

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/06/2022

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	
<b>Renda Fixa</b>	<b>114.717.107,67</b>	<b>100%</b>										
Benchmark:	CDI				1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%	
<b>Multiestatégia</b>	<b>114.717.107,67</b>	<b>100%</b>		<b>0,36%</b>	<b>0,99%</b>	<b>3,00%</b>	<b>6,46%</b>	<b>6,46%</b>	<b>9,11%</b>	<b>13,49%</b>	<b>18,29%</b>	
ATLANTIDA FI MULT	60.000.864,46	52,30%	ITAU	100%	0,05%	1,06%	3,31%	6,85%	6,85%	10,41%	15,89%	22,00%
ITAPEMA FI MULT	54.716.243,21	47,70%	SUL AMERICA	100%	0,73%	0,90%	2,66%	6,05%	6,05%	7,76%	11,06%	14,07%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.				1,04%	3,33%	7,80%	7,80%	16,92%	32,36%	41,29%	
<b>Total</b>	<b>114.714.102,30</b>	<b>100%</b>		<b>0,36%</b>	<b>0,98%</b>	<b>2,98%</b>	<b>6,43%</b>	<b>6,43%</b>	<b>9,06%</b>	<b>13,42%</b>	<b>17,97%</b>	
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.				1,04%	3,33%	7,80%	7,80%	16,92%	32,36%	41,29%	

\* 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.

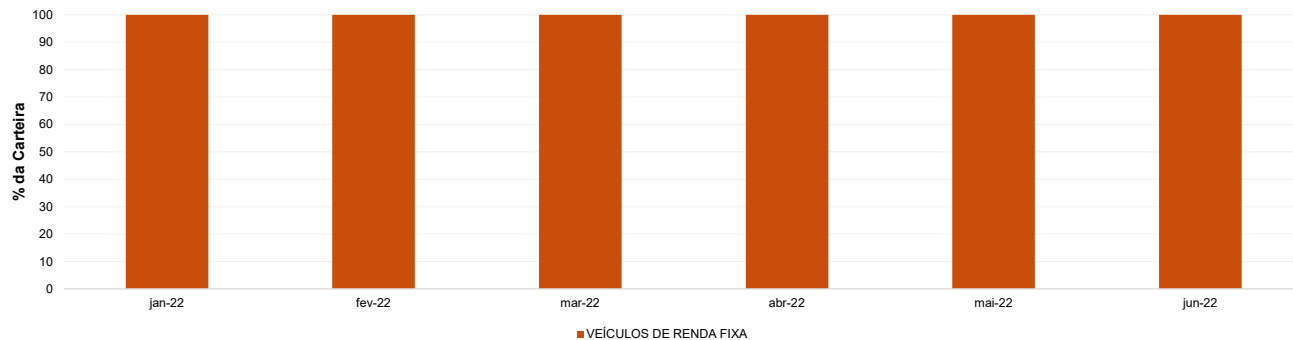
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

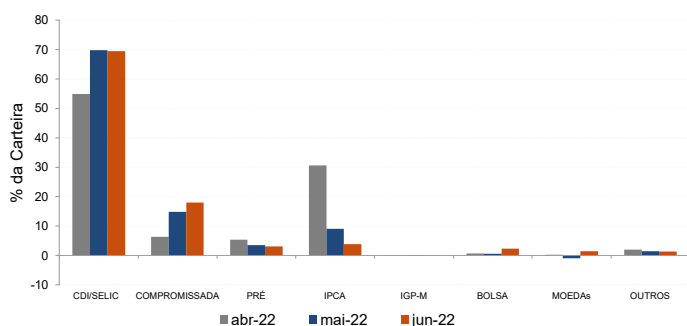
## Distribuição da Carteira

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.

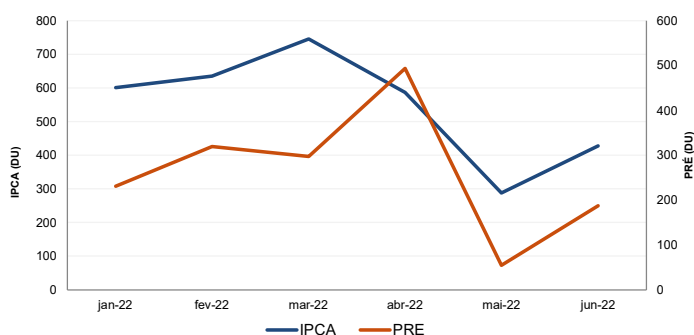
## Evolução do Patrimônio Líquido



## 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*	%
GLEN LN		2.308,58	68,23	0,00	0,00
ELET3	Energia Elétrica	110,28	3,26	52,53	3,40
VALE3	Mineração	77,15	2,28	55,85	3,61
SBSP3	Água e Saneamento	62,71	1,85	74,57	4,82
HYPE3	Comércio e Distribuição	62,09	1,83	63,17	4,09
BOVA11	Fundos	60,60	1,79	83,47	5,40
ITUB4	Intermediários Financeiros	54,05	1,60	90,77	5,87
EQTL3	Energia Elétrica	50,58	1,49	53,12	3,44
ASAI3	Comércio e Distribuição	48,52	1,43	79,66	5,15
RECV3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	46,31	1,37	30,45	1,97

