

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/08/2022

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	116.127.855,29	100%										
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%	
Multiestratégia	116.127.855,29	100%		0,03%	1,21%	3,30%	7,29%	8,90%	11,12%	15,16%	19,66%	
ATLANTIDA FI MULT	61.466.701,36	52,93%	ITAU	100%	0,01%	1,22%	3,41%	7,56%	9,33%	12,00%	17,84%	23,30%
ITAPEMA FI MULT	54.661.153,93	47,07%	SUL AMERICA	100%	0,06%	1,19%	3,18%	7,00%	8,44%	10,20%	12,44%	15,50%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.				0,04%	0,76%	5,12%	7,50%	13,62%	30,20%	39,38%	
Total	116.124.846,06	100%		0,03%	1,20%	3,29%	7,26%	8,87%	11,08%	15,02%	19,28%	
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.				0,04%	0,76%	5,12%	7,50%	13,62%	30,20%	39,38%	

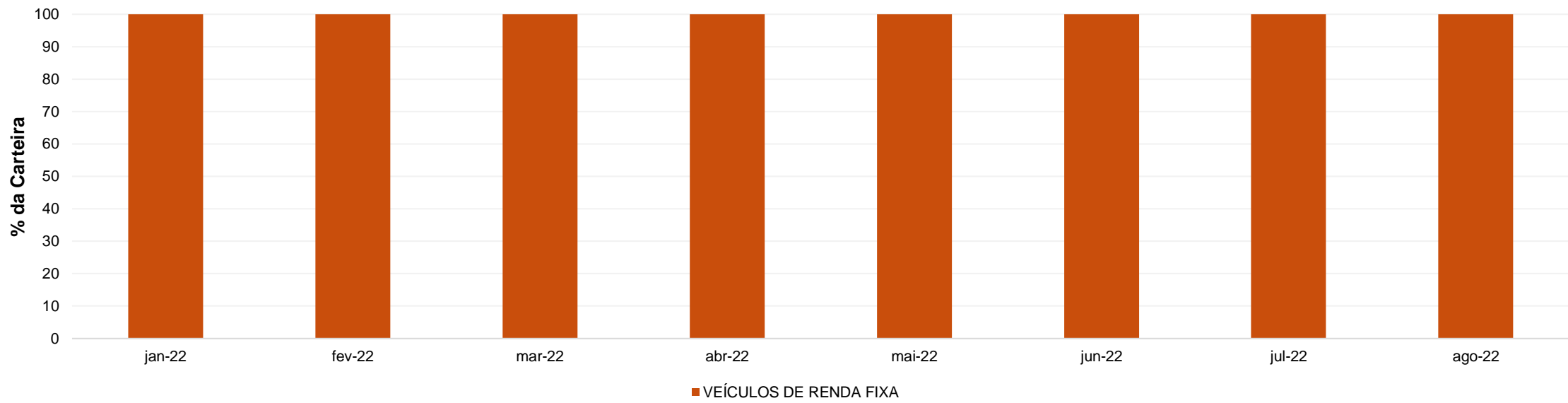
* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC. O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML 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.

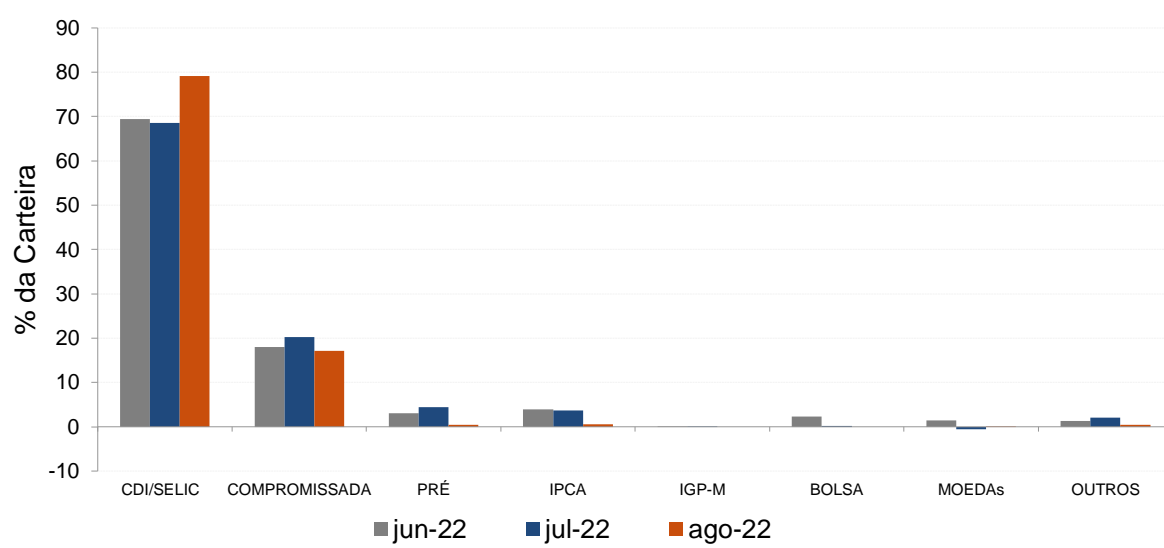
Distribuição da Carteira

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.

