

RBSPREV - RBSPREV PGA

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	746.242,34	100,06%				0,50%	1,41%	2,80%	3,81%	6,32%	19,05%	36,00%	
Benchmark:	CDI					0,57%	1,64%	3,24%	4,32%	6,84%	19,74%	36,66%	
RF CRÉDITO	577.088,92	77,38%											
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	577.088,92	77,38%	VOTORANTIM	0,18%	0,00%	0,56%	1,66%	3,24%	4,32%	6,90%	20,19%	37,61%	
Benchmark:	CDI					0,57%	1,64%	3,24%	4,32%	6,84%	19,74%	36,66%	
RF REFERENCIADO DI	169.153,42	22,68%											
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	169.153,42	22,68%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,55%	1,59%	3,13%	4,18%	6,66%	19,41%	35,96%	
Benchmark:	CDI					0,57%	1,64%	3,24%	4,32%	6,84%	19,74%	36,66%	
Total	745.806,64	100%				0,00%	0,50%	1,41%	2,80%	3,81%	6,32%	19,05%	36,00%
Benchmark:	CDI					0,57%	1,64%	3,24%	4,32%	6,84%	19,74%	36,66%	

* 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.

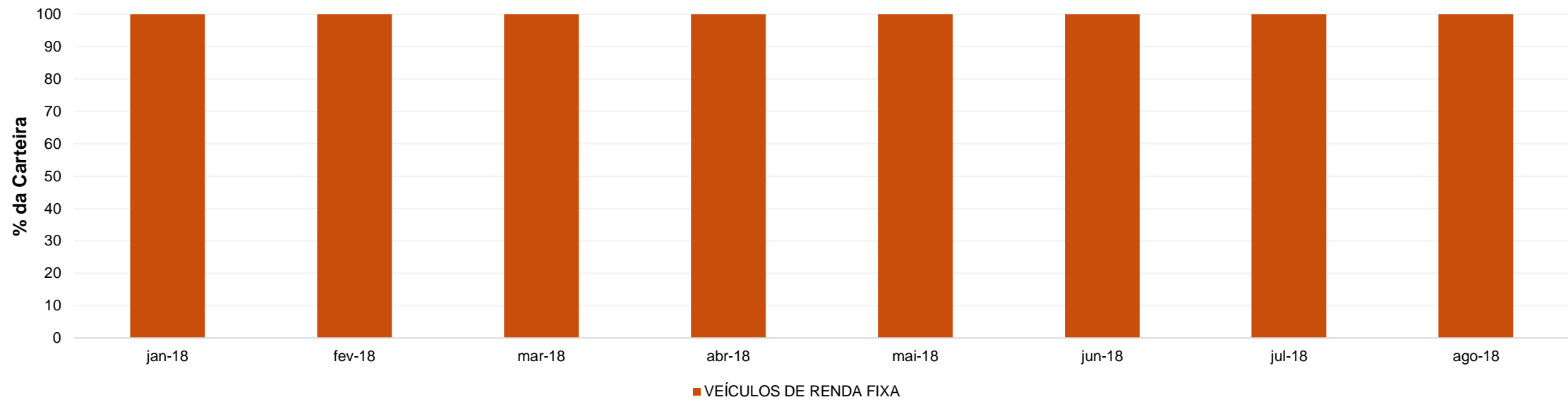


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma. Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se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

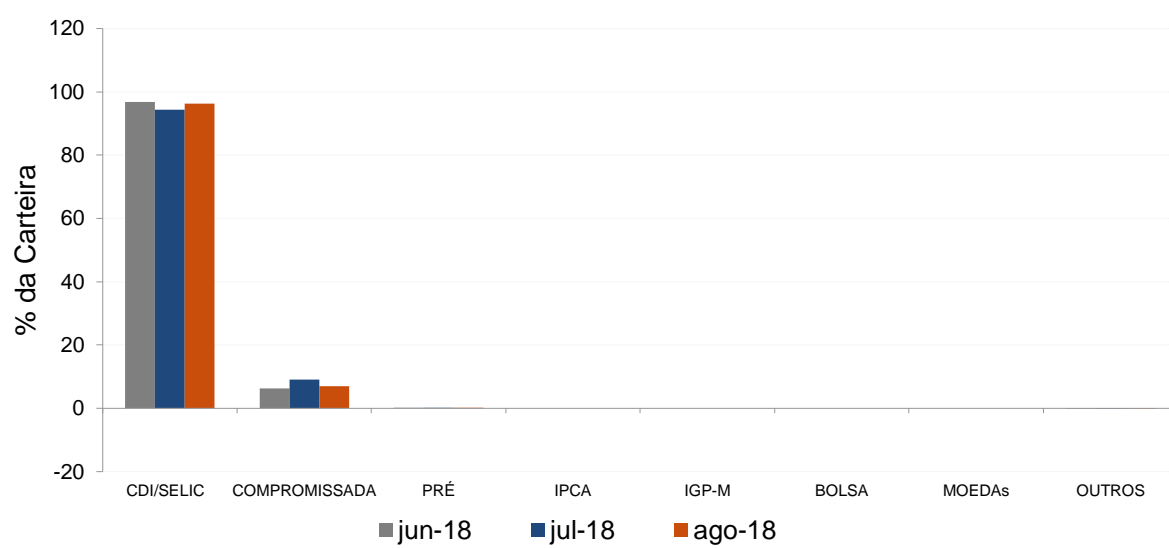
Distribuição da Carteira

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.

