

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/11/2018

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	6.963.487,54	100,03%				0,62%	2,24%	5,75%	8,92%	9,72%	20,48%	
Benchmark:	CDI					0,49%	1,51%	3,17%	5,90%	6,47%	17,75%	34,28%
CARTEIRA PRÓPRIA MM	5.969.325,75	85,74%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	5.969.325,75	85,74%		100%		0,64%	2,36%	6,01%	10,29%	11,12%	23,62%	-
Benchmark:	CDI					0,49%	1,51%	3,17%	5,90%	6,47%	17,75%	34,28%
RF REFERENCIADO DI	994.161,79	14,28%										
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	994.161,79	14,28%	BRADESCO	0,01%	0,00%	0,49%	1,50%	3,16%	5,84%	6,41%	17,75%	34,14%
Benchmark:	CDI					0,49%	1,51%	3,17%	5,90%	6,47%	17,75%	34,28%
Total	6.961.744,63	100%				0,00%	0,62%	2,24%	5,75%	8,92%	9,72%	20,48%
Benchmark:	CDI					0,49%	1,51%	3,17%	5,90%	6,47%	17,75%	34,28%

* 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.

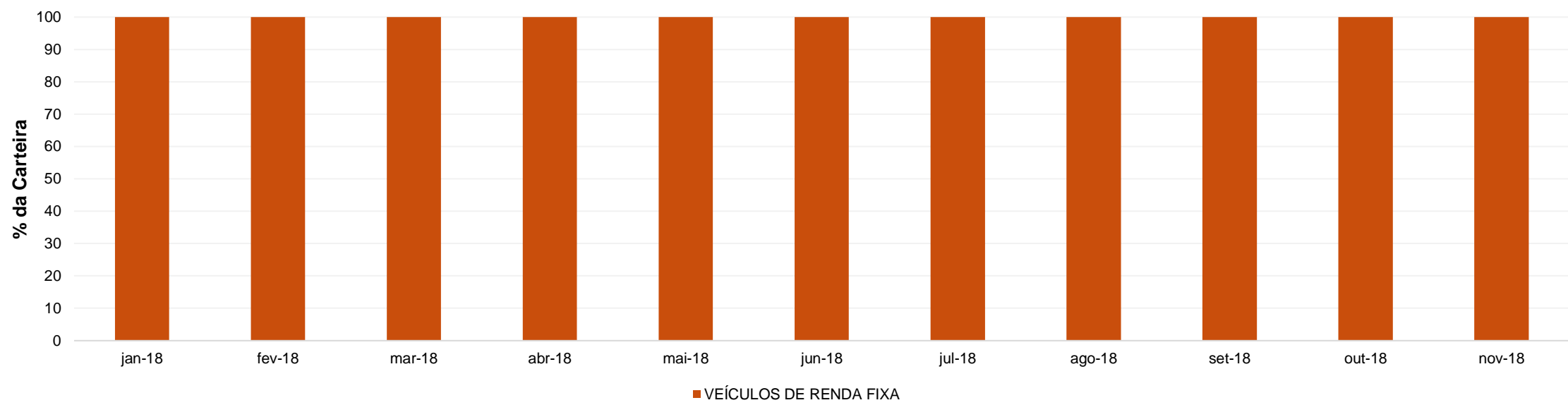


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma. Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se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

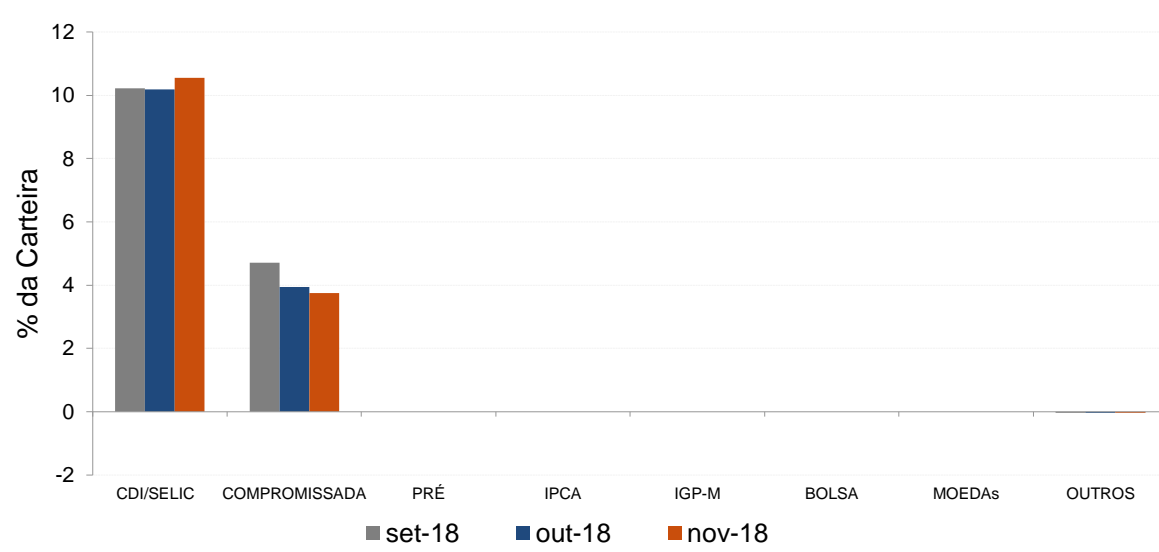
Distribuição da Carteira

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.

