

RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

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 | ALOCAÇÃO (R\$) | GESTOR | % PL FUNDO | RISCO DE MERCADO | RENTABILIDADE* | | | | | | | | |
|---------------------------------------|---------------------|----------------|-------------|------------------|----------------|--------------|--------------|--------------|--------------|---------------|---------------|--------|--|
| | | | | | 1M | 3M | 6M | ANO | 12M | 24M | 36M | | |
| Renda Fixa | 6.489.038,52 | 100,01% | | | | | | | | | | | |
| Benchmark: | IPCA + 4.33% a.a. | | | | 0,30% | 2,64% | 4,47% | 5,82% | 8,67% | 16,14% | 32,04% | | |
| Renda Fixa CDI | 6.489.038,52 | 100,01% | | 0,04% | 0,67% | 1,82% | 3,47% | 4,53% | 7,05% | 20,57% | | | |
| AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES | 1.005.974,19 | 15,50% | AF INVEST | 0,04% | 0,26% | 0,68% | 1,86% | 3,75% | 5,06% | 7,92% | 22,61% | 40,91% | |
| BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV | 2.742.791,77 | 42,27% | BTG PACTUAL | 0,10% | 0,02% | 0,67% | 1,90% | 3,72% | 4,99% | 7,85% | 23,90% | 42,36% | |
| ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI | 25.217,05 | 0,39% | ITAU | 0,00% | 0,00% | 0,56% | 1,60% | 3,16% | 4,23% | 6,70% | 19,56% | 36,58% | |
| FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV | 2.715.055,51 | 41,85% | VOTORANTIM | 0,20% | 0,02% | 0,65% | 1,75% | 3,35% | 4,42% | 6,98% | 20,58% | 37,87% | |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,57% | 1,64% | 3,24% | 4,32% | 6,84% | 19,74% | 36,66% | | |
| Total | 6.488.094,44 | 100% | | 0,04% | 0,64% | 1,76% | 3,34% | 4,39% | 6,91% | 20,41% | 37,48% | | |
| Benchmark: | IPCA + 4.33% a.a. | | | | 0,30% | 2,64% | 4,47% | 5,82% | 8,67% | 16,14% | 32,04% | | |

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatórios 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.

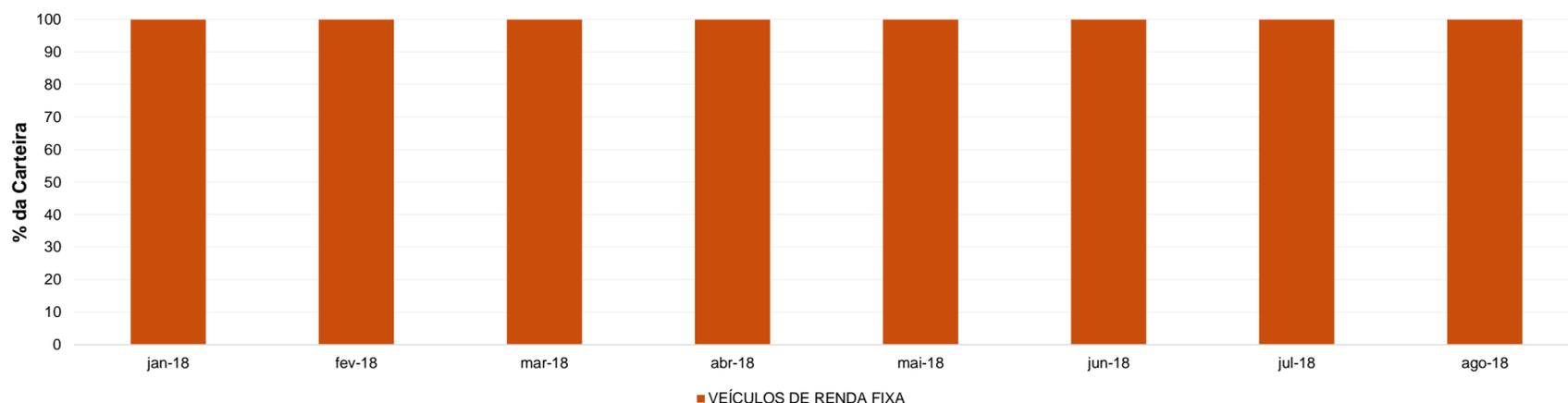
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

