

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/12/2018

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	6.873.515,20	100,03%				0,41%	2,07%	4,74%	9,36%	9,36%	20,48%	
Benchmark:	CDI					0,49%	1,54%	3,15%	6,42%	6,42%	17,01%	33,40%
CARTEIRA PRÓPRIA MM	5.992.916,71	87,21%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	5.992.916,71	87,21%		100%		0,40%	2,16%	4,93%	10,73%	10,73%	23,07%	-
Benchmark:	CDI					0,49%	1,54%	3,15%	6,42%	6,42%	17,01%	33,40%
RF REFERENCIADO DI	880.598,49	12,81%										
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	880.598,49	12,81%	BRADESCO	0,01%	0,00%	0,49%	1,53%	3,13%	6,36%	6,36%	17,03%	33,25%
Benchmark:	CDI					0,49%	1,54%	3,15%	6,42%	6,42%	17,01%	33,40%
Total	6.871.735,42	100%				0,00%	0,41%	2,07%	4,74%	9,36%	9,36%	20,48%
Benchmark:	CDI					0,49%	1,54%	3,15%	6,42%	6,42%	17,01%	33,40%

* 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.

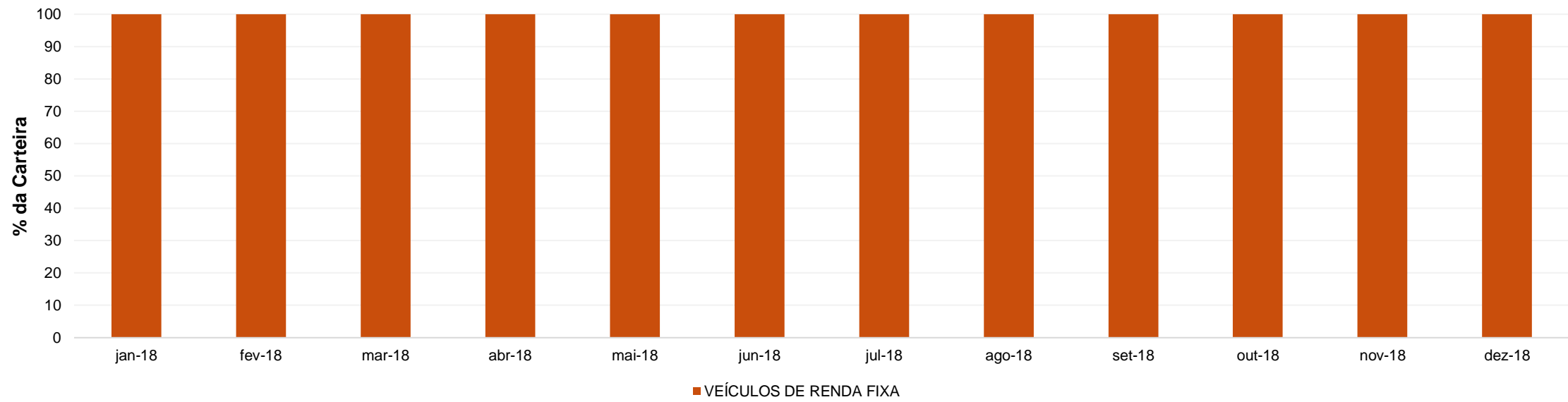


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma. Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se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

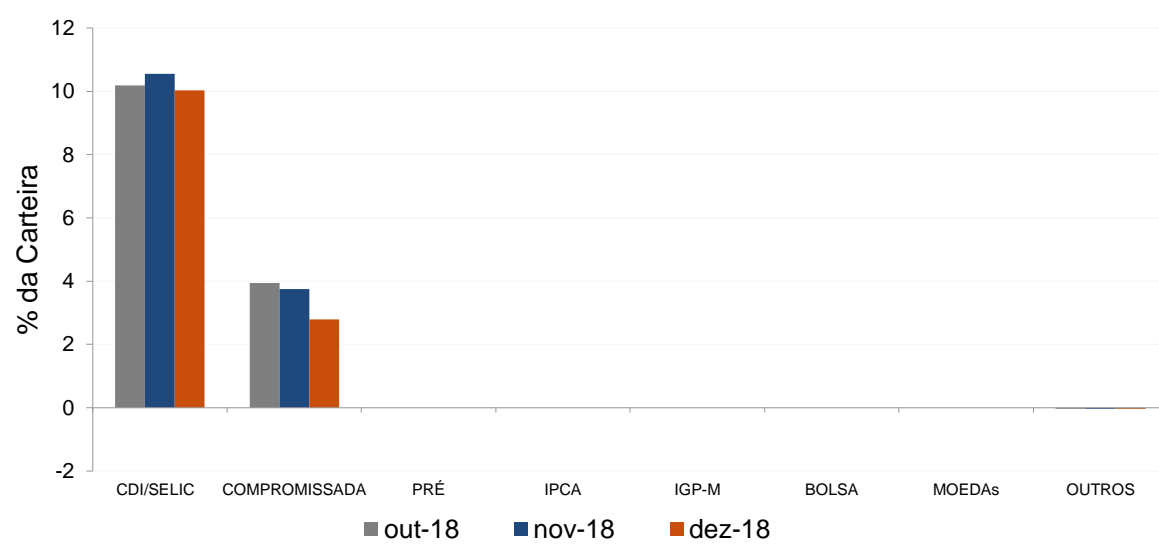
Distribuição da Carteira

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.

