

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	129.143.403,00	100%										
Benchmark:	CDI					1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%
Multiestatégia	129.143.403,00	100%		1,10%	-0,49%	0,35%	4,36%	4,36%	4,52%	9,24%	13,61%	
ATLANTIDA 2 FI MULT	66.760.900,35	51,70%	ITAU	100%	1,11%	-0,03%	1,77%	6,51%	6,51%	7,69%	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	62.382.502,65	48,31%	TAG INVESTIMENTOS	100%	1,28%	-0,99%	-1,18%	2,10%	2,10%	1,29%	-	-
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					1,12%	3,57%	8,30%	8,30%	18,04%	34,90%	45,38%
Total	129.142.615,31	100%		1,10%	-0,49%	0,31%	4,31%	4,31%	4,46%	10,87%	14,40%	
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					1,12%	3,57%	8,30%	8,30%	18,04%	34,90%	45,38%

* 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.

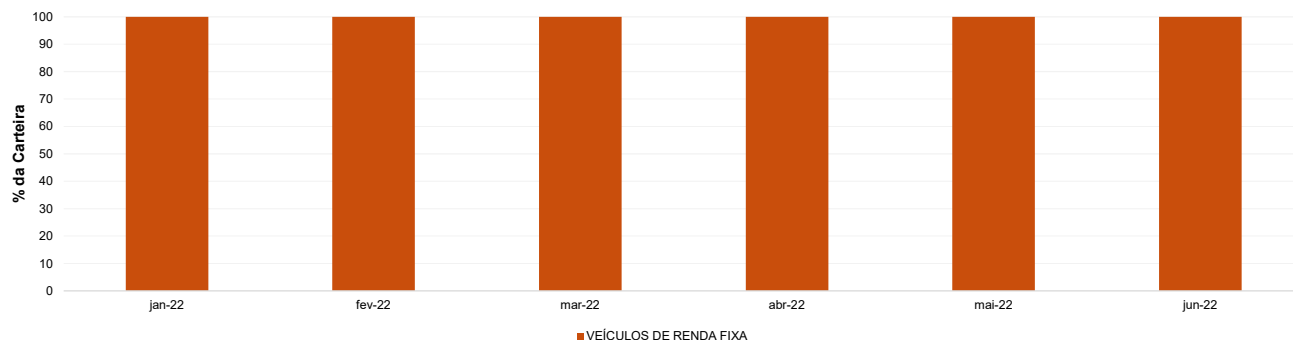
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

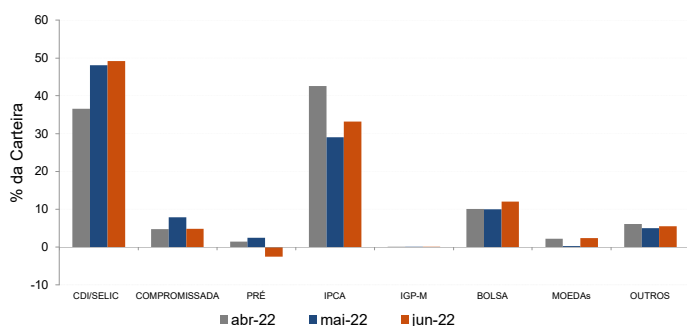
Distribuição da Carteira

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.

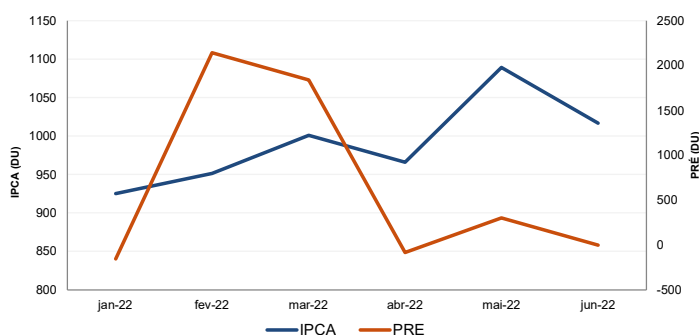
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
GLEN LN		2.564,05	16,83	0,00	0,00
VALE3	Mineração	661,22	4,34	510,33	3,57
ELET3	Energia Elétrica	625,43	4,11	375,05	2,62
EQTL3	Energia Elétrica	536,09	3,52	488,37	3,42
ITUB4	Intermediários Financeiros	400,33	2,63	393,65	2,75
ENGI11	Energia Elétrica	386,07	2,53	402,79	2,82
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	354,85	2,33	311,27	2,18
AURE3	Energia Elétrica	344,00	2,26	363,31	2,54
RAIL3	Transporte	306,24	2,01	293,68	2,05
SBSP3	Água e Saneamento	297,83	1,96	269,25	1,88