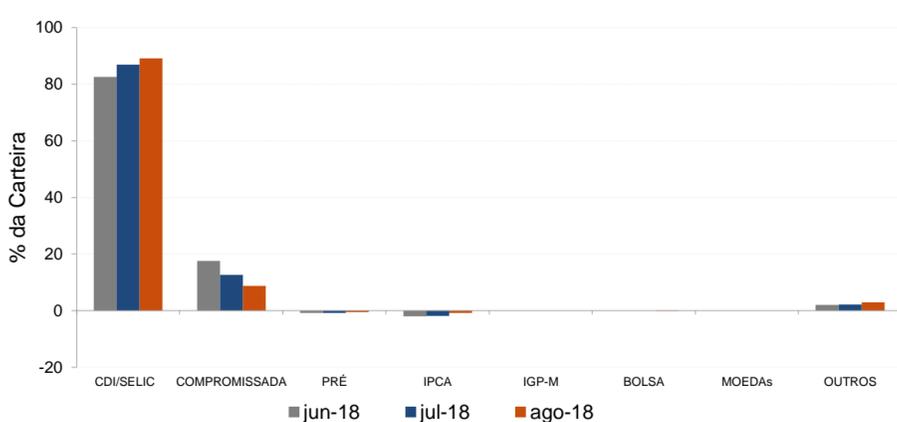
Distribuição da Carteira

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.

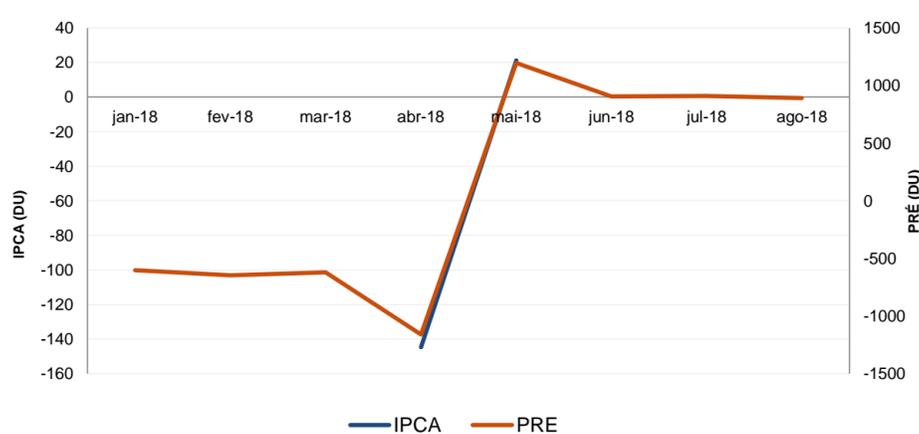
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | Setor | Atual* | % | Anterior* | % |
|-------|---------------------------------|--------|-------|-----------|---|
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 4,82 | 55,76 | 0,00 | |
| ARZZ3 | Comércio | 1,29 | 14,92 | 0,00 | |
| ITSA4 | Intermediários Financeiros | 0,57 | 6,56 | 0,00 | |
| BRFS3 | Alimentos Processados | 0,26 | 3,05 | 0,00 | |
| GOLL4 | Transporte | 0,25 | 2,94 | 0,00 | |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 0,24 | 2,83 | 0,00 | |
| PMAM3 | Siderurgia e Metalurgia | 0,15 | 1,68 | 0,00 | |
| CCRO3 | Transporte | 0,13 | 1,49 | 0,00 | |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 0,12 | 1,42 | 0,00 | |
| CMIG4 | Energia Elétrica | 0,11 | 1,28 | 0,00 | |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

