

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	130.317.744,95	100%										
Benchmark:	CDI					1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
Multiestatégia	130.317.744,95	100%			1,39%	1,12%	1,40%	4,85%	5,53%	6,05%	9,93%	13,88%
ATLANTIDA 2 FI MULT	67.278.198,14	51,63%	ITAU	100%	1,60%	0,77%	1,61%	6,85%	7,33%	8,83%	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	63.039.546,81	48,37%	TAG INVESTIMENTOS	100%	1,28%	1,50%	1,14%	2,74%	3,62%	3,20%	-	-
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					-0,24%	1,83%	6,99%	8,05%	16,10%	33,44%	44,06%
Total	130.316.957,74	100%			1,39%	1,12%	1,38%	4,81%	5,49%	5,99%	10,53%	14,23%
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					-0,24%	1,83%	6,99%	8,05%	16,10%	33,44%	44,06%

* 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.

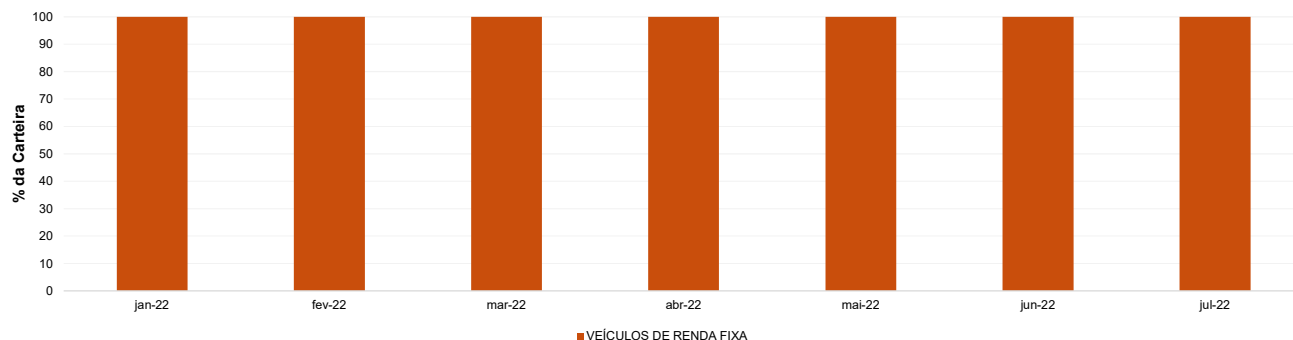
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

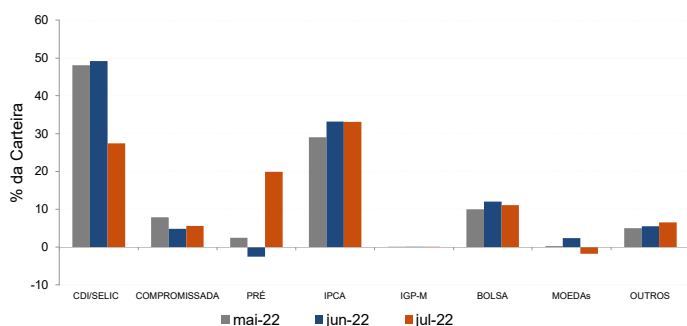
Distribuição da Carteira

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.

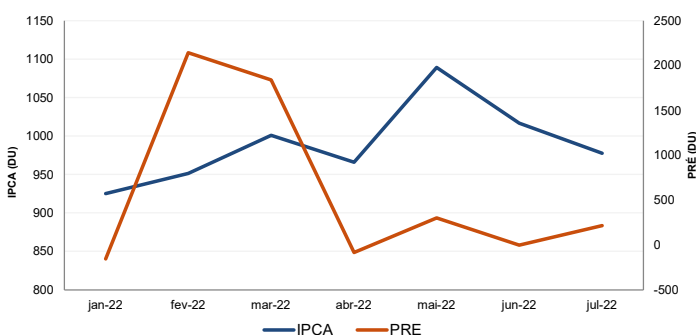
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
ELET3	Energia Elétrica	723,40	5,17	625,43	4,11
EQTL3	Energia Elétrica	560,59	4,00	536,09	3,52
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	556,25	3,97	354,85	2,33
VALE3	Mineração	521,91	3,73	661,22	4,34
ENGI11	Energia Elétrica	460,30	3,29	386,07	2,53
ITUB4	Intermediários Financeiros	452,74	3,23	400,33	2,63
AURE3	Energia Elétrica	366,14	2,61	344,00	2,26
SBSP3	Água e Saneamento	357,79	2,55	297,83	1,96
SHV US		349,58	2,50	0,00	
RAIL3	Transporte	339,09	2,42	306,24	2,01

