

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	226.096.982,33	85,74%			0,59%	2,42%	3,33%	5,92%	6,57%	18,96%		
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,10%	1,68%	4,27%	7,37%	8,17%	15,64%	28,65%	
Total Return	212.629.857,38	80,63%			0,67%	0,60%	2,46%	3,59%	6,55%	7,18%	19,33%	
ATLANTIDA FI MULT	107.453.937,83	40,75%	ITAU	100%	0,79%	0,60%	2,62%	4,14%	7,57%	7,89%	18,24%	34,11%
ITAPEMA FI MULT	105.175.919,55	39,89%	SUL AMERICA	100%	0,56%	0,59%	2,29%	3,08%	5,79%	6,65%	20,33%	37,55%
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,10%	1,68%	4,27%	7,37%	8,17%	15,64%	28,65%	
Renda Fixa CDI	2.768.607,01	1,05%			0,01%	0,56%	1,69%	3,57%	6,41%	6,98%	18,69%	
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	994.161,79	0,38%	BRADESCO	0,01%	0,00%	0,49%	1,50%	3,16%	5,84%	6,41%	17,75%	34,14%
BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV	1.774.445,22	0,67%	BTG PACTUAL	0,07%	0,02%	0,59%	1,80%	3,74%	6,88%	7,53%	20,77%	39,99%
Benchmark:	CDI				0,49%	1,51%	3,17%	5,90%	6,47%	17,75%	34,28%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	5.969.325,83	2,26%			0,64%	2,36%	6,01%	10,29%	11,12%	23,62%		
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	5.969.325,83	2,26%		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	2.699.790,50	1,02%			0,48%	1,48%	3,10%					
ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	2.699.790,50	1,02%	ITAU	0,26%	0,00%	0,48%	1,48%	3,10%	5,77%	6,33%	17,53%	34,12%
Benchmark:	CDI				0,49%	1,51%	3,17%	5,90%	6,47%	17,75%	34,28%	
RF CRÉDITO	2.029.401,61	0,77%			0,51%	1,54%	3,32%	6,02%	6,59%			
FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV	2.029.401,61	0,77%	VOTORANTIM	0,15%	0,04%	0,51%	1,54%	3,32%	6,02%	6,59%	18,38%	35,72%
Benchmark:	CDI				0,49%	1,51%	3,17%	5,90%	6,47%	17,75%	34,28%	
Renda Variável	13.587.112,80	5,15%			2,37%	16,40%	15,49%	13,42%	19,99%	37,20%		
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.				2,62%	17,57%	18,36%	20,35%	28,06%	53,33%	116,66%	
Renda Variável Ativa	13.587.112,80	5,15%			10,28%	2,38%	16,50%	15,63%	17,50%	24,30%	46,64%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.203.645,28	0,84%	AZ QUEST	0,31%	11,16%	1,36%	17,50%	15,24%	26,16%	34,04%	54,33%	90,43%
BRADESCO FIA SELECTION	2.211.940,77	0,84%	BRADESCO	0,69%	12,21%	1,04%	17,59%	18,38%	25,71%	33,00%	63,62%	116,20%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	3.271.915,24	1,24%	BTG PACTUAL	0,42%	9,18%	3,42%	19,43%	18,56%	17,58%	23,40%	50,65%	76,61%
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FC FI	3.985.215,69	1,51%	ITAU	0,29%	11,64%	2,89%	16,03%	15,04%	21,56%	28,49%	58,42%	118,06%
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	1.914.395,82	0,73%	NEO GESTAO	0,41%	7,89%	2,25%	9,90%	8,75%	-2,94%	2,18%	42,95%	94,85%
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.				2,62%	17,57%	18,36%	20,35%	28,06%	53,33%	116,66%	
Estruturado	24.021.475,43	9,11%			-0,15%	1,97%	3,44%	5,42%	6,39%	20,20%		
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,65%	2,00%	4,21%	7,83%	8,58%	22,48%	42,46%	
Multimercado Estruturado	24.021.475,43	9,11%			2,57%	-0,15%	1,97%	3,44%	5,29%	6,25%	19,97%	
AZ QUEST MULT FC FI MULT	3.709.527,49	1,41%	AZ QUEST	0,58%	2,97%	0,43%	2,72%	4,67%	9,05%	10,32%	28,30%	58,78%
BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	4.169.223,02	1,58%	BTG PACTUAL	0,23%	2,70%	-0,01%	1,98%	4,78%	7,45%	8,86%	30,42%	45,86%
FICFI MULT GARDE DUMAS	4.432.157,53	1,68%	GARDE	0,55%	3,96%	-1,08%	1,15%	1,68%	0,61%	1,98%	17,81%	38,86%
GARDE D ARTAGNAN FICFI MULT	2.979.835,97	1,13%	GARDE	0,15%	3,96%	-1,08%	1,15%	1,69%	0,67%	2,00%	17,92%	39,12%
KINEA CHRONOS FI MULT	7.179.661,91	2,72%	KINEA	0,13%	1,81%	0,27%	2,55%	3,96%	8,56%	9,14%	25,38%	54,95%
SUL AMERICA ENDURANCE FI MULT	1.551.069,51	0,59%	SUL AMERICA	0,38%	0,21%	0,57%	1,41%	3,00%	5,75%	6,07%	19,98%	38,87%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,65%	2,00%	4,21%	7,83%	8,58%	22,48%	42,46%	
Total	263.697.324,54	100%			1,26%	0,61%	2,81%	3,71%	5,93%	6,65%	19,10%	
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,13%	1,77%	4,47%	7,73%	8,58%	16,50%	30,09%	