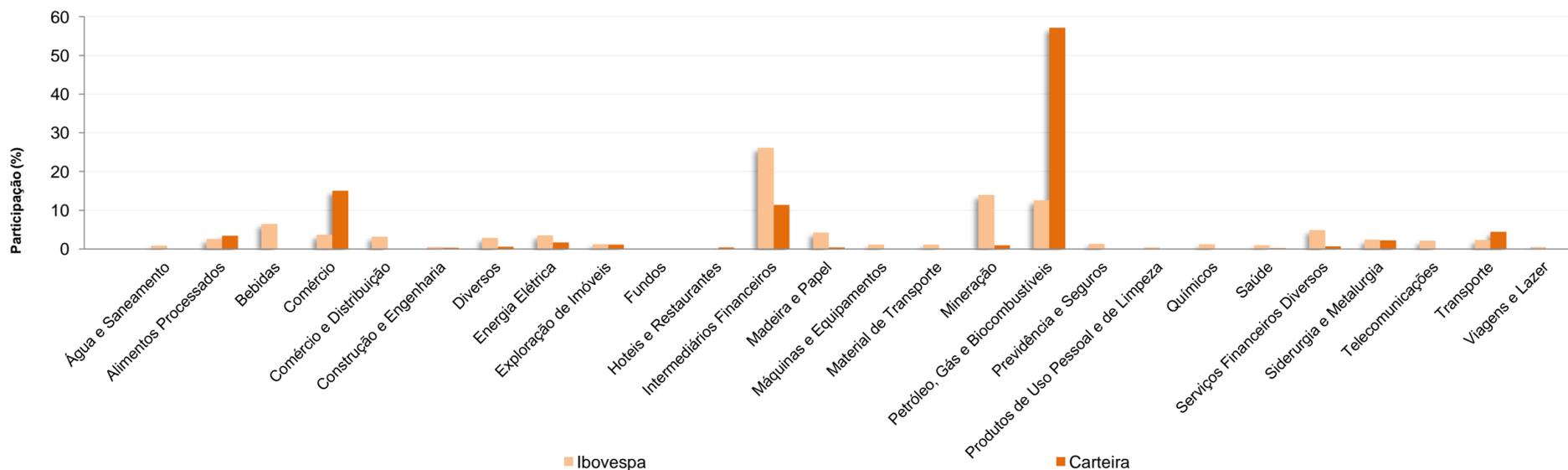
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|-------|--------|-------|--------------|--------------------|
| PETR4 | 4,82 | 55,76 | 0,00 | 1 |
| ARZZ3 | 1,29 | 14,92 | 0,00 | 1 |
| ITSA4 | 0,57 | 6,56 | 0,00 | 1 |
| BRFS3 | 0,26 | 3,05 | 0,00 | 1 |
| GOLL4 | 0,25 | 2,94 | 0,00 | 1 |
| BBDC4 | 0,24 | 2,83 | 0,00 | 1 |
| PMAM3 | 0,15 | 1,68 | 0,00 | 1 |
| CCRO3 | 0,13 | 1,49 | 0,00 | 1 |
| ITUB4 | 0,12 | 1,42 | 0,00 | 1 |
| CMIG4 | 0,11 | 1,28 | 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

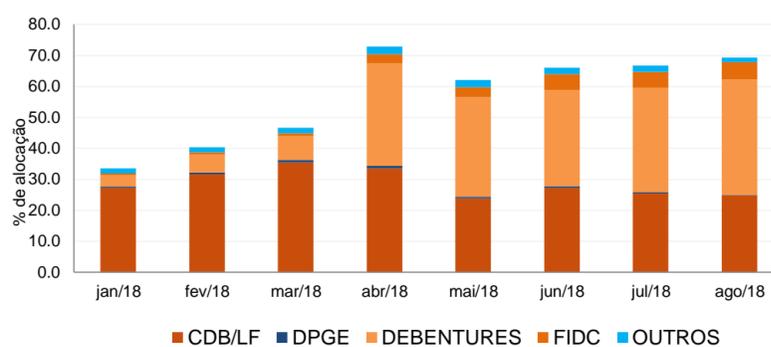
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

| Nome | MtM* | % | Fitch | Moody's | S&P |
|-----------------------------------|--------|------|-----------|---------|-------|
| BCO VOTORANTIM SA | 313,38 | 4,80 | | Aa3.br | brAAA |
| BCO BRADESCO SA | 269,04 | 4,12 | AAA (bra) | Aa1.br | brAAA |
| BCO SAFRA SA | 234,11 | 3,59 | | Aa1.br | brAAA |
| BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM | 185,11 | 2,84 | AAA (bra) | Aa2.br | brAAA |
| LOJAS AMERICANAS SA | 136,54 | 2,09 | AA (bra) | | |
| BCO BRASIL SA | 114,31 | 1,75 | AA (bra) | Aa1.br | |
| SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA | 113,50 | 1,74 | | | |
| COMPANHIA SECURITIZADORA CREDIT | 94,20 | 1,44 | | | |
| NATURA COSMETICOS SA | 90,93 | 1,39 | AA (bra) | | brAAA |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 90,24 | 1,38 | AA (bra) | Aaa.br | brAAA |

