

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 29/07/2022

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	115.237.620,15	100%										
Benchmark:	CDI					1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
Multiestatégia	115.237.620,15	100%			0,10%	1,07%	3,04%	7,07%	7,61%	9,98%	14,15%	18,50%
ATLANTIDA FI MULT	60.707.719,95	52,68%	ITAU	100%	0,03%	1,09%	3,11%	7,56%	8,01%	11,02%	16,70%	22,13%
ITAPEMA FI MULT	54.529.900,20	47,32%	SUL AMERICA	100%	0,20%	1,06%	2,97%	6,54%	7,17%	8,91%	11,57%	14,38%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					-0,32%	1,58%	6,49%	7,46%	15,00%	30,94%	40,01%
Total	115.234.615,86	100%			0,10%	1,07%	3,03%	7,04%	7,57%	9,94%	13,99%	18,17%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					-0,32%	1,58%	6,49%	7,46%	15,00%	30,94%	40,01%

* 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.

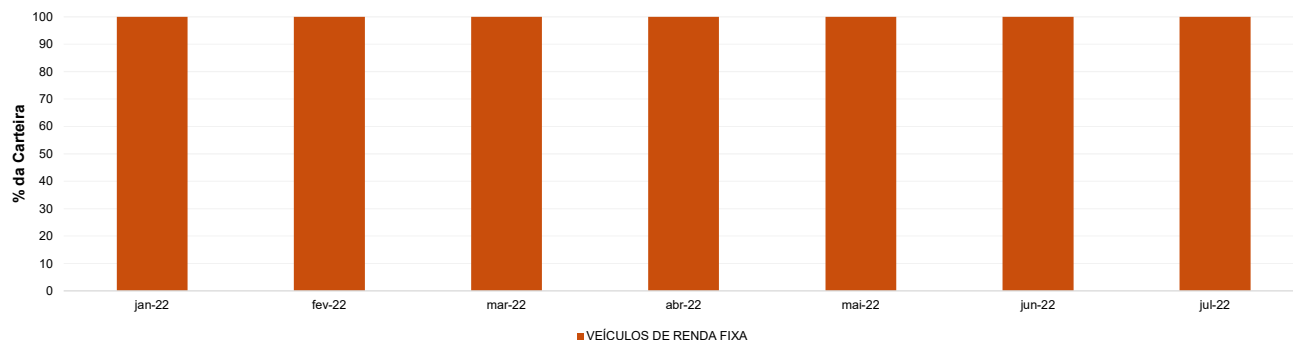
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

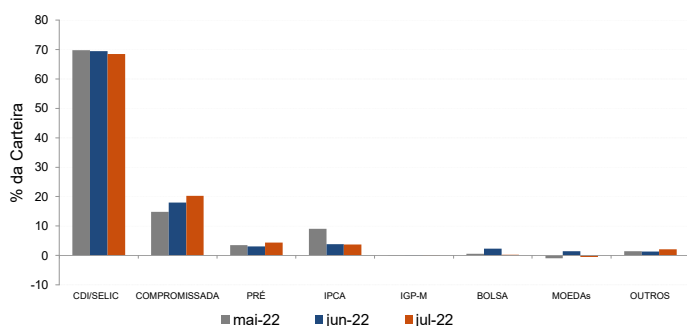
Distribuição da Carteira

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.

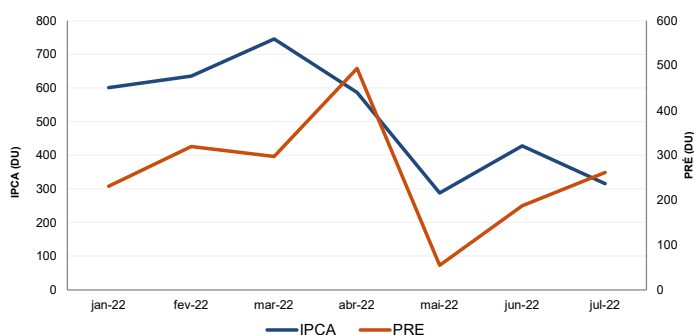
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
EQTL3	Energia Elétrica	45,45	10,98	50,58	1,49
ITUB4	Intermediários Financeiros	41,21	9,96	54,05	1,60
VBRR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	30,46	7,36	31,99	0,95
BRFS3	Alimentos Processados	28,33	6,84	2,72	0,08
ELET3	Energia Elétrica	27,71	6,70	110,28	3,26
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	27,04	6,53	14,23	0,42
ENEV3	Energia Elétrica	26,86	6,49	0,55	0,02
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	22,06	5,33	7,13	0,21
HYPE3	Comércio e Distribuição	21,55	5,21	62,09	1,83
LREN3	Comércio	21,11	5,10	11,38	0,34