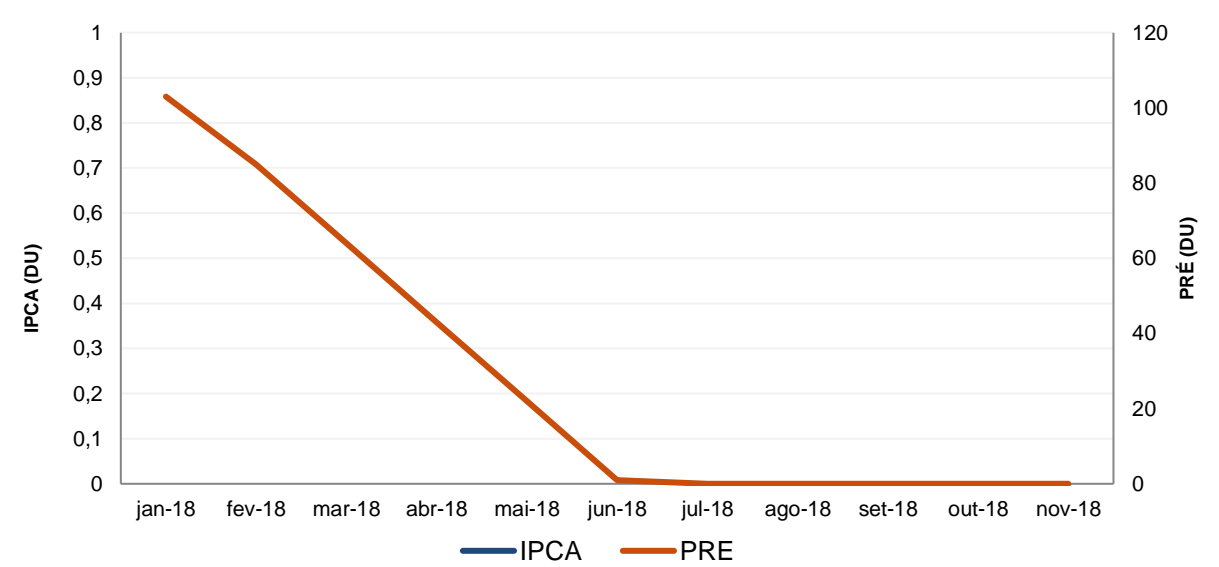
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/11/2018

Análises de Contrapartes

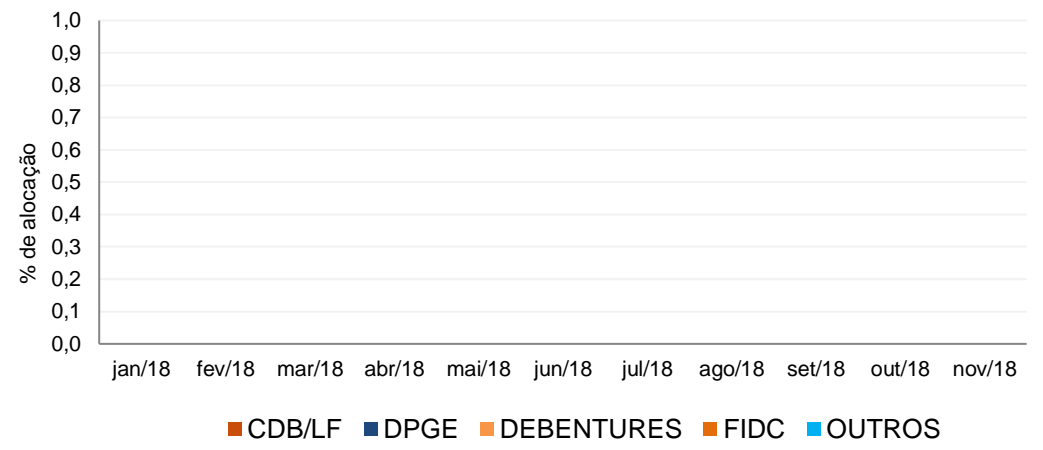
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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 2019-03-01	01-mar-19	39	0,00%	Selic	01-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	28	0,00%	Selic	05-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	28	0,00%	Selic	01-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	15	0,00%	Selic	13-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	12	0,00%	Selic	14-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	12	0,00%	Selic	16-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	11	0,00%	Selic	13-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	11	0,00%	Selic	14-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	11	0,00%	Selic	08-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	10	0,00%	Selic	16-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	10	0,00%	Selic	20-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	9	0,00%	Selic	06-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	9	0,00%	Selic	20-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	8	0,00%	Selic	08-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	7	0,00%	Selic	08-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	7	0,00%	Selic	12-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	7	0,00%	Selic	08-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6	0,00%	Selic	20-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6	0,00%	Selic	22-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6	0,00%	Selic	01-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	5	0,00%	Selic	19-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	5	0,00%	Selic	06-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	4	0,00%	Selic	09-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	4	0,00%	Selic	06-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	4	0,00%	Selic	21-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	4	0,00%	Selic	22-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	3	0,00%	Selic	01-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	3	0,00%	Selic	05-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	2	0,00%	Selic	21-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	2	0,00%	Selic	23-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	1	0,00%	Selic	08-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	1	0,00%	Selic	09-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	1	0,00%	Selic	16-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	3.649	0,05%	Selic	07-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2.919	0,04%	Selic	14-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	6.568	0,09%	Selic	21-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.554	0,04%	Selic	12-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.824	0,03%	Selic	01-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