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório 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.

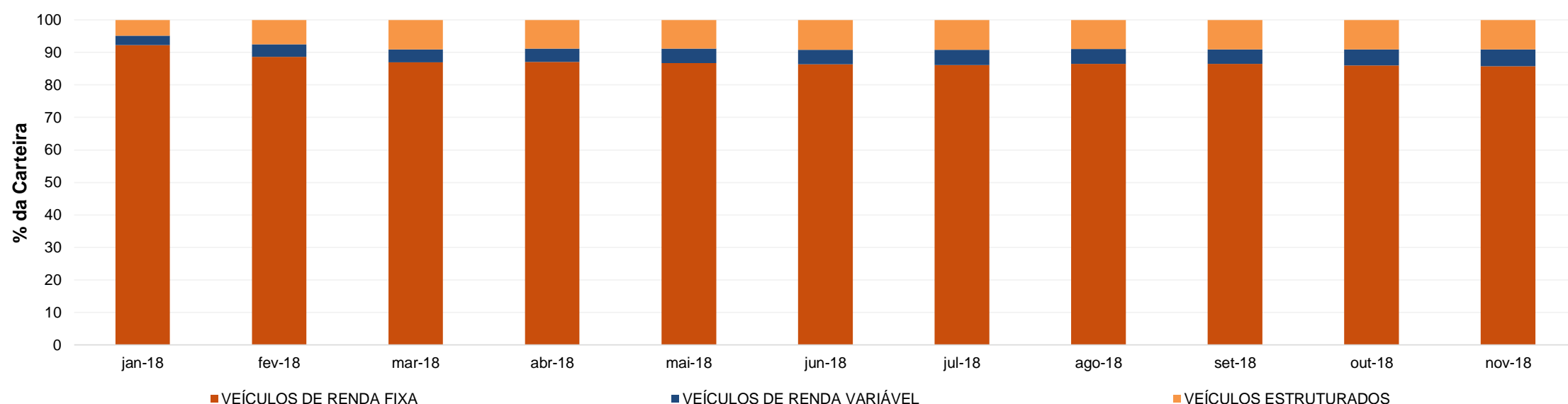
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