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

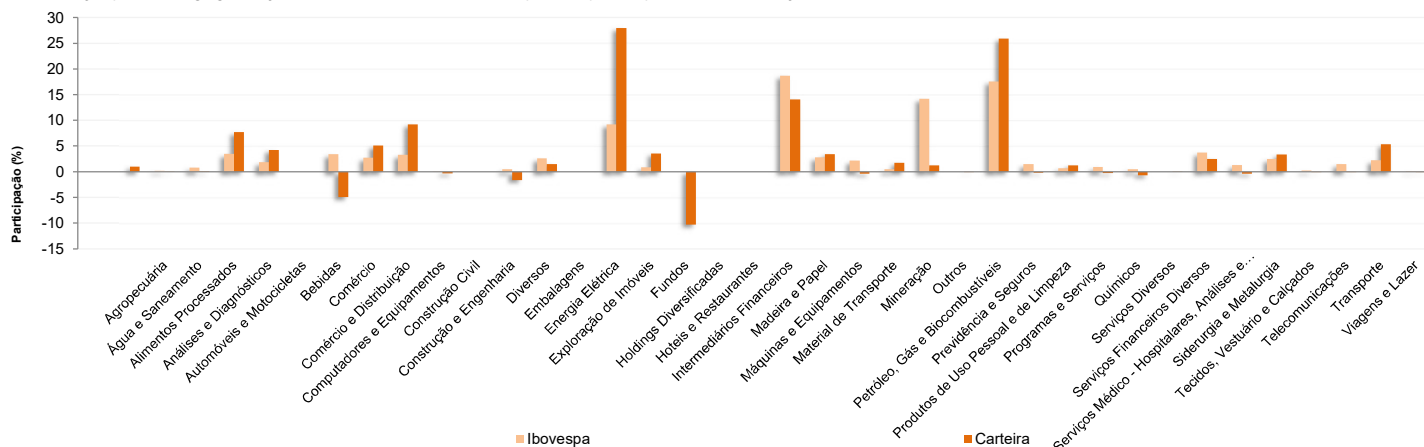
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRDE3	0,05	0,01	0,00	Sem Liquidez
EQTL3	45,45	10,98	0,00	1
ITUB4	41,21	9,96	0,00	1
VBRR3	30,46	7,36	0,00	1
BRFS3	28,33	6,84	0,00	1
ELET3	27,71	6,70	0,00	1
PETR4	27,04	6,53	0,00	1
ENEV3	26,86	6,49	0,00	1
PRI03	22,06	5,33	0,00	1
HYPE3	21,55	5,21	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.



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

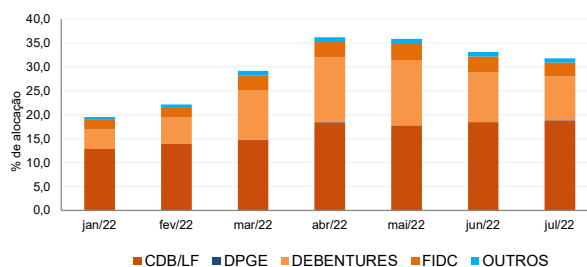
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO ITAU SA	7.554,83	6,59	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	3.877,48	3,38	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.148,27	1,87	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.181,07	1,03	Faixa 2
BCO TOYOTA BRASIL SA	755,68	0,66	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	598,62	0,52	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	559,02	0,49	Faixa 2
BANCO CSF SA	504,37	0,44	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	500,23	0,44	Faixa 2
PORTOSEG SA CRED FINANCI INVEST	457,48	0,40	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
LOGGB1	88,31	LOG COMMERCIAL PROPERTIES PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	11-jul-27	CDI	1,76%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
PGMN17	53,79	EMPREENDIMENTOS PAGUE MENOS SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-jul-26	CDI	1,70%	ATLANTIDA FI MULT
RISP11	0,00	SPE SANEAMENTO RIO 1 S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	11-nov-23	CDI	3,50%	SANTANDER RF REF DI FI
TLPP17	0,00	TELEFONICA BRASIL SA	Sem Faixa	Faixa 1	12-jul-25	CDI	1,12%	SPECIAL RF REF DI FI
TLPP27	0,00	TELEFONICA BRASIL SA	Sem Faixa	Faixa 1	12-jul-27	CDI	1,35%	SANTANDER RF REF DI FI



RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 29/07/2022

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	22-jul-25	100.267	0,09%	CDI	BCO GMAC SA	22-jul-22	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
PGMN17	15-jul-26	53.791	0,05%	CDI	EMPREENHIMENTOS PAGUE MENOS SA	15-jul-22	1,70%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
VVEO15	22-jul-27	83.701	0,07%	CDI	CM HOSPITALAR SA	25-jul-22	1,64%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	322.824	0,28%	Selic		11-jul-22	4,00%	0,04%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	83.695	0,07%	Selic		04-jul-22	5,00%	0,05%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	322.205	0,28%	Selic		14-jul-22	0,09%	0,09%	ATLANTIDA FI MULT

