

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/07/2018

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	6.997.482,76	100,03%			1,27%	3,41%	4,97%	6,10%	9,75%	21,94%		
Benchmark:	CDI				0,54%	1,59%	3,13%	3,73%	7,09%	20,51%	37,39%	
CARTEIRA PRÓPRIA MM	6.637.722,64	94,88%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	6.637.722,64	94,88%		100%	1,31%	3,52%	5,73%	6,91%	11,35%	23,79%	-	
Benchmark:	CDI				0,54%	1,59%	3,13%	3,73%	7,09%	20,51%	37,39%	
RF REFERENCIADO DI	359.760,12	5,14%										
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	359.760,12	5,14%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,54%	1,56%	3,09%	3,69%	7,05%	20,47%	37,26%
Benchmark:	CDI				0,54%	1,59%	3,13%	3,73%	7,09%	20,51%	37,39%	
Total	6.995.598,34	100%			0,00%	1,27%	3,41%	5,13%	6,27%	9,93%	22,13%	
Benchmark:	CDI				0,54%	1,59%	3,13%	3,73%	7,09%	20,51%	37,39%	

* 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.

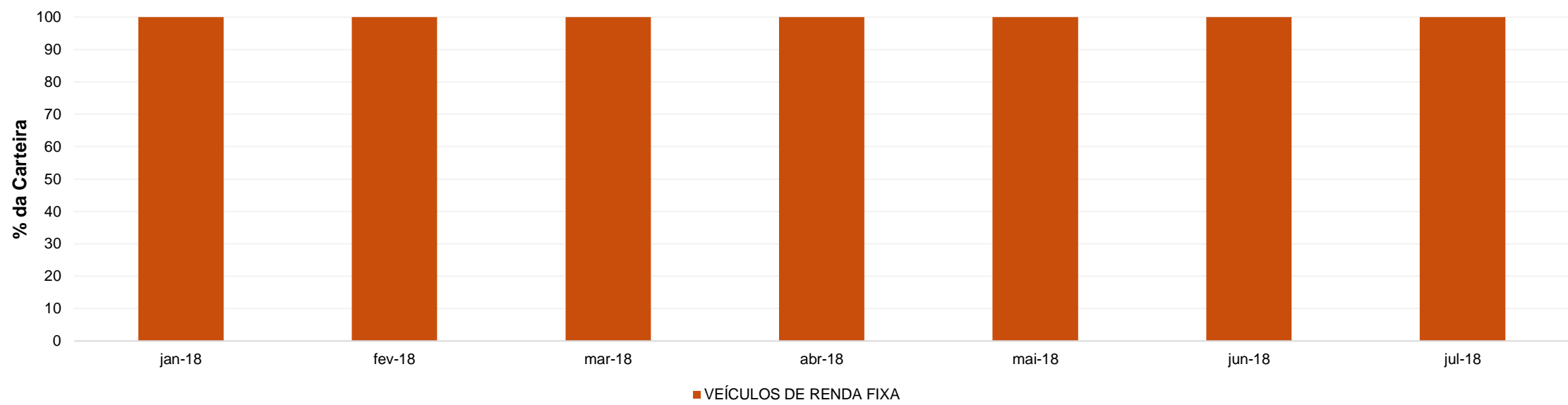


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma. Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se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

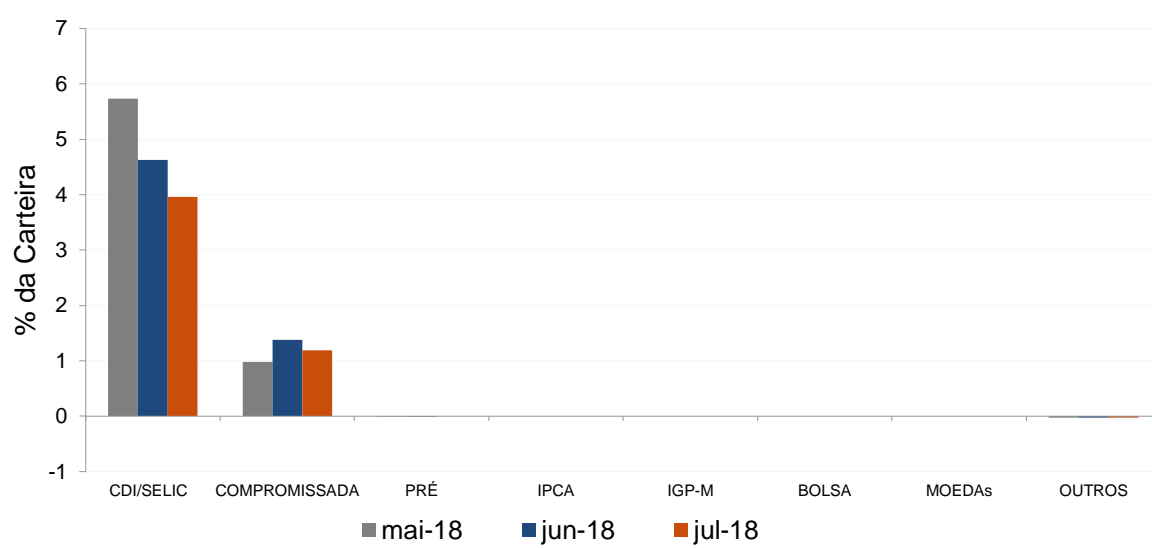
Distribuição da Carteira

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.

