

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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	128.379.416,60	100%										
Benchmark:	CDI					1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
Multiestatégia	128.379.416,60	100%			1,50%	0,98%	3,85%	4,22%	8,38%	9,29%	12,60%	15,50%
ATLANTIDA 2 FI MULT	67.527.547,85	52,60%	ITAU	100%	1,53%	1,12%	3,38%	5,21%	10,10%	11,80%	-	-
ITAPEMA 2 FI MULT	60.851.868,74	47,40%	TAG INVESTIMENTOS	100%	1,57%	0,84%	4,36%	3,13%	6,55%	6,69%	-	-
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					0,16%	0,05%	3,62%	8,35%	13,06%	31,48%	43,06%
Total	128.378.632,91	100%			1,50%	0,98%	3,85%	4,17%	8,33%	9,23%	14,16%	15,63%
Benchmark:	IPCA + 5.5% a.a.					0,16%	0,05%	3,62%	8,35%	13,06%	31,48%	43,06%

* 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.

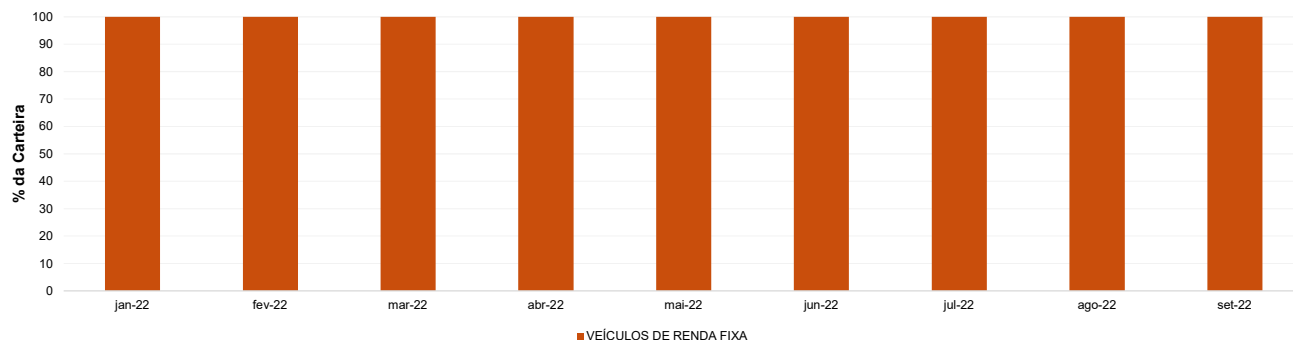
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

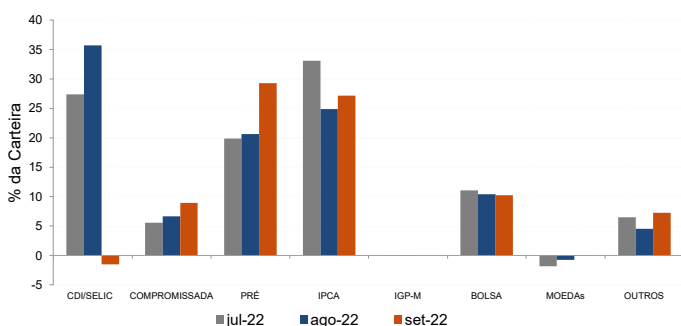
Distribuição da Carteira

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.

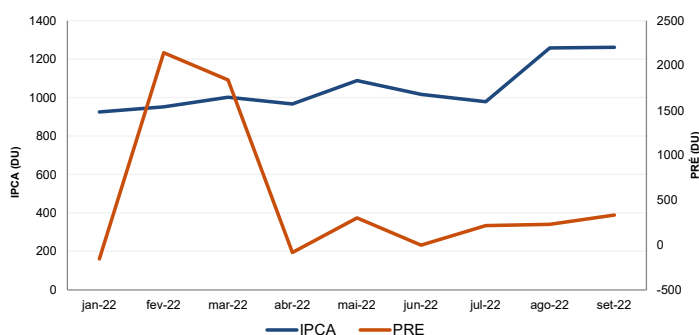
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
VALE3	Mineração	693,62	4,90	529,45	3,58
ELET3	Energia Elétrica	624,08	4,40	637,66	4,32
EQTL3	Energia Elétrica	485,91	3,43	495,37	3,35
ENGI11	Energia Elétrica	478,97	3,38	472,14	3,20
ITUB4	Intermediários Financeiros	458,77	3,24	449,99	3,05
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	426,38	3,01	584,58	3,96
SBSP3	Água e Saneamento	420,26	2,97	390,60	2,64
SHV US		375,11	2,65	551,14	3,73
IGTI11	Exploração de Imóveis	371,06	2,62	332,74	2,25
RENT3	Diversos	360,74	2,55	330,92	2,24