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

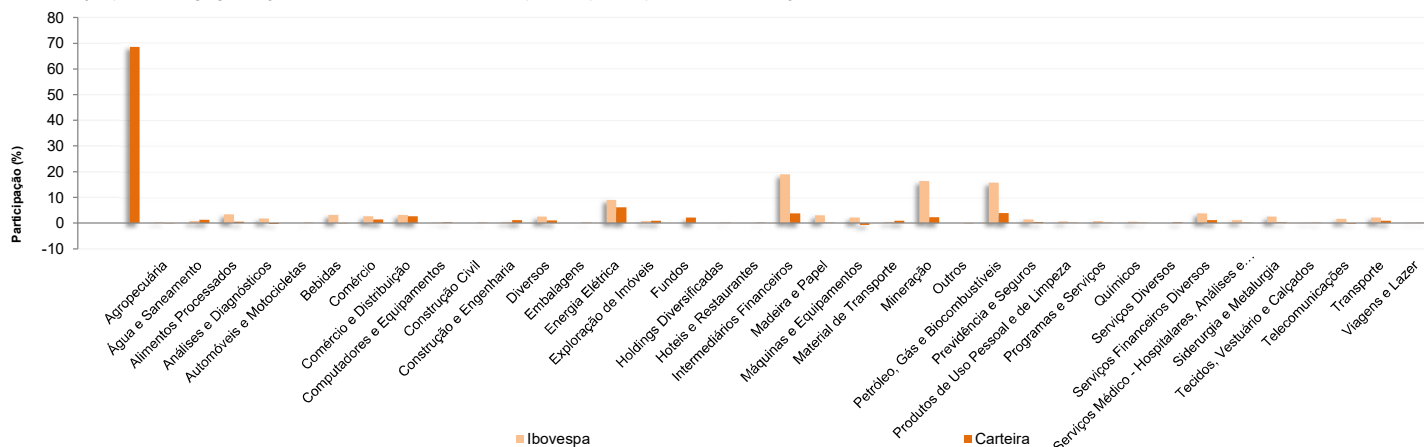
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
ELET3	110,28	3,26	0,00	1
VALE3	77,15	2,28	0,00	1
SBSP3	62,71	1,85	0,00	1
HYPE3	62,09	1,83	0,00	1
ITUB4	54,05	1,60	0,00	1
EQTL3	50,58	1,49	0,00	1
ASAI3	48,52	1,43	0,00	1
RECV3	46,31	1,37	0,00	1
RAIL3	46,18	1,36	0,00	1
SUZB3	37,43	1,11	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

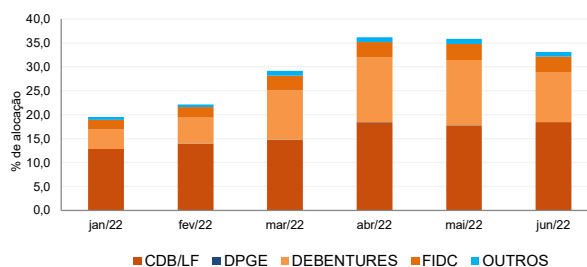
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	7.496,19	6,46	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	3.866,72	3,33	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.147,09	1,85	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.194,85	1,03	Faixa 2
BCO TOYOTA BRASIL SA	747,18	0,64	Faixa 1
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	691,19	0,60	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	591,92	0,51	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	560,84	0,48	Faixa 2
APICE SECURITIZADORA IMOBILIARIA SA	537,13	0,46	Sem Faixa
BANCO CSF SA	502,01	0,43	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
LVTC22	123,29	LIVETECH DA BAHIA INDUSTRIA E COMERCIO S.A	Sem Faixa	Faixa 2	15-jun-29	CDI	2,77%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
QUAL16	18,39	QUALICORP SA	Sem Faixa	Faixa 1	03-jun-27	CDI	1,94%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
RIPR13	3,62	RIO PARANA ENERGIA SA	Sem Faixa	Faixa 1	27-jun-27	CDI	1,29%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/06/2022

## 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
BRKMA6	12-mai-29	142.253	0,12%	CDI	BRASKEM SA	10-jun-22	1,75%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CPFPA4	25-mai-29	37.834	0,03%	CDI	CIA PIRATININGA FORCA LUZ	08-jun-22	1,47%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
EEEL28	25-mai-29	78.911	0,07%	CDI	CIA ESTADUAL GERACAO TRANSMISSAC	08-jun-22	1,47%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	19-jun-24	50.278	0,04%	CDI	BCO MODAL SA	15-jun-22	1,70%	Faixa 3	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	16-out-24	56.170	0,05%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	10-jun-22	1,00%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	04-mai-26	505.180	0,44%	CDI	BCO ITAU SA	01-jun-22	0,88%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	01-jun-26	505.188	0,44%	CDI	BCO ITAU SA	01-jun-22	0,90%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	09-jun-26	50.375	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	09-jun-22	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	22-jun-26	50.189	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	21-jun-22	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	01-jul-26	504.939	0,44%	CDI	BCO ITAU SA	02-jun-22	0,92%	Faixa 1	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	153.750	0,13%	Selic		01-jun-22	0,08%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2024-09-01	01-set-24	5.022.628	4,33%	Selic		27-jun-22	0,09%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2024-09-01	01-set-24	59.090	0,05%	Selic		14-jun-22	0,09%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT