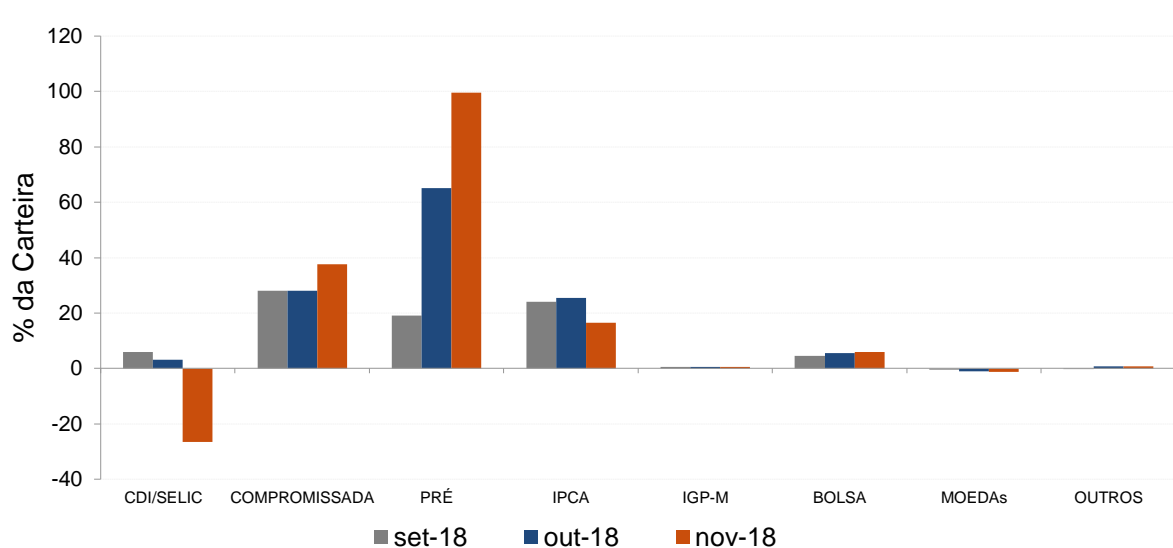
Distribuição da Carteira

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.

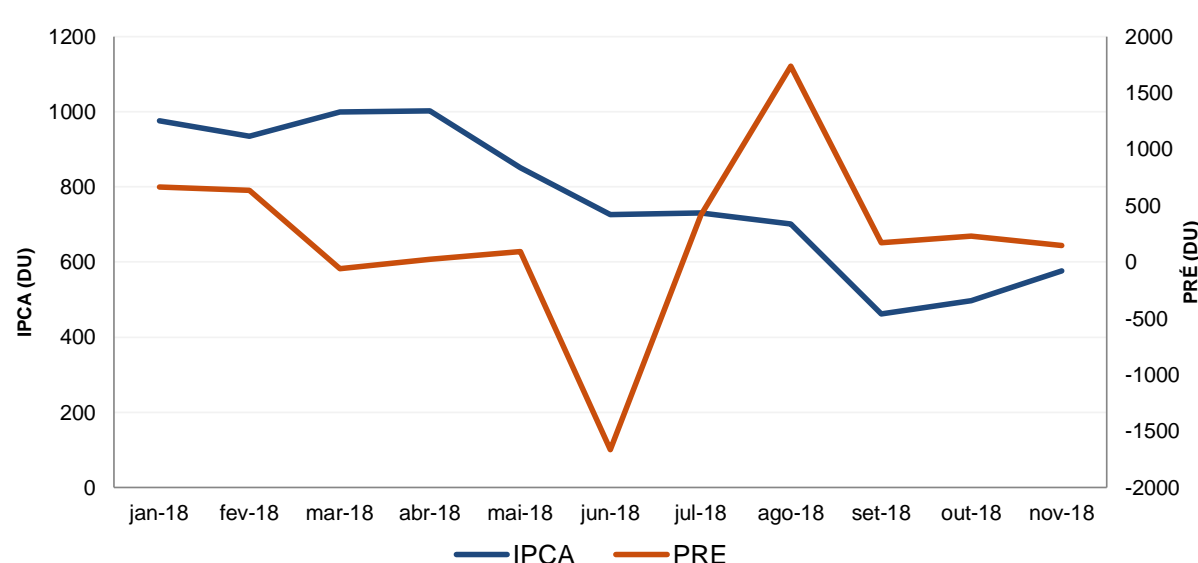
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
ITUB4	Intermediários Financeiros	1.078,17	6,48	945,09	6,20
BBDC4	Intermediários Financeiros	1.015,28	6,10	651,25	4,27
LREN3	Comércio	931,26	5,60	836,66	5,49
FIBR3	Madeira e Papel	920,40	5,53	447,84	2,94
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	792,08	4,76	1.334,10	8,75
BBAS3	Intermediários Financeiros	655,28	3,94	504,67	3,31
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	635,82	3,82	597,33	3,92
VALE3	Mineração	607,32	3,65	691,31	4,54
RENT3	Diversos	597,57	3,59	722,42	4,74
EQTL3	Energia Elétrica	585,49	3,52	555,92	3,65

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

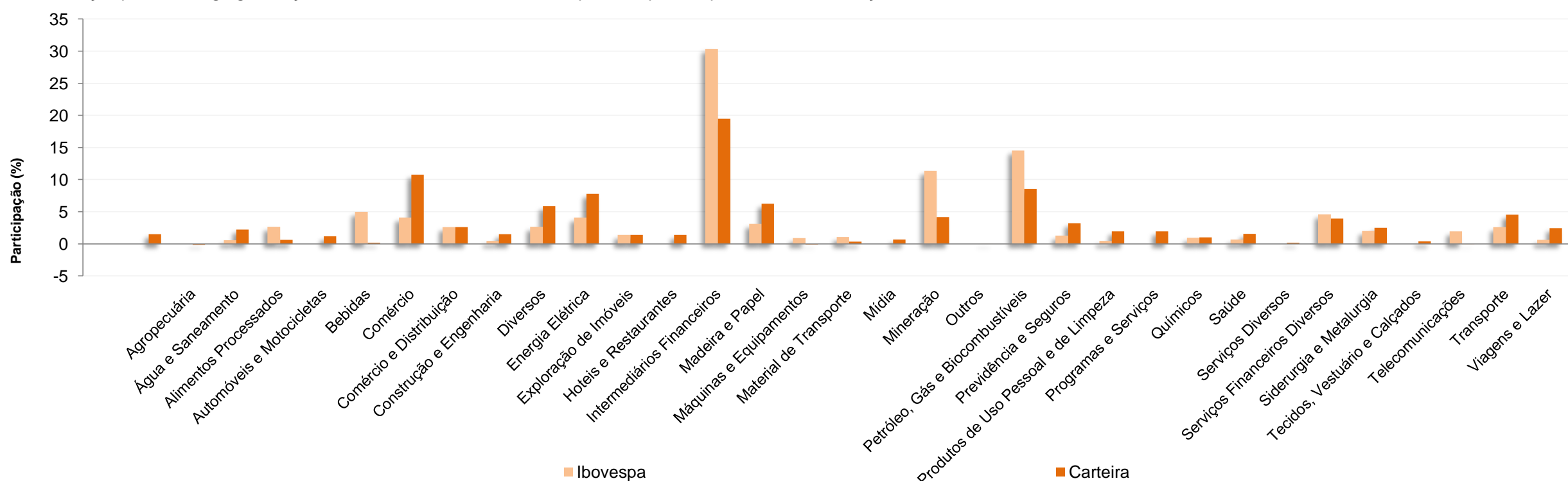
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
SEDU3	115,08	0,69	0,01	2
ITUB4	1.078,17	6,48	0,00	1
BBDC4	1.015,28	6,10	0,00	1
LREN3	931,26	5,60	0,00	1
FIBR3	920,40	5,53	0,01	1
PETR4	792,08	4,76	0,00	1
BBAS3	655,28	3,94	0,00	1
B3SA3	635,82	3,82	0,00	1
VALE3	607,32	3,65	0,00	1
RENT3	597,57	3,59	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