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

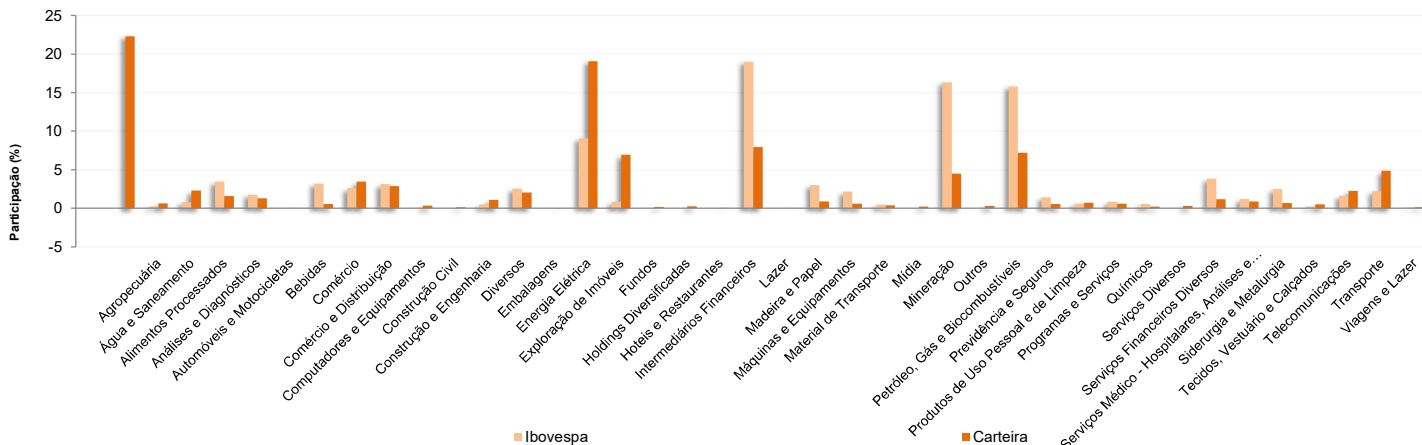
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BAUH4	23,97	0,16	0,02	8
SCAR3	27,28	0,18	0,00	2
MTSA4	26,07	0,17	0,02	2
VALE3	661,22	4,34	0,00	1
ELET3	625,43	4,11	0,00	1
EQTL3	536,09	3,52	0,00	1
ITUB4	400,33	2,63	0,00	1
ENGI11	386,07	2,53	0,00	1
PETR4	354,85	2,33	0,00	1
AURE3	344,00	2,26	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.



Este 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.

Análises de Contrapartes

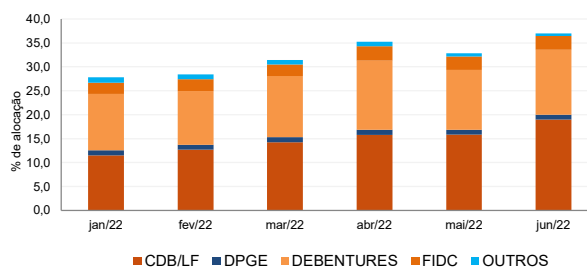
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	6.385,09	4,95	Faixa 1
BCO ITAU SA	5.775,53	4,48	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.743,18	2,13	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.310,91	1,02	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.283,33	1,00	Faixa 1
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.153,98	0,90	Faixa 1
CIA LOCAÇÃO AMERICAS	1.139,22	0,88	Faixa 2
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.129,75	0,88	Faixa 4
EQUATORIAL ENERGIA SA	1.126,21	0,87	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	1.060,17	0,82	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
LVTC22	80,97	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	51,71	QUALICORP SA	Sem Faixa	Faixa 1	03-jun-27	CDI	1,94%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
RIPR13	5,40	RIO PARANA ENERGIA SA	Sem Faixa	Faixa 1	27-jun-27	CDI	1,29%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	160.999	0,12%	CDI	BRASKEM SA	10-jun-22	1,75%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
CPFPA4	25-mai-29	43.239	0,03%	CDI	CIA PIRATININGA FORCA LUZ	08-jun-22	1,47%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
EEEL28	25-mai-29	88.639	0,07%	CDI	CIA ESTADUAL GERACAO TRANSMISSAC	08-jun-22	1,47%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	19-jun-24	50.278	0,04%	CDI	BCO MODAL SA	15-jun-22	1,70%	Faixa 3	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	16-out-24	56.170	0,04%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	10-jun-22	1,00%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	04-mai-26	404.144	0,31%	CDI	BCO ITAU SA	01-jun-22	0,88%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	01-jun-26	404.151	0,31%	CDI	BCO ITAU SA	01-jun-22	0,90%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	09-jun-26	50.375	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	09-jun-22	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	22-jun-26	50.189	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	21-jun-22	1,25%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI	01-jul-26	403.951	0,31%	CDI	BCO ITAU SA	02-jun-22	0,92%	Faixa 1	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	59.183	0,05%	Selic		27-jun-22	4,00%	0,04%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	153.496	0,12%	Selic		14-jun-22	0,11%	0,11%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2025-09-01	01-set-25	318.445	0,25%	Selic		29-jun-22	0,12%	0,12%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	555.161	0,43%	IPCA		28-jun-22	5,72%	5,93%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	41.363	0,03%	IPCA		30-jun-22	5,78%	5,76%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	41.363	0,03%	IPCA		29-jun-22	5,75%	5,81%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	28.954	0,02%	IPCA		22-jun-22	5,62%	5,60%	ATLANTIDA 2 FI MULT