* 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 |
|------------------|-----------------|-------------------------------|-----------|-----------|---------|-----------|--------|---------|----------------------------------|
| CEMA18 | 1,73 | CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR | AA+ (bra) | AA- (bra) | Fitch | 15-set-22 | CDI | 107,00% | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |



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 Privados | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | Emissor | Data Compra | Tx de Compra | Rating | Agência | Veículo |
|------------------|------------|--------|-----------------|-----------|--------------------------------------|-------------|--------------|-----------|---------|-----------------------------------|
| CDB CDI | 13-ago-21 | 8.210 | 0,13% | CDI | BCO BONSUCESO SA | 29-ago-18 | 120,00% | BBB (bra) | Fitch | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |
| CDB CDI | 20-ago-21 | 8.217 | 0,13% | CDI | BCO BONSUCESO SA | 24-ago-18 | 120,00% | BBB (bra) | Fitch | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |
| CDB CDI | 20-ago-21 | 4.110 | 0,06% | CDI | BCO BONSUCESO SA | 23-ago-18 | 120,00% | BBB (bra) | Fitch | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |
| CDB CDI | 20-ago-21 | 2.056 | 0,03% | CDI | BCO BONSUCESO SA | 22-ago-18 | 120,00% | BBB (bra) | Fitch | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |
| CELP15 | 25-abr-23 | 801 | 0,01% | CDI | CENTRAIS ELETRICAS PARA SA CELPA | 30-ago-18 | 1,11% | AA- (bra) | Fitch | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| CEMT18 | 15-fev-21 | 820 | 0,01% | CDI | ENERGISA MATO GROSSO DISTRIBUIDO | 21-ago-18 | 0,79% | AA+ (bra) | Fitch | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| CPEL15 | 13-mai-19 | 464 | 0,01% | CDI | CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL | 14-ago-18 | 111,50% | AA- (bra) | Fitch | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| FLRY14 | 27-abr-21 | 3 | 0,00% | CDI | FLEURY SA | 02-ago-18 | 0,35% | Aa2.br | Moody's | ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI |
| GEPA18 | 15-mar-23 | 736 | 0,01% | CDI | RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA | 22-ago-18 | 106,75% | Aa1.br | Moody's | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| IOCH18 | 26-mar-23 | 2.156 | 0,03% | CDI | IOCHPE MAXION SA | 31-ago-18 | 1,25% | brAAA | S&P | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| IOCH18 | 26-mar-23 | 862 | 0,01% | CDI | IOCHPE MAXION SA | 14-ago-18 | 1,42% | brAAA | S&P | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LF CDI | 31-jul-19 | 2.190 | 0,03% | CDI | BCO ITAU SA | 22-ago-18 | 102,10% | Aa1.br | Moody's | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LF CDI | 21-ago-20 | 39.933 | 0,61% | CDI | BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVE | 21-ago-18 | 104,75% | AA (bra) | Fitch | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LF CDI | 21-ago-20 | 19.967 | 0,31% | CDI | BCO VOTORANTIM SA | 21-ago-18 | 104,50% | Aa3.br | Moody's | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LF CDI | 24-ago-20 | 29.928 | 0,46% | CDI | BCO ESTADO RIO GRANDE SUL SA | 24-ago-18 | 106,50% | A (bra) | Fitch | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LF CDI | 01-ago-25 | 180 | 0,00% | CDI | BCO BRADESCO SA | 01-ago-18 | 108,75% | Aa1.br | Moody's | ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI |
| LF CDI Anual | 21-set-18 | 1.279 | 0,02% | CDI | BCO TOYOTA BRASIL SA | 21-ago-18 | 105,50% | brAAA | S&P | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LORT18 | 10-set-20 | 911 | 0,01% | CDI | LOCALIZA RENT A CAR SA | 14-ago-18 | 109,50% | brAAA | S&P | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| MRVEA2 | 05-jul-23 | 6.294 | 0,10% | CDI | MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES SA | 02-ago-18 | 1,40% | AA- (bra) | Fitch | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |
| MULP13 | 15-out-20 | 928 | 0,01% | CDI | MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILI | 30-ago-18 | 0,39% | brAAA | S&P | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| NATU27 | 25-set-21 | 6.311 | 0,10% | CDI | NATURA COSMETICOS SA | 23-ago-18 | 1,09% | brAAA | S&P | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| NATU27 | 25-set-21 | 1.191 | 0,02% | CDI | NATURA COSMETICOS SA | 23-ago-18 | 1,00% | brAAA | S&P | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |
| NATU27 | 25-set-21 | 645 | 0,01% | CDI | NATURA COSMETICOS SA | 23-ago-18 | 1,00% | brAAA | S&P | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |
| NATU27 | 25-set-21 | 463 | 0,01% | CDI | NATURA COSMETICOS SA | 23-ago-18 | 1,00% | brAAA | S&P | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |
| NATU27 | 25-set-21 | 26 | 0,00% | CDI | NATURA COSMETICOS SA | 23-ago-18 | 1,00% | brAAA | S&P | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |
| PETR35 | 15-ago-22 | 21.976 | 0,34% | CDI | PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 13-ago-18 | 106,75% | brA+ | S&P | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| PETR35 | 15-ago-22 | 10.221 | 0,16% | CDI | PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 22-ago-18 | 106,75% | brA+ | S&P | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| RDCO18 | 01-ago-21 | 15.178 | 0,23% | CDI | RODOVIAS COLINAS SA | 21-ago-18 | 2,35% | brAA+ | S&P | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |
| RILA11 | 20-dez-20 | 6.204 | 0,10% | CDI | RIOLOAN 2 COMPANHIA SECURITIZADOR | 30-ago-18 | 130,00% | AA (bra) | Fitch | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| SAPR13 | 15-nov-18 | 455 | 0,01% | CDI | COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SAN | 21-ago-18 | 110,80% | Aa2.br | Moody's | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| SMFT23 | 15-dez-21 | 449 | 0,01% | CDI | SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA S/ | 17-ago-18 | 2,25% | A (bra) | Fitch | AF INVEST FI RF CRED PRIV GERAES |
| SSED11 | 15-ago-21 | 15.475 | 0,24% | CDI | SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA | 15-ago-18 | 0,75% | AA (bra) | Fitch | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |