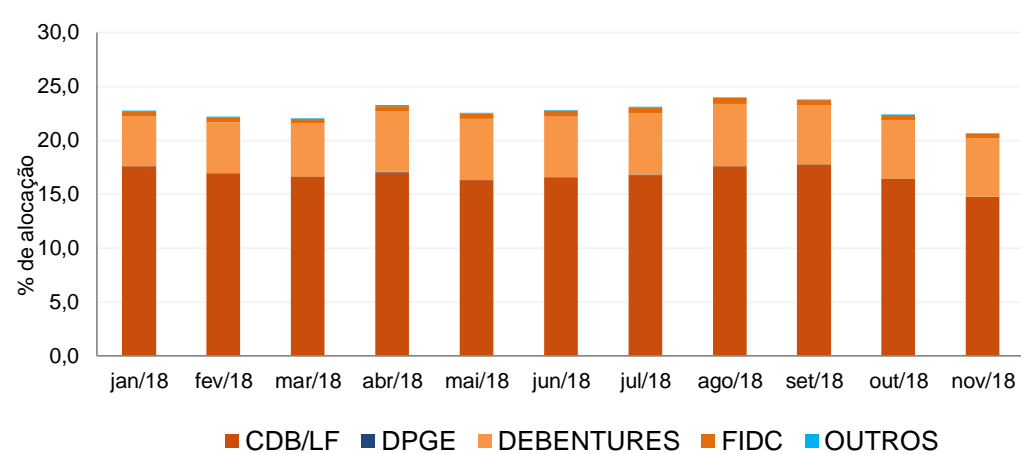
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO BRADESCO SA	11.814,57	4,48	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO BRASIL SA	11.246,46	4,27	AA (bra)	Aa1.br	
BCO ITAU SA	5.572,53	2,11	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
LOCALIZA RENT A CAR SA	4.047,05	1,54	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO SAFRA SA	3.244,11	1,23		Aa1.br	brAAA
BCO VOTORANTIM SA	3.125,77	1,19		Aa3.br	brAAA
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	2.502,74	0,95	AA (bra)	Aaa.br	brAAA
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	2.157,03	0,82		Aaa.br	
CCR SA	2.001,81	0,76	AA (bra)	A2.br	
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	1.465,14	0,56		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
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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Rating	Agência	Veículo
CDB CDI	29-nov-19	6.741	0,00%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	29-nov-18	103,50%	brAAA	S&P	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
LF CDI	13-ago-20	4.453	0,00%	CDI	BCO BRASIL SA	28-nov-18	114,00%	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 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		08-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	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		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	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	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	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	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	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		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		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	0,00%	Selic		07-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2.919	0,00%	Selic		14-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	6.568	0,00%	Selic		21-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	5.911	0,00%	Selic		22-nov-18	0,02%	0,00%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.554	0,00%	Selic		12-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.824	0,00%	Selic		01-nov-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	72.608	0,03%	Selic		21-nov-18	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2022-09-01	01-set-22	29.588	0,01%	Selic		23-nov-18	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2022-09-01	01-set-22	2.221	0,00%	Selic		22-nov-18	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	36.290	0,01%	Selic		16-nov-18	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	36.290	0,01%	Selic		16-nov-18	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	7.766	0,00%	Selic		20-nov-18	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.495	0,00%	Selic		09-nov-18	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
NTN-B 2019-05-15	15-mai-19	787.662	0,30%	IPCA		19-nov-18	2,92%	2,96%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2020-08-15	15-ago-20	36.690	0,01%	IPCA		19-nov-18	3,37%	3,39%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	62.866	0,02%	IPCA		19-nov-18	3,86%	3,89%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	77.430	0,03%	IPCA		19-nov-18	4,44%	4,48%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	69.959	0,03%	IPCA		19-nov-18	4,59%	4,63%	ATLANTIDA FI MULT

