

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/10/2018

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	6.981.768,41	100,03%				1,03%	2,34%	5,83%	8,58%	9,99%	20,98%	
Benchmark:	CDI					0,54%	1,59%	3,20%	5,38%	6,55%	18,38%	35,04%
CARTEIRA PRÓPRIA MM	5.996.615,28	85,91%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	5.996.615,28	85,91%		100%		1,11%	2,51%	6,12%	9,59%	11,37%	23,34%	-
Benchmark:	CDI					0,54%	1,59%	3,20%	5,38%	6,55%	18,38%	35,04%
RF REFERENCIADO DI	985.153,13	14,11%										
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	985.153,13	14,11%	BRADESCO	0,01%	0,00%	0,54%	1,58%	3,17%	5,33%	6,49%	18,39%	34,89%
Benchmark:	CDI					0,54%	1,59%	3,20%	5,38%	6,55%	18,38%	35,04%
Total	6.979.893,44	100%				0,00%	1,03%	2,34%	5,83%	8,58%	9,99%	20,98%
Benchmark:	CDI					0,54%	1,59%	3,20%	5,38%	6,55%	18,38%	35,04%

* 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.

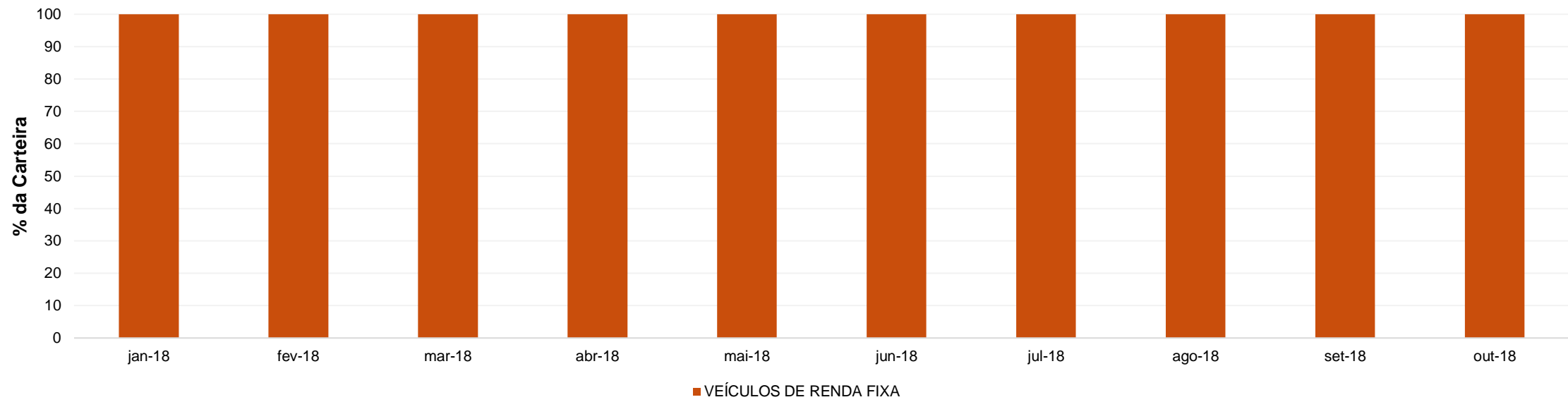
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

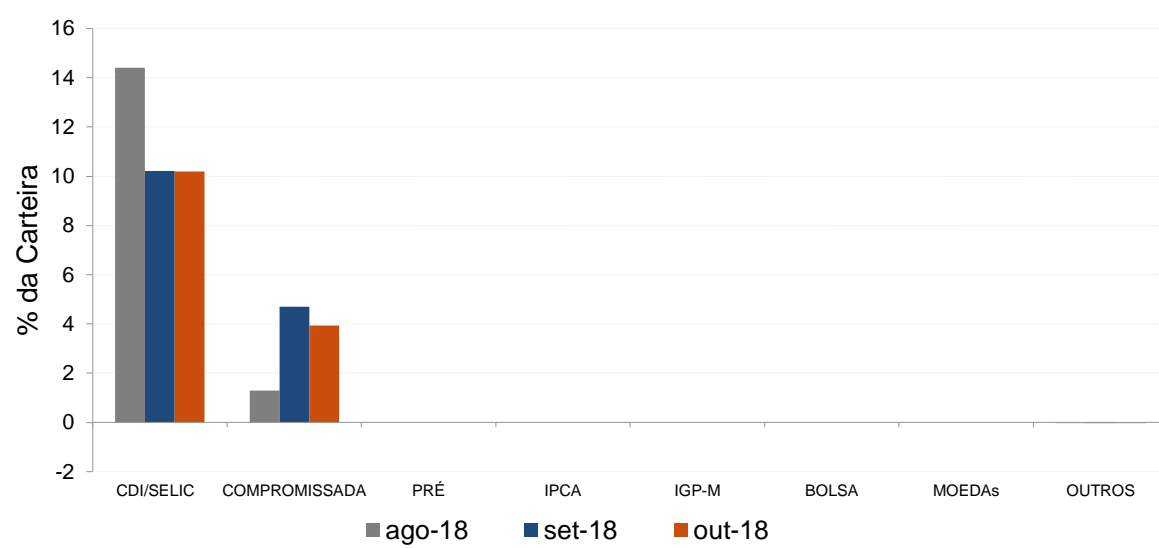
Distribuição da Carteira

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.