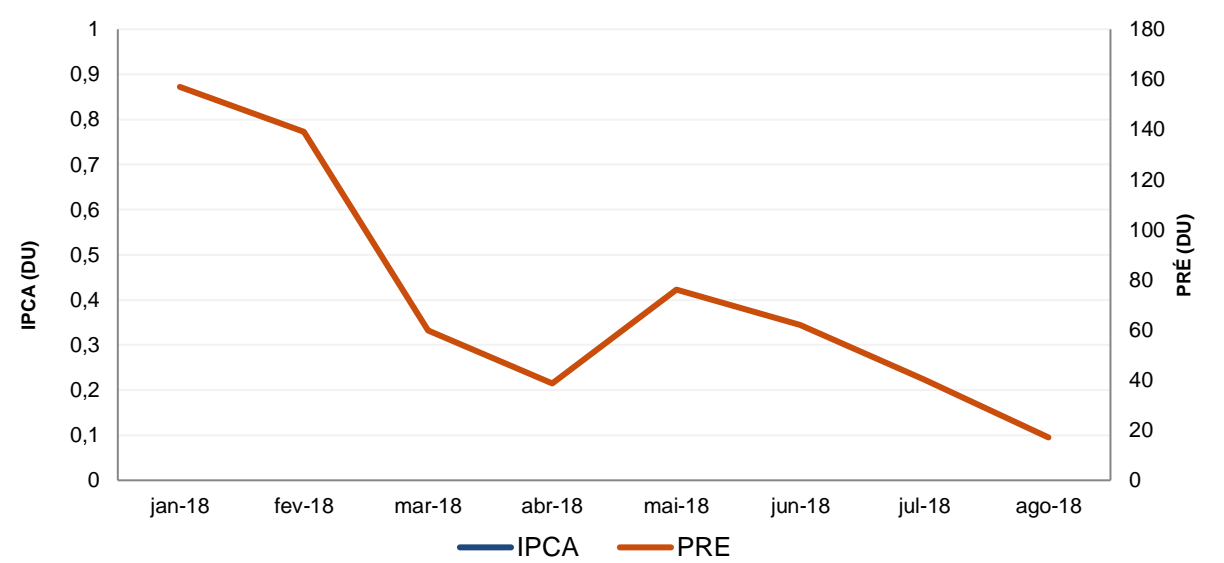
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/08/2018

Análises de Contrapartes

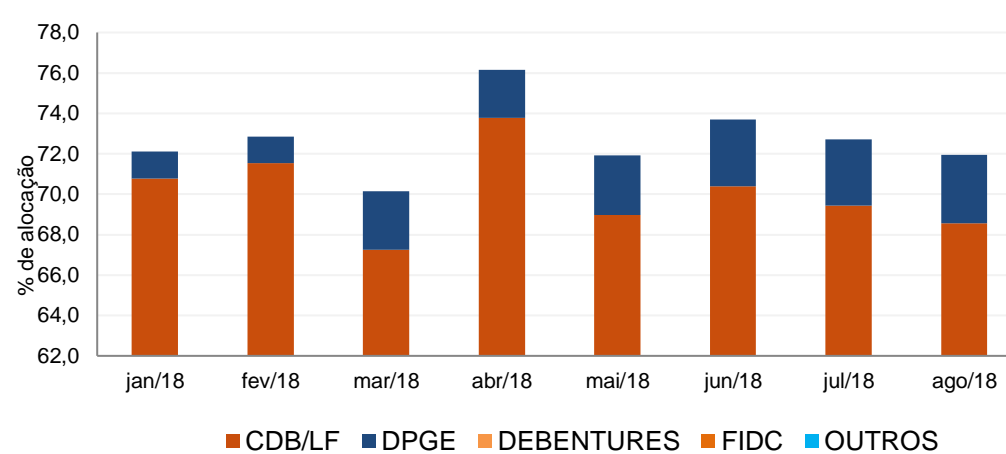
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM	110,61	14,02	AAA (bra)	Aa2.br	brAAA
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	88,94	11,27			brAAA
BCO VOTORANTIM SA	84,65	10,73		Aa3.br	brAAA
BCO SAFRA SA	76,10	9,64		Aa1.br	brAAA
BCO BRADESCO SA	58,75	7,44	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL IN\	52,65	6,67	AA (bra)	Aa1.br	
BCO VOLKSWAGEN SA	27,01	3,42			brAAA
BCO BBM SA	21,23	2,69	AAA (bra)	Aaa.br	
BCO GMAC SA	16,71	2,12	AAA (bra)		
BCO ITAU SA	12,66	1,60	AAA (bra)	Aa1.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
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. Ambima	Veículo
LFT 2018-09-01	01-set-18	4	0,00%	Selic	07-ago-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	3	0,00%	Selic	07-ago-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	3	0,00%	Selic	07-ago-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	2	0,00%	Selic	07-ago-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	1	0,00%	Selic	07-ago-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	1	0,00%	Selic	07-ago-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	205	0,03%	Selic	24-ago-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	4.105	0,52%	Selic	24-ago-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	616	0,08%	Selic	24-ago-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	205	0,03%	Selic	07-ago-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	8.827	1,12%	Selic	22-ago-18	0,02%	0,01%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LFT 2022-03-01	01-mar-22	3.078	0,39%	Selic	24-ago-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	212	0,03%	Selic	21-ago-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	144	0,02%	Selic	14-ago-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.026	0,13%	Selic	24-ago-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	233	0,03%	Selic	21-ago-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.832	0,36%	Selic	31-ago-18	0,02%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	1.845	0,23%	Selic	08-ago-18	0,02%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	820	0,10%	Selic	21-ago-18	0,02%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	461	0,06%	Selic	17-ago-18	0,03%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	461	0,06%	Selic	17-ago-18	0,03%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-09-01	01-set-24	39	0,00%	Selic	17-ago-18	0,02%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