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

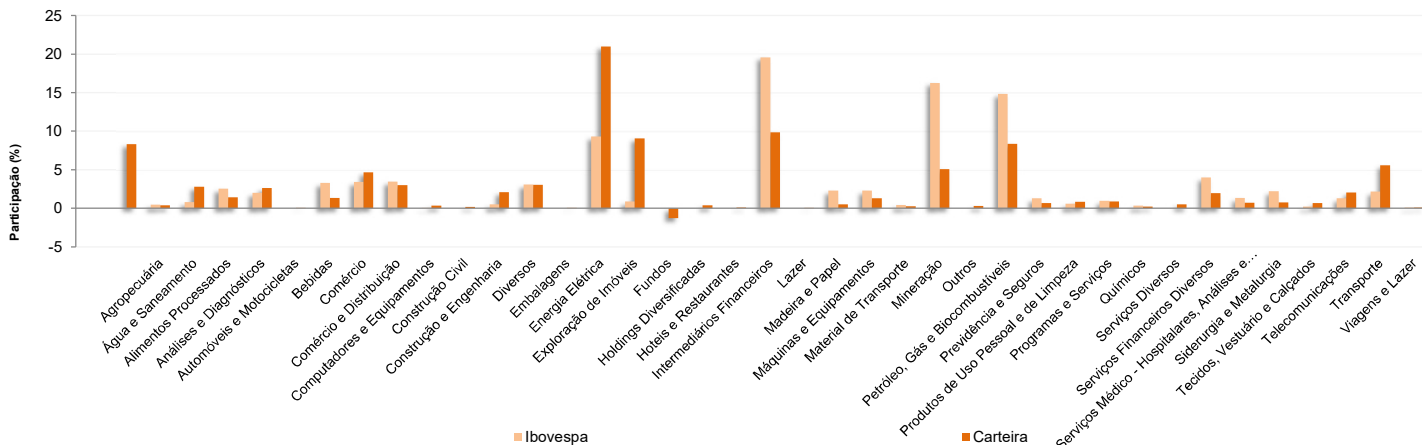
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRDE3	0,09	0,00	0,00	Sem Liquidez
BAUH4	24,72	0,17	0,02	11
MTSA4	30,82	0,22	0,02	3
SCAR3	24,94	0,18	0,00	2
IGT4	13,16	0,09	0,00	2
VALE3	693,62	4,90	0,00	1
ELET3	624,08	4,40	0,00	1
EQTL3	485,91	3,43	0,00	1
ENGI11	478,97	3,38	0,00	1
ITUB4	458,77	3,24	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.



Análises de Contrapartes

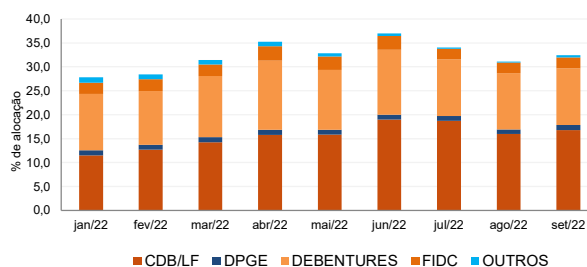
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	6.573,01	5,16	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.765,38	2,17	Faixa 1
BCO ITAU SA	2.322,00	1,82	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.614,34	1,27	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.416,11	1,11	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.192,09	0,94	Faixa 2
OMNI SA CRED FINANC INVEST	1.172,29	0,92	Faixa 4
ESTACIO PARTICIPACOES SA	1.125,13	0,88	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	1.061,64	0,83	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	1.021,67	0,80	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	3,88	BONFIM GERAÇÃO E COMÉRCIO DE ENERGIA SPE	Sem Faixa	Faixa 3	15-dez-34	IPCA	10,51%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
CGCE12	3,88	CANTA GERACAO E COMERCIO DE ENERGIA SPE	Sem Faixa	Faixa 3	15-dez-34	IPCA	10,48%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
CGCE12	3,88	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	10,29	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO COM	Sem Faixa	Faixa 2	25-set-27	CDI	1,70%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
RAIN12	3,88	PAU RAINHA GERACAO E COMERCIO DE ENERGIA	Sem Faixa	Faixa 3	15-dez-34	IPCA	10,48%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
RAIN12	3,88	PAU RAINHA GERACAO E COMERCIO DE ENERGIA	Sem Faixa	Faixa 3	15-dez-34	IPCA	10,51%	CAPITANIA GOVERNANCE CRED PRIV FI R
SLZG12	3,88	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	12,89	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FIN.	Sem Faixa	Faixa 1	15-set-28	CDI	1,75%	AUGME INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV
VVRT11	92,17	COMPANHIA SECURITIZADORA DE CRÉDITOS FIN.	Sem Faixa	Faixa 1	15-set-28	CDI	1,80%	ARX VINSON MASTER FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL MODERADO

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
CDB CDI Mensal	13-set-24	21.147	0,02%	CDI	BCO BMG SA	14-set-22	1,83%	Faixa 3	ATLANTIDA 2 FI MULT
LF CDI Mensal	08-set-25	151.352	0,12%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	08-set-22	1,35%	Faixa 2	ATLANTIDA 2 FI MULT
TUPY14	06-set-27	166.947	0,13%	CDI	TUPY SA	06-set-22	1,50%	Faixa 1	ATLANTIDA 2 FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2024-09-01	01-set-24	183.383	0,14%	Selic		23-set-22	0,03%	0,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	242.952	0,19%	IPCA		13-set-22	6,17%	6,21%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.070.566	0,84%	IPCA		01-set-22	5,89%	5,78%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2027-05-15	15-mai-27	16.300	0,01%	IPCA		16-set-22	5,88%	0,00%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	1.045.230	0,82%	IPCA		01-set-22	5,78%	5,70%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	774.842	0,61%	IPCA		02-set-22	5,80%	5,66%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	387.421	0,30%	IPCA		09-set-22	5,67%	5,69%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	2.098.182	1,65%	IPCA		01-set-22	5,78%	5,72%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	44.729	0,04%	IPCA		16-set-22	5,84%	5,80%	ATLANTIDA 2 FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	28.464	0,02%	IPCA		28-set-22	5,71%	5,77%	ATLANTIDA 2 FI MULT

