

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/09/2022

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	115.755.990,33	100%										
Benchmark:	CDI					1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
Multiestatégia	115.755.990,33	100%			0,02%	1,06%	3,38%	6,47%	10,06%	11,44%	16,45%	19,70%
ATLANTIDA FI MULT	61.799.368,21	53,39%	ITAU	100%	0,01%	1,10%	3,46%	6,88%	10,54%	12,10%	19,12%	23,50%
ITAPEMA FI MULT	53.956.622,12	46,61%	SUL AMERICA	100%	0,02%	1,01%	3,28%	6,03%	9,53%	10,73%	13,73%	15,39%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					0,08%	-0,20%	3,12%	7,58%	11,99%	29,00%	39,03%
Total	115.755.990,33	100%			0,02%	1,06%	3,37%	6,45%	10,02%	11,40%	16,43%	19,40%
Benchmark:	IPCA + 4.5% a.a.					0,08%	-0,20%	3,12%	7,58%	11,99%	29,00%	39,03%

* 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.

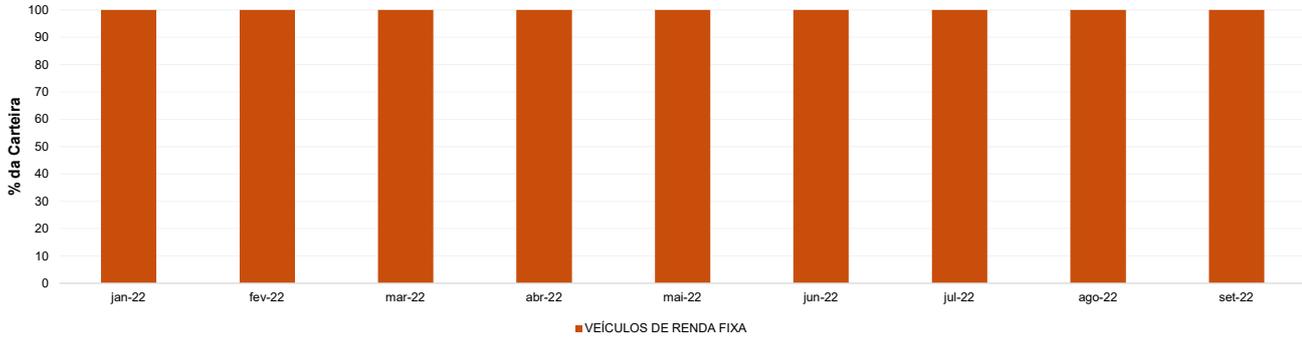
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

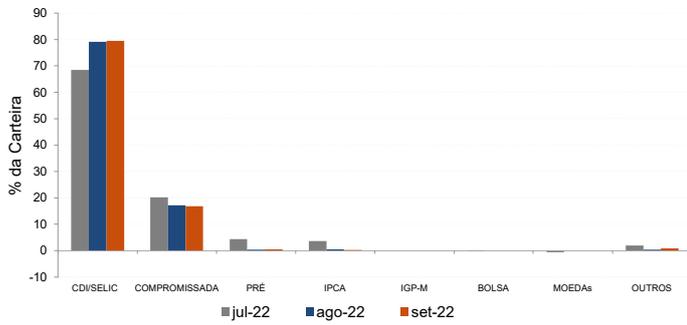
Distribuição da Carteira

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.

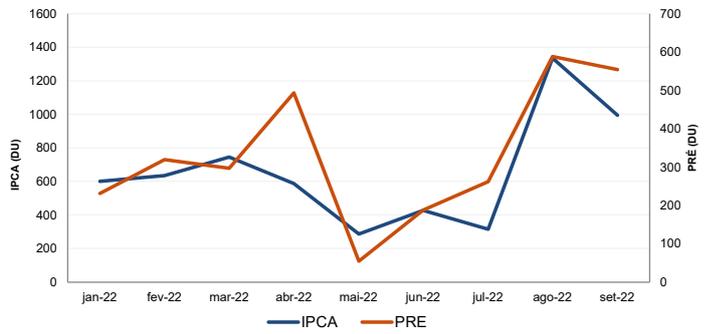
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

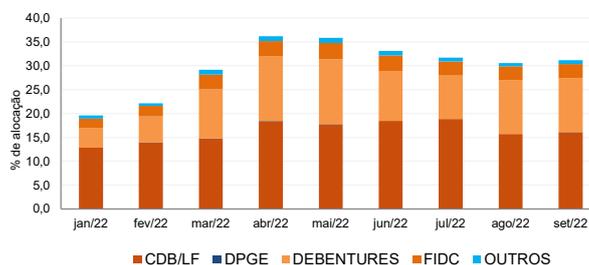
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	4.174,13	3,61	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.151,19	1,86	Faixa 1
BCO ITAU SA	1.862,32	1,61	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.492,06	1,29	Faixa 2
BCO DAYCOVAL SA	927,87	0,80	Faixa 2
BCO TOYOTA BRASIL SA	774,36	0,67	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	715,41	0,62	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	682,08	0,59	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	673,42	0,58	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	553,36	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
BGCE12	14,63	BONFIM GERAÇÃO E COMÉRCIO DE ENERGIA SPE	Sem Faixa	Faixa 3	15-dez-34	IPCA	10,51%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
CGCE12	14,63	CANTA GERACAO E COMERCIO DE ENERGIA SPE	Sem Faixa	Faixa 3	15-dez-34	IPCA	10,48%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
CGCE12	14,63	CANTA GERACAO E COMERCIO DE ENERGIA SPE	Sem Faixa	Faixa 3	15-dez-34	IPCA	10,51%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
LMTP16	0,00	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Sem Faixa	Faixa 2	25-set-25	CDI	1,49%	SANTANDER RF REF DI FI
LMTP26	6,89	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Sem Faixa	Faixa 2	25-set-27	CDI	1,70%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
RAIN12	14,63	PAU RAINHA GERACAO E COMERCIO DE ENERGIA	Sem Faixa	Faixa 3	15-dez-34	IPCA	10,48%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
RAIN12	14,63	PAU RAINHA GERACAO E COMERCIO DE ENERGIA	Sem Faixa	Faixa 3	15-dez-34	IPCA	10,51%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
SLZG12	14,63	SANTA LUZ GERACAO E COMERCIO DE ENERGIA	Sem Faixa	Faixa 3	15-dez-34	IPCA	10,48%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
TOTS14	0,00	TOTVS SA	Sem Faixa	Faixa 2	12-set-27	CDI	1,36%	SPECIAL RF REF DI FI
VVRT11	32,78	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FIN.	Sem Faixa	Faixa 1	15-set-28	CDI	1,80%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV
VVRT11	8,63	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FIN.	Sem Faixa	Faixa 1	15-set-28	CDI	1,75%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/09/2022

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
ALSO16	26-ago-27	112.534	0,10%	CDI	ALIANSCOE SONAE SHOPPING CENTERS S.A.	05-set-22	1,39%	Faixa 1	ATLANTIDA FI MULT
CDB CDI Mensal	13-set-24	19.133	0,02%	CDI	BCO BMG SA	14-set-22	1,83%	Faixa 3	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	16-set-24	100.551	0,09%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	16-set-22	1,05%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI Mensal	08-set-25	100.902	0,09%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	08-set-22	1,35%	Faixa 2	ATLANTIDA FI MULT
TUPY14	06-set-27	149.933	0,13%	CDI	TUPY SA	06-set-22	1,50%	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	134.527	0,12%	Selic		23-set-22	0,01%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	122.297	0,11%	Selic		15-set-22	0,02%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	61.149	0,05%	Selic		30-set-22	0,01%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT