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

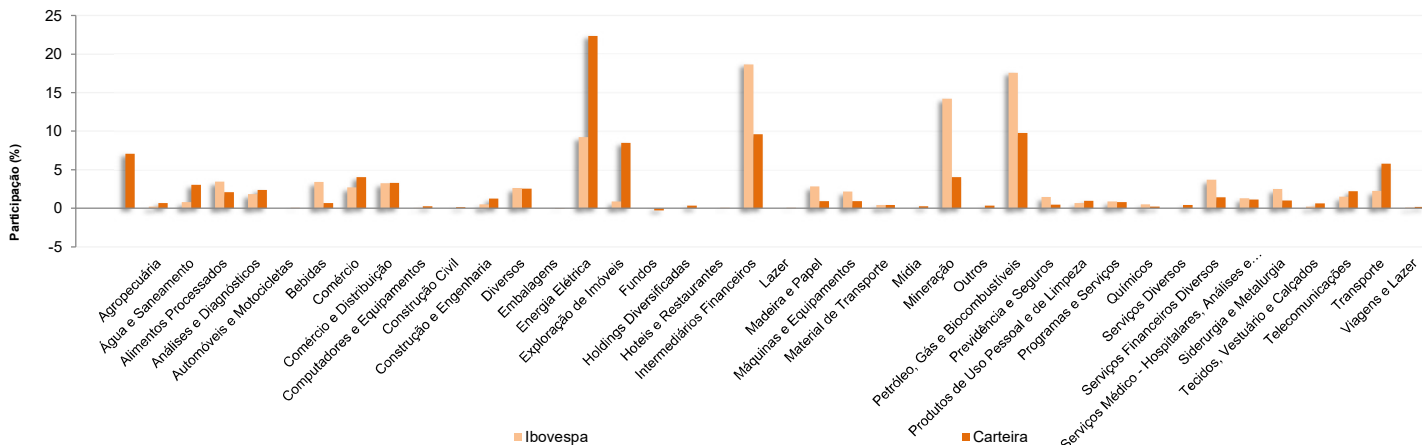
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRDE3	0,10	0,00	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	22,42	0,16	0,02	5
MTSA4	25,62	0,18	0,02	3
SCAR3	24,25	0,17	0,00	2
ELET3	723,40	5,17	0,00	1
EQTL3	560,59	4,00	0,00	1
PETR4	556,25	3,97	0,00	1
VALE3	521,91	3,73	0,00	1
ENGI11	460,30	3,29	0,00	1
ITUB4	452,74	3,23	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.



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.

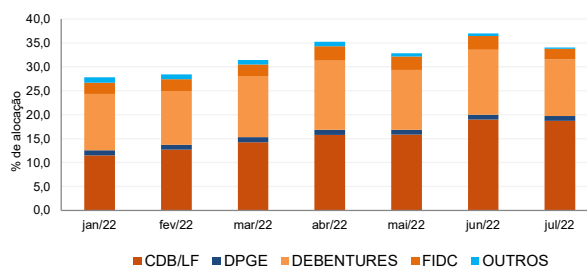
Análises de Contrapartes

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	6.445,13	5,04	Faixa 1
BCO ITAU SA	5.820,06	4,55	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.737,99	2,14	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.303,80	1,02	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.272,72	0,99	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.211,28	0,95	Faixa 2
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.167,11	0,91	Faixa 1
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.143,06	0,89	Faixa 4
EQUATORIAL ENERGIA SA	1.137,02	0,89	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	1.071,94	0,84	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	23,41	LOG COMMERCIAL PROPERTIES PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	11-jul-27	CDI	1,76%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
PGMN17	60,12	EMPREENHIMENTOS PAGUE MENOS SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-jul-26	CDI	1,70%	ATLANTIDA 2 FI MULT
RIS421	0,00	SPE SANEAMENTO RIO 4 S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	11-nov-23	CDI	3,50%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
RIS421	0,00	SPE SANEAMENTO RIO 4 S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	11-nov-23	CDI	3,50%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
RISP11	0,02	SPE SANEAMENTO RIO 1 S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	11-nov-23	CDI	3,40%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
RISP11	0,44	SPE SANEAMENTO RIO 1 S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	11-nov-23	CDI	3,50%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
RISP11	0,04	SPE SANEAMENTO RIO 1 S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	11-nov-23	CDI	3,50%	LEGACY CAPITAL MASTER 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
RISP11	0,01	SPE SANEAMENTO RIO 1 S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	11-nov-23	CDI	3,49%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
RISP21	0,01	SPE SANEAMENTO RIO 1 S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	11-nov-23	CDI	3,50%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
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 MODERADO

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	50.134	0,04%	CDI	BCO GMAC SA	22-jul-22	1,10%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT
PGMN17	15-jul-26	60.119	0,05%	CDI	EMPREENHIMENTOS PAGUE MENOS SA	15-jul-22	1,70%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
VVEO15	22-jul-27	92.177	0,07%	CDI	CM HOSPITALAR SA	25-jul-22	1,64%	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	59.803	0,05%	Selic		11-jul-22	0,03%	0,03%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	358.693	0,28%	Selic		04-jul-22	5,00%	0,05%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	322.824	0,25%	Selic		07-jul-22	4,00%	0,04%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	680.210	0,53%	Selic		14-jul-22	0,09%	0,09%	ATLANTIDA 2 FI MULT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	83.535	0,07%	Selic		12-jul-22	0,10%	0,10%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	39.859	0,03%	IPCA		07-jul-22	7,74%	7,90%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	562.390	0,44%	IPCA		08-jul-22	6,60%	6,78%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	373.159	0,29%	IPCA		06-jul-22	6,10%	6,16%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	20.062	0,02%	IPCA		06-jul-22	6,10%	6,16%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	36.844	0,03%	IPCA		29-jul-22	6,16%	6,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	36.822	0,03%	IPCA		21-jul-22	6,29%	6,28%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	20.457	0,02%	IPCA		11-jul-22	6,06%	6,17%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	49.082	0,04%	IPCA		21-jul-22	6,25%	6,24%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	36.811	0,03%	IPCA		08-jul-22	5,91%	6,09%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	32.721	0,03%	IPCA		12-jul-22	6,13%	6,11%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	16.361	0,01%	IPCA		11-jul-22	6,04%	6,16%	ATLANTIDA 2 FI MULT