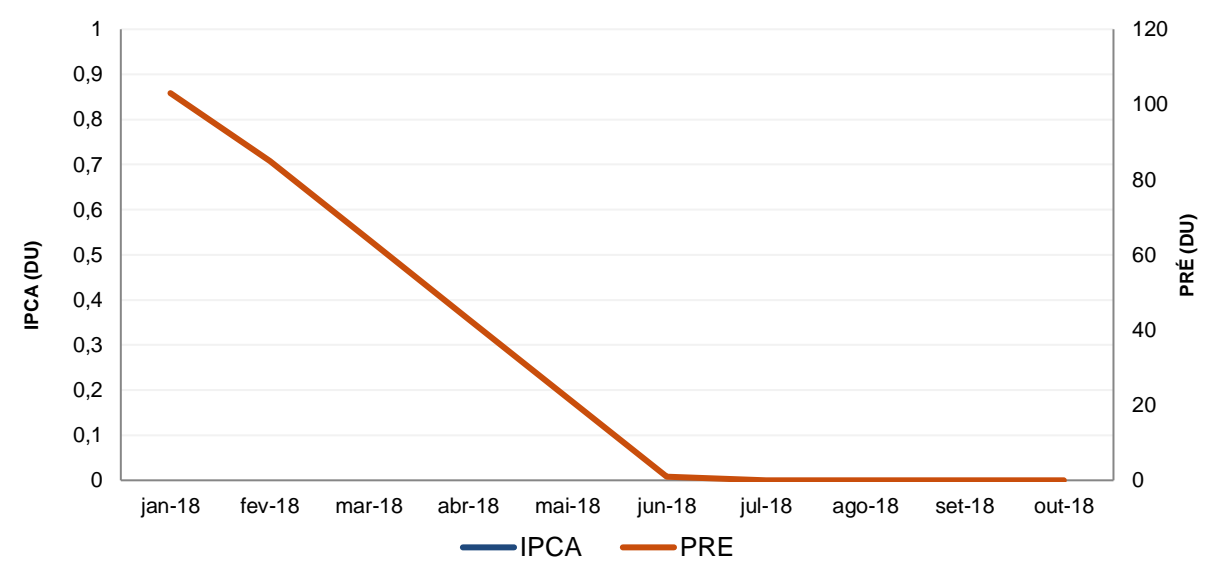
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/10/2018

Análises de Contrapartes

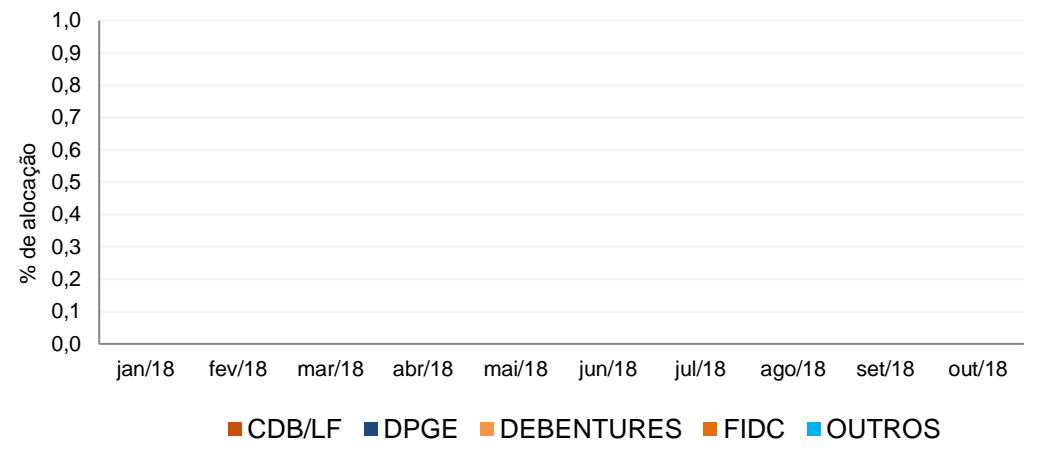
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	624	0,01%	Selic	30-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	277	0,00%	Selic	10-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	57	0,00%	Selic	23-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	35	0,00%	Selic	01-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	33	0,00%	Selic	29-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	26	0,00%	Selic	08-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	26	0,00%	Selic	22-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	24	0,00%	Selic	01-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	15	0,00%	Selic	22-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	14	0,00%	Selic	09-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	12	0,00%	Selic	05-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	10	0,00%	Selic	16-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	9	0,00%	Selic	11-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	8	0,00%	Selic	11-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	8	0,00%	Selic	18-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	7	0,00%	Selic	29-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6	0,00%	Selic	05-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6	0,00%	Selic	25-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6	0,00%	Selic	05-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6	0,00%	Selic	08-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6	0,00%	Selic	30-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	5	0,00%	Selic	01-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	5	0,00%	Selic	01-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	5	0,00%	Selic	22-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	4	0,00%	Selic	09-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	3	0,00%	Selic	30-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	3	0,00%	Selic	16-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	3	0,00%	Selic	15-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	3	0,00%	Selic	26-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	2	0,00%	Selic	18-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	2	0,00%	Selic	22-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	1	0,00%	Selic	11-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	1	0,00%	Selic	15-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	1	0,00%	Selic	26-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	4.852	0,07%	Selic	08-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1.392	0,02%	Selic	26-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.773	0,04%	Selic	26-out-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.426	0,03%	Selic	15-out-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	4.470	0,06%	Selic	02-out-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.733	0,02%	Selic	08-out-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.386	0,02%	Selic	23-out-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2.046	0,03%	Selic	05-out-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1.386	0,02%	Selic	23-out-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	2.572	0,04%	Selic	22-out-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	2.079	0,03%	Selic	24-out-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.386	0,02%	Selic	23-out-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	485	0,01%	Selic	31-out-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	346	0,00%	Selic	10-out-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.732	0,02%	Selic	08-out-18	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