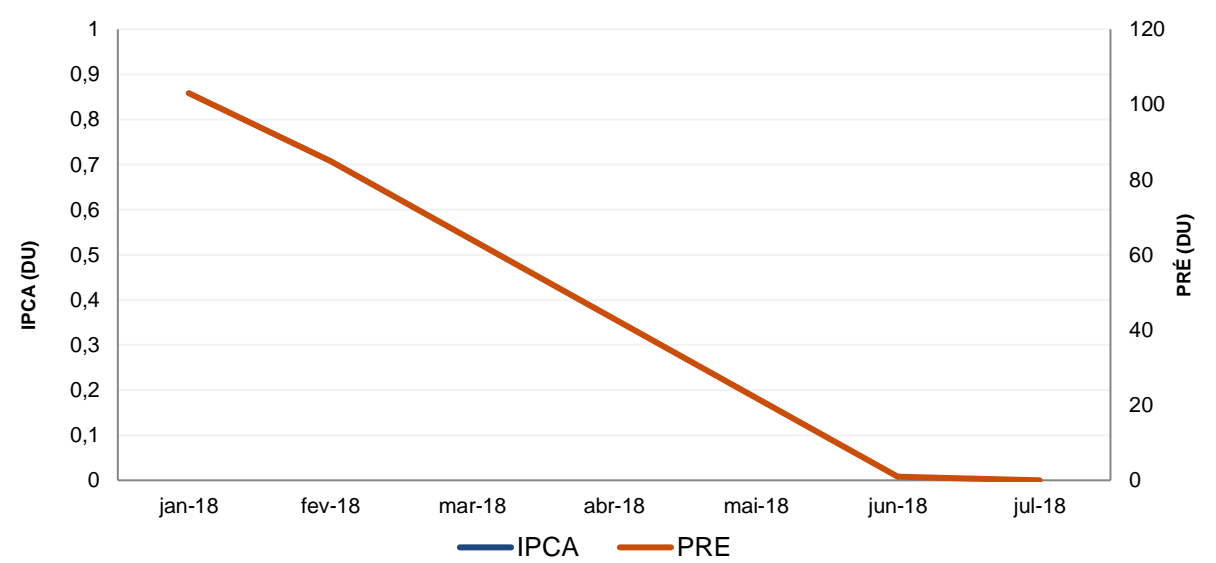
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/07/2018

Análises de Contrapartes

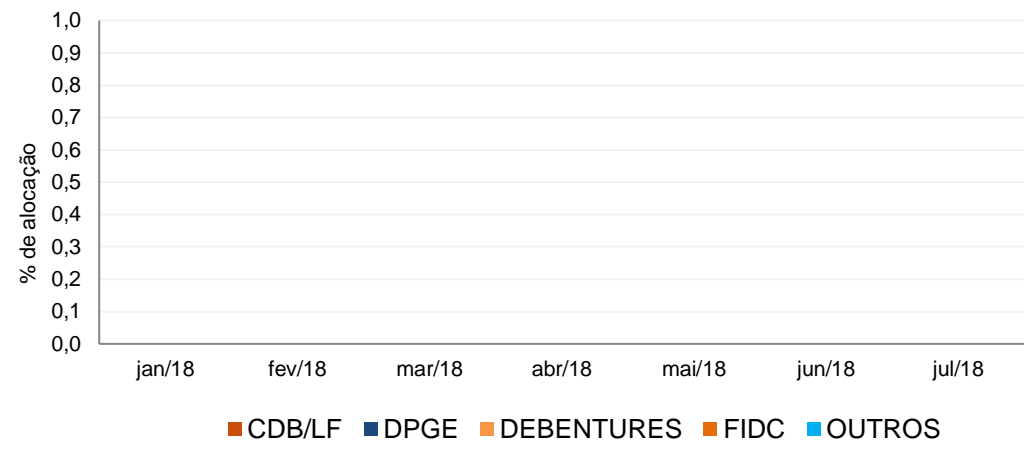
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/07/2018

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 2021-03-01	01-mar-21	18.344	0,26%	Selic	20-jul-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