| Títulos Públicos | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | | Data Compra | Tx de Compra | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|---------|-----------------|-----------|--|-------------|--------------|----------------|-----------------------------------|
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 119.576 | 1,83% | Selic | | 30-ago-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 984 | 0,02% | Selic | | 21-ago-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 907 | 0,01% | Selic | | 30-ago-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 598 | 0,01% | Selic | | 29-ago-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 58 | 0,00% | Selic | | 27-ago-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 49.819 | 0,76% | Selic | | 30-ago-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 9.956 | 0,15% | Selic | | 27-ago-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 61.380 | 0,94% | Selic | | 13-ago-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 29.919 | 0,46% | Selic | | 27-ago-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 60.171 | 0,92% | Selic | | 13-ago-18 | 0,02% | 0,02% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 7.965 | 0,12% | Selic | | 30-ago-18 | 0,02% | 0,02% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 309 | 0,00% | Selic | | 15-ago-18 | 0,02% | 0,02% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 174 | 0,00% | Selic | | 15-ago-18 | 0,02% | 0,02% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 79.926 | 1,23% | Selic | | 16-ago-18 | 0,02% | 0,02% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 10.991 | 0,17% | Selic | | 15-ago-18 | 0,02% | 0,02% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2023-09-01 | 01-set-23 | 2.005 | 0,03% | Selic | | 16-ago-18 | 0,02% | 0,02% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 192.734 | 2,95% | Selic | | 17-ago-18 | 31,31% | 0,00% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 50.111 | 0,77% | Selic | | 17-ago-18 | 31,31% | 0,00% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 50.111 | 0,77% | Selic | | 17-ago-18 | 31,31% | 0,00% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 23.128 | 0,35% | Selic | | 31-ago-18 | 0,02% | 0,00% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 19.273 | 0,30% | Selic | | 31-ago-18 | 0,02% | 0,00% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |