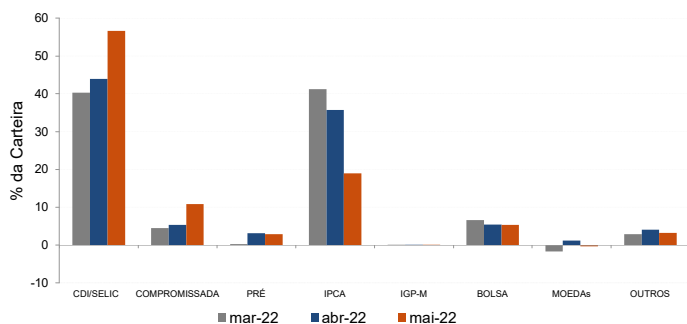
Distribuição da Carteira

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.

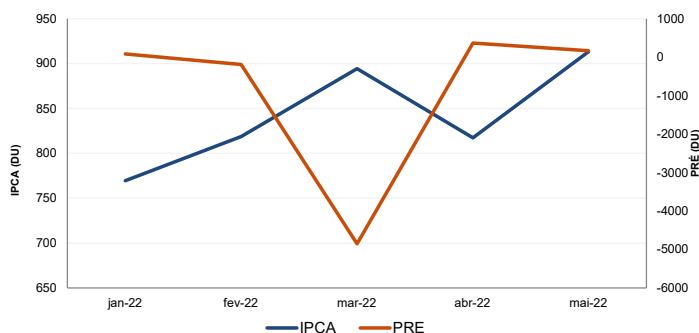
Evolução do Patrimônio Líquido



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	566,18	3,57	533,58	3,39
EQTL3	Energia Elétrica	541,49	3,42	493,88	3,14
ITUB4	Intermediários Financeiros	484,42	3,06	383,25	2,44
ENGI11	Energia Elétrica	435,54	2,75	501,21	3,19
ELET3	Energia Elétrica	427,58	2,70	393,08	2,50
AURE3	Energia Elétrica	394,39	2,49	407,01	2,59
MULT3	Exploração de Imóveis	367,51	2,32	345,52	2,20
BPAC11	Intermediários Financeiros	364,47	2,30	339,36	2,16
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	362,00	2,29	464,69	2,95
LREN3	Comércio	348,31	2,20	199,83	1,27

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

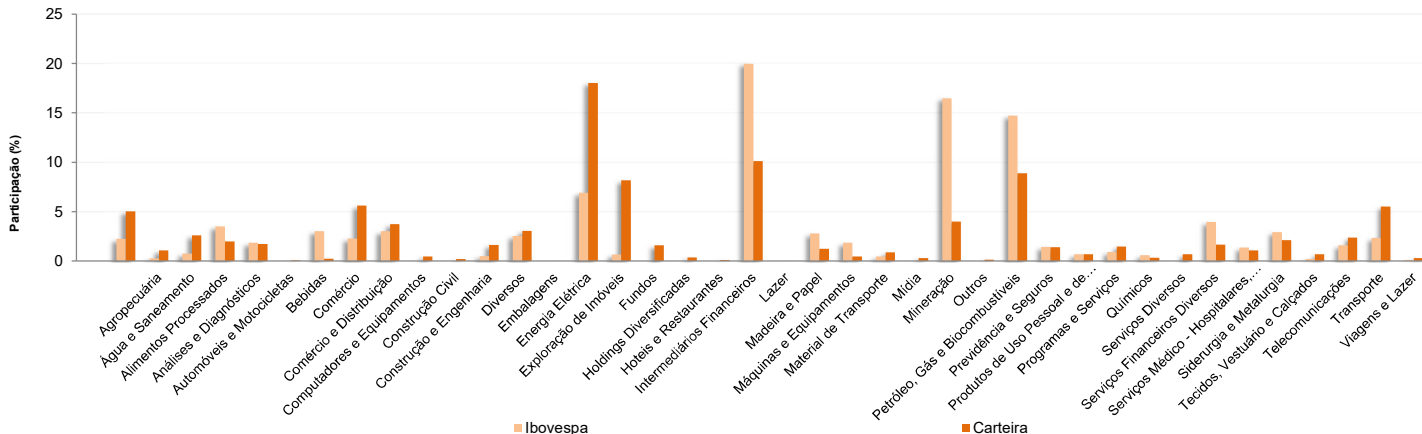
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BAUH4	19,09	0,12	0,02	8
SCAR3	26,18	0,17	0,00	2
MTSA4	22,51	0,14	0,02	2
VALE3	566,18	3,57	0,00	1
EQTL3	541,49	3,42	0,00	1
ITUB4	484,42	3,06	0,00	1
ENGI11	435,54	2,75	0,00	1
ELET3	427,58	2,70	0,00	1
AURE3	394,39	2,49	0,01	1
MULT3	367,51	2,32	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

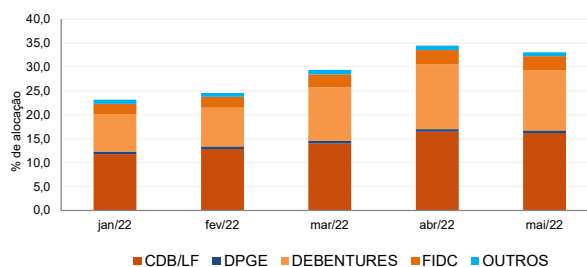
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	10.411,11	4,13	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	9.881,86	3,92	Faixa 1
BCO SAFRA SA	4.926,01	1,96	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	2.522,03	1,00	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	1.479,53	0,59	Faixa 1
CIA LOCACAO AMERICAS	1.393,32	0,55	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	1.308,40	0,52	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.141,35	0,45	Faixa 1
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.116,82	0,44	Faixa 4
EQUATORIAL ENERGIA SA	1.108,36	0,44	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	194,01	BBM LOGISTICA SA	Sem Faixa	Faixa 4	20-dez-26	CDI	4,31%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
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	90,32	RB CAPITAL COMPANHIA SECURITIZACAO	Sem Faixa	Faixa 3	22-abr-25	CDI	2,07%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV INST FI RF
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	6,45	CIA LOCACAO AMERICAS	Sem Faixa	Faixa 1	10-mai-27	CDI	1,89%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
LCAMB4	78,35	CIA LOCACAO AMERICAS	Sem Faixa	Faixa 1	10-mai-27	CDI	1,92%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LCAMB4	9,63	CIA LOCACAO AMERICAS	Sem Faixa	Faixa 1	10-mai-27	CDI	1,89%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
LCAMB4	51,46	CIA LOCACAO 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
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
RDORB3	0,19	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-mai-32	CDI	1,90%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	0,02%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	10-mai-22	1,15%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	08-nov-24	50.390	0,02%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	10-mai-22	1,15%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	11-mai-25	50.363	0,02%	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 2022-09-01	01-set-22	8.249	0,00%	Selic		16-mai-22	4,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	5.539	0,00%	Selic		19-mai-22	0,03%	0,04%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	17.706.069	7,03%	Selic		26-mai-22	0,03%	0,03%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	257.798	0,10%	Selic		12-mai-22	5,00%	0,05%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.663	0,00%	Selic		10-mai-22	5,00%	0,06%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.498	0,00%	Selic		16-mai-22	5,00%	0,05%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	187.397	0,07%	Selic		16-mai-22	7,00%	0,07%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	105.411	0,04%	Selic		06-mai-22	0,08%	0,08%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.463.054	0,58%	Selic		02-mai-22	0,12%	0,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	5.885	0,00%	Selic		19-mai-22	0,09%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.455.812	0,97%	Selic		17-mai-22	0,12%	0,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2024-09-01	01-set-24	491.162	0,19%	Selic		18-mai-22	0,12%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	6.788.179	2,69%	Selic		25-mai-22	0,12%	0,12%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	45.500	0,02%	IPCA		09-mai-22	5,62%	5,66%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	45.500	0,02%	IPCA		27-mai-22	5,54%	5,59%	ATLANTIDA 2 FI MULT