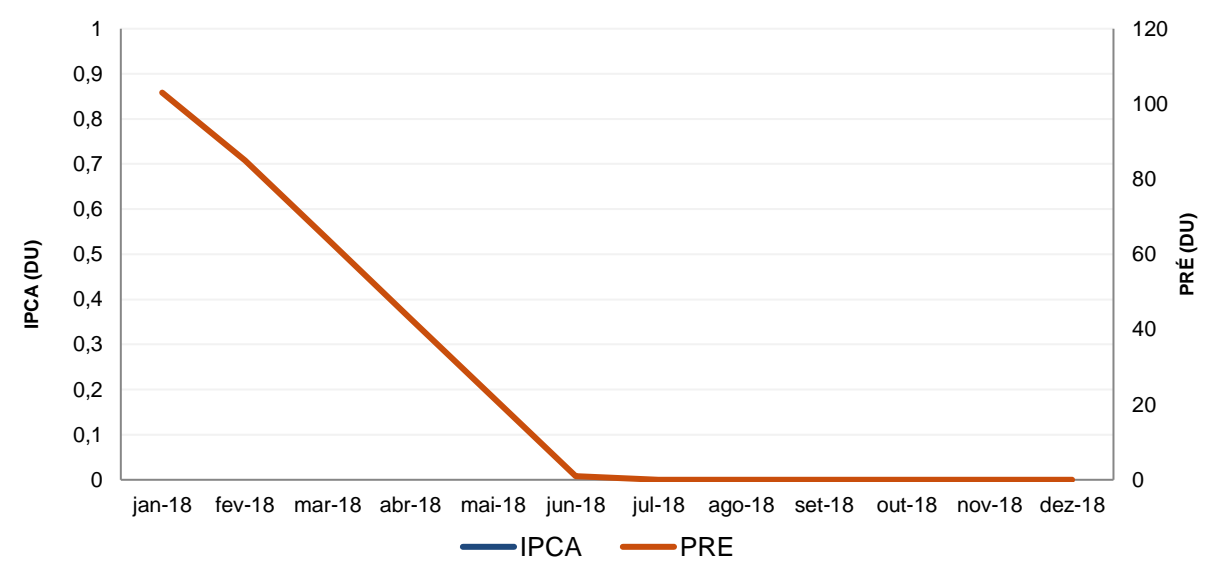
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/12/2018

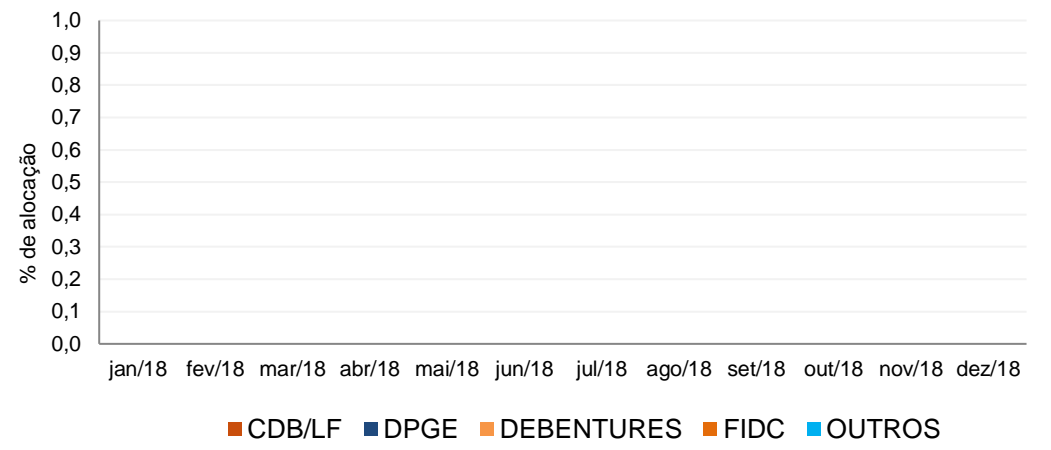
Análises de Contrapartes

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
------	------	---	-------	---------	-----

Alocação Por Tipo de Crédito



* em mil R\$

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 2020-03-01	01-mar-20	1.648	0,02%	Selic	13-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	5.670	0,08%	Selic	10-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	3.461	0,05%	Selic	13-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	3.263	0,05%	Selic	11-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.967	0,04%	Selic	07-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.176	0,03%	Selic	27-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.044	0,03%	Selic	17-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.978	0,03%	Selic	11-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	791	0,01%	Selic	05-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	758	0,01%	Selic	18-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	527	0,01%	Selic	11-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	330	0,00%	Selic	05-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	264	0,00%	Selic	11-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	231	0,00%	Selic	05-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	231	0,00%	Selic	10-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	165	0,00%	Selic	05-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	112	0,00%	Selic	11-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	99	0,00%	Selic	17-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	48	0,00%	Selic	10-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	7	0,00%	Selic	10-dez-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	396	0,01%	Selic	13-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	204	0,00%	Selic	12-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	198	0,00%	Selic	10-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	198	0,00%	Selic	11-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	82	0,00%	Selic	11-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	71	0,00%	Selic	10-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	46	0,00%	Selic	11-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	23	0,00%	Selic	11-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	23	0,00%	Selic	19-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	330	0,00%	Selic	11-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	142	0,00%	Selic	11-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	125	0,00%	Selic	11-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	33	0,00%	Selic	10-dez-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II