

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/08/2018

Este relatório apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e rentabilidade. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações contidas nesse relatório foram extraídas dos relatórios de risco 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	6.989.075,99	100,03%			0,71%	2,03%	3,84%	5,44%	8,21%	20,00%		
Benchmark:	CDI				0,57%	1,64%	3,24%	4,32%	6,84%	19,74%	36,66%	
CARTEIRA PRÓPRIA MM	5.892.750,23	84,34%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	5.892.750,23	84,34%		100%	0,74%	3,52%	5,78%	7,70%	11,05%	23,22%	-	
Benchmark:	CDI				0,57%	1,64%	3,24%	4,32%	6,84%	19,74%	36,66%	
RF REFERENCIADO DI	1.096.325,76	15,69%										
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.096.325,76	15,69%	BRADESCO	0,01%	0,01%	0,56%	1,63%	3,20%	4,27%	6,80%	19,72%	36,52%
Benchmark:	CDI				0,57%	1,64%	3,24%	4,32%	6,84%	19,74%	36,66%	
Total	6.987.146,35	100%			0,00%	0,71%	3,40%	5,40%	7,03%	9,83%	21,80%	
Benchmark:	CDI				0,57%	1,64%	3,24%	4,32%	6,84%	19,74%	36,66%	

* 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.

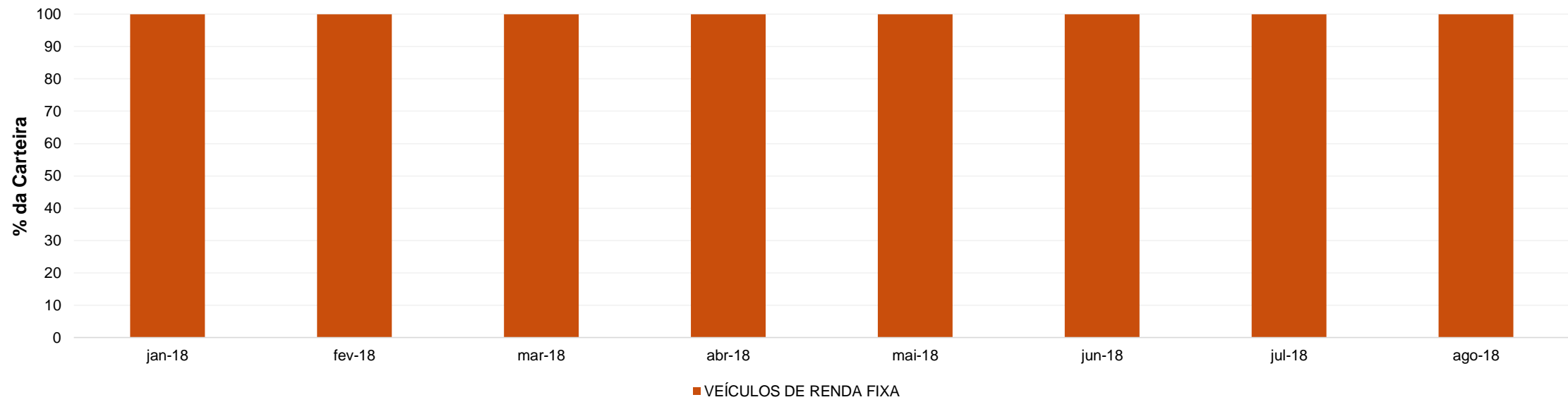


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.
A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

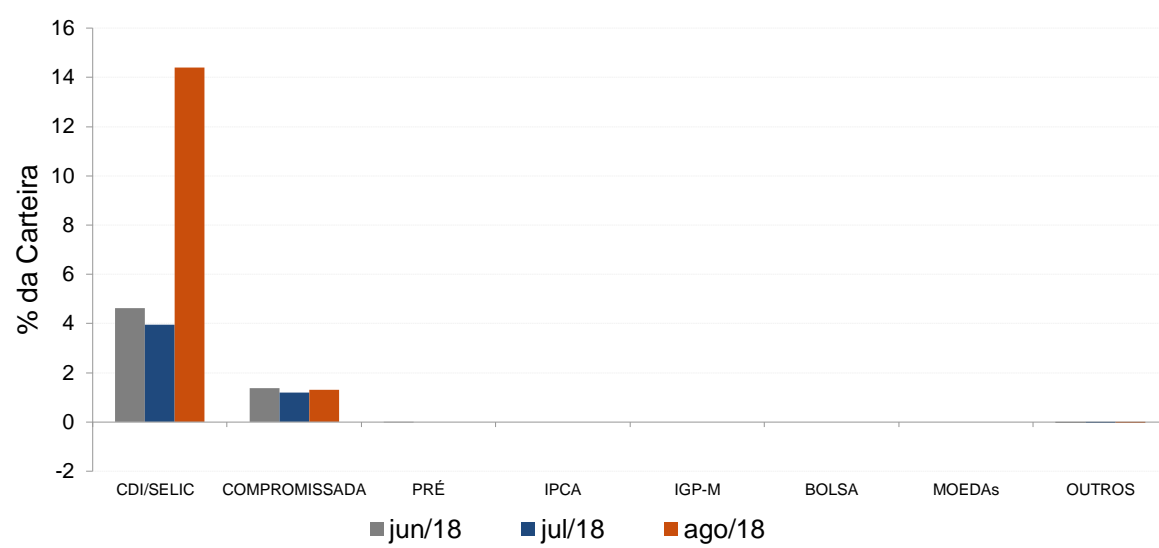
Distribuição da Carteira

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.