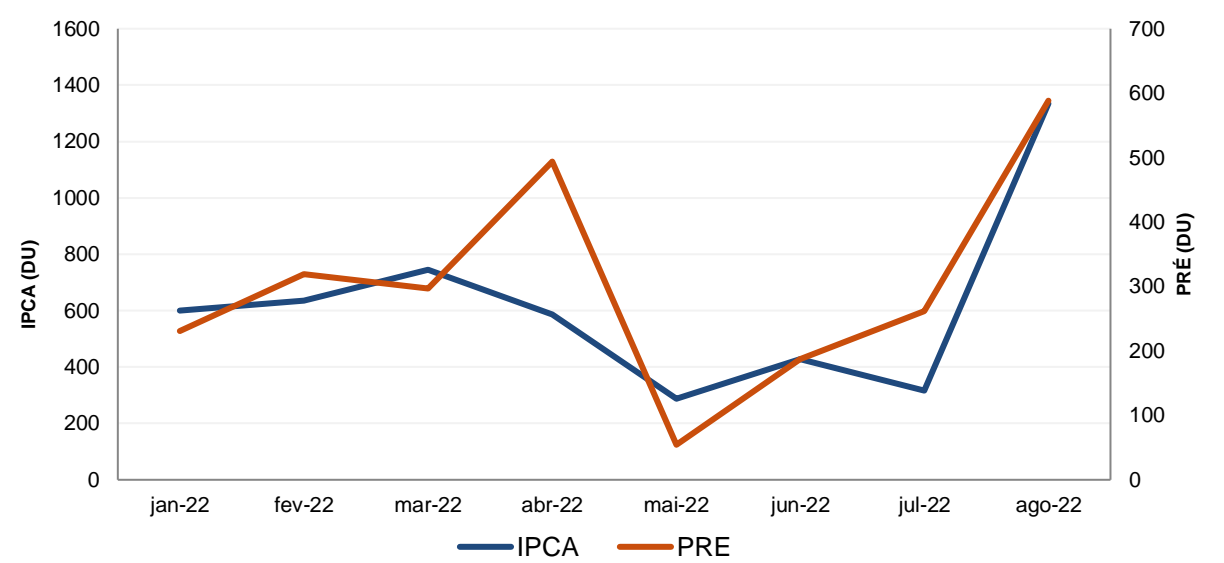
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

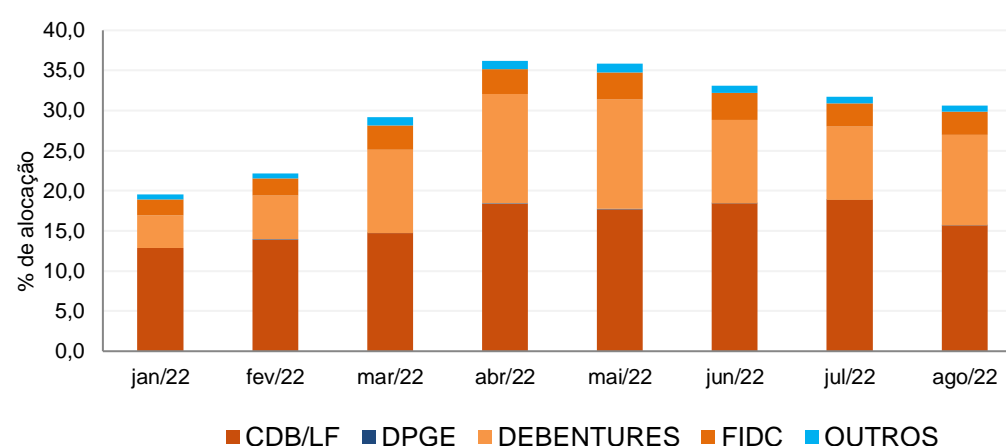
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	4.149,49	3,57	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.144,99	1,85	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.905,10	1,64	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.496,45	1,29	Faixa 2
BCO DAYCOVAL SA	1.011,31	0,87	Faixa 2
BCO TOYOTA BRASIL SA	765,36	0,66	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	707,12	0,61	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	671,00	0,58	Faixa 2
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	566,72	0,49	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	553,65	0,48	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
ACHL12	0,00	ACHÉ LABORATÓRIOS FARMACÊUTICOS S.A.	Sem Faixa	Faixa 1	31-jul-27	CDI	1,48%	SANTANDER RF REF DI FI
ACHL12	0,00	ACHÉ LABORATÓRIOS FARMACÊUTICOS S.A.	Sem Faixa	Faixa 1	31-jul-27	CDI	1,48%	SPECIAL RF REF DI FI
AMBP14	249,24	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTO	Sem Faixa	Faixa 2	25-ago-28	CDI	2,85%	ATLANTIDA FI MULT
AMBP14	85,94	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTO	Sem Faixa	Faixa 2	25-ago-28	CDI	2,94%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
CRCG12	0,00	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FII	Sem Faixa	Faixa 1	10-ago-27	CDI	1,77%	SANTANDER RF REF DI FI
CRCG12	111,48	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FII	Sem Faixa	Faixa 1	10-ago-27	CDI	1,75%	ATLANTIDA FI MULT
CRCG12	8,79	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FII	Sem Faixa	Faixa 1	10-ago-27	CDI	1,75%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
CRCG12	32,84	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FII	Sem Faixa	Faixa 1	10-ago-27	CDI	1,92%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV



RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/08/2022

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
AMBP14	25-ago-28	249.238	0,21%	CDI	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDI	31-ago-22	2,85%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
BSA316	05-ago-27	227.119	0,20%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	09-ago-22	1,30%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CRCG12	10-ago-27	111.483	0,10%	CDI	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉD	30-ago-22	1,75%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	11-ago-25	50.412	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	10-ago-22	1,00%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	10-ago-26	50.420	0,04%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	10-ago-22	1,25%	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	96.772	0,08%	Selic		09-ago-22	5,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2025-09-01	01-set-25	2.895.565	2,49%	Selic		08-ago-22	0,12%	0,12%	ATLANTIDA FI MULT