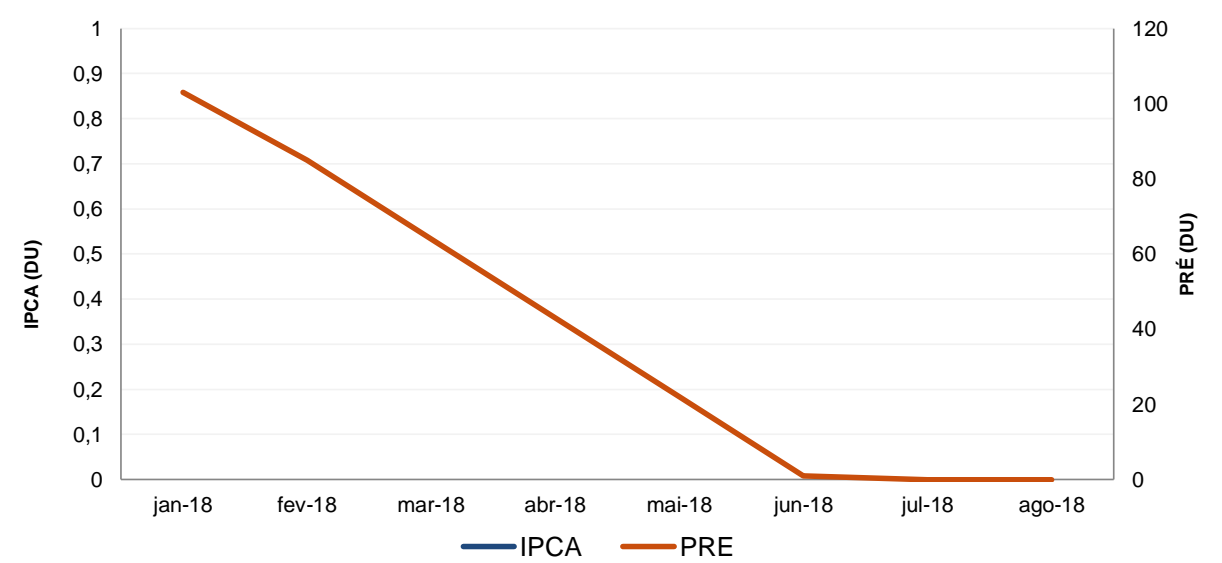
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/08/2018

Análises de Contrapartes

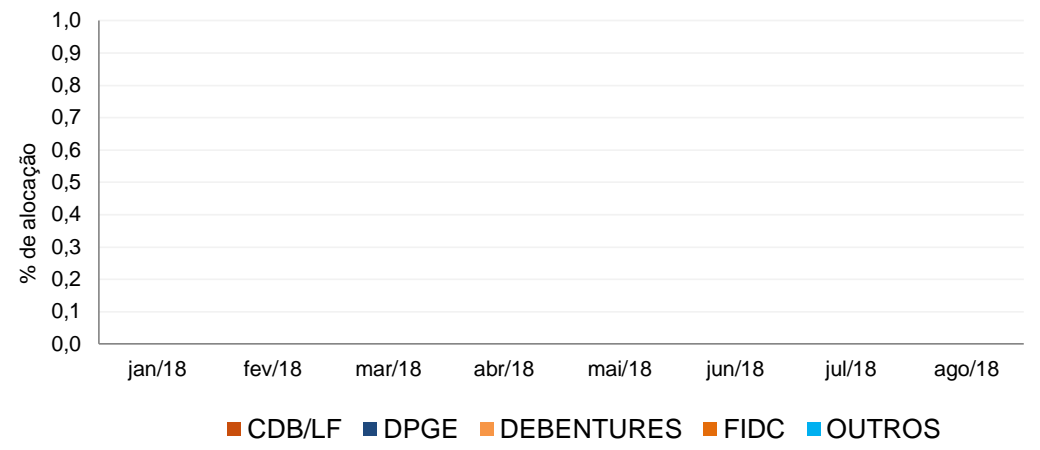
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
------	------	---	-------	---------	-----

* em mil R\$

Alocação Por Tipo de Crédito



Mudanças de Rating no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Anterior	Atual	Agência	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
Nenhuma mudança de rating encontrada.									



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 investidos.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2018-09-01	01-set-18	19.088	0,27%	Selic	24-ago-18	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	6.608	0,09%	Selic	07-ago-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	3.818	0,05%	Selic	28-ago-18	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	2.107	0,03%	Selic	07-ago-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	1.527	0,02%	Selic	31-ago-18	0,03%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	1.145	0,02%	Selic	31-ago-18	0,03%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	764	0,01%	Selic	29-ago-18	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6.108	0,09%	Selic	24-ago-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	30.539	0,44%	Selic	24-ago-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-09-01	01-set-20	8.148	0,12%	Selic	24-ago-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-09-01	01-set-20	4.199	0,06%	Selic	28-ago-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	30.536	0,44%	Selic	24-ago-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	183.206	2,62%	Selic	31-ago-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	45.801	0,66%	Selic	24-ago-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	19.081	0,27%	Selic	24-ago-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	901	0,01%	Selic	21-ago-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	10.684	0,15%	Selic	24-ago-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	992	0,01%	Selic	21-ago-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	15.260	0,22%	Selic	24-ago-18	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	3.433	0,05%	Selic	27-ago-18	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	76	0,00%	Selic	29-ago-18	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	5.340	0,08%	Selic	24-ago-18	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	2.289	0,03%	Selic	29-ago-18	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	19.912	0,29%	Selic	31-ago-18	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	8.159	0,12%	Selic	08-ago-18	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	6.100	0,09%	Selic	24-ago-18	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	3.434	0,05%	Selic	21-ago-18	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	1.825	0,03%	Selic	17-ago-18	0,03%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	1.825	0,03%	Selic	17-ago-18	0,03%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	152	0,00%	Selic	17-ago-18	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

