

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 28/09/2018

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	6.967.949,32	100,02%			0,58%	2,58%	5,28%	7,47%	9,58%	20,85%		
Benchmark:	CDI				0,47%	1,59%	3,17%	4,81%	6,66%	18,98%	35,79%	
CARTEIRA PRÓPRIA MM	5.927.763,07	85,09%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	5.927.763,07	85,09%		100%	0,59%	2,71%	5,67%	8,38%	11,15%	22,87%	-	
Benchmark:	CDI				0,47%	1,59%	3,17%	4,81%	6,66%	18,98%	35,79%	
RF REFERENCIADO DI	1.040.186,25	14,93%										
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	1.040.186,25	14,93%	BRADESCO	0,01%	0,00%	0,47%	1,58%	3,14%	4,76%	6,61%	18,98%	35,66%
Benchmark:	CDI				0,47%	1,59%	3,17%	4,81%	6,66%	18,98%	35,79%	
Total	6.966.249,52	100%			0,00%	0,58%	2,58%	5,28%	7,47%	9,58%	20,85%	
Benchmark:	CDI				0,47%	1,59%	3,17%	4,81%	6,66%	18,98%	35,79%	

* 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.

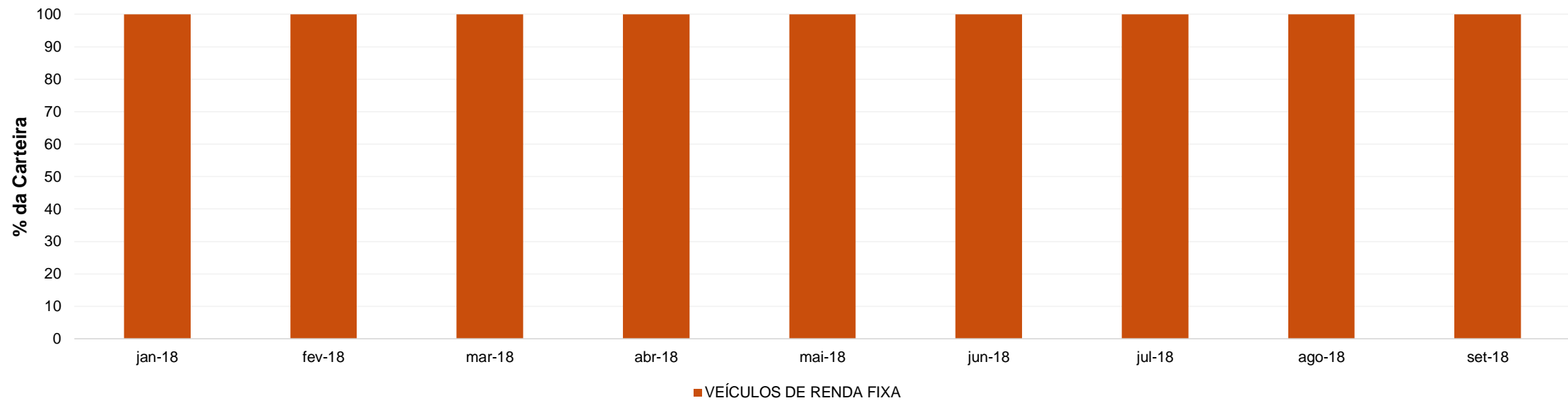


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma. Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se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

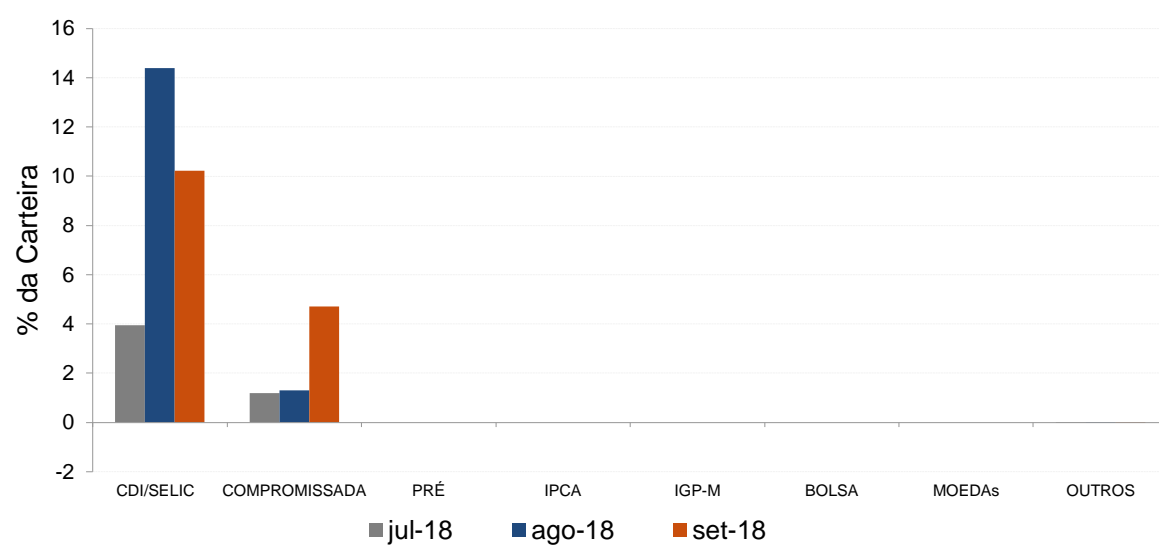
Distribuição da Carteira

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.

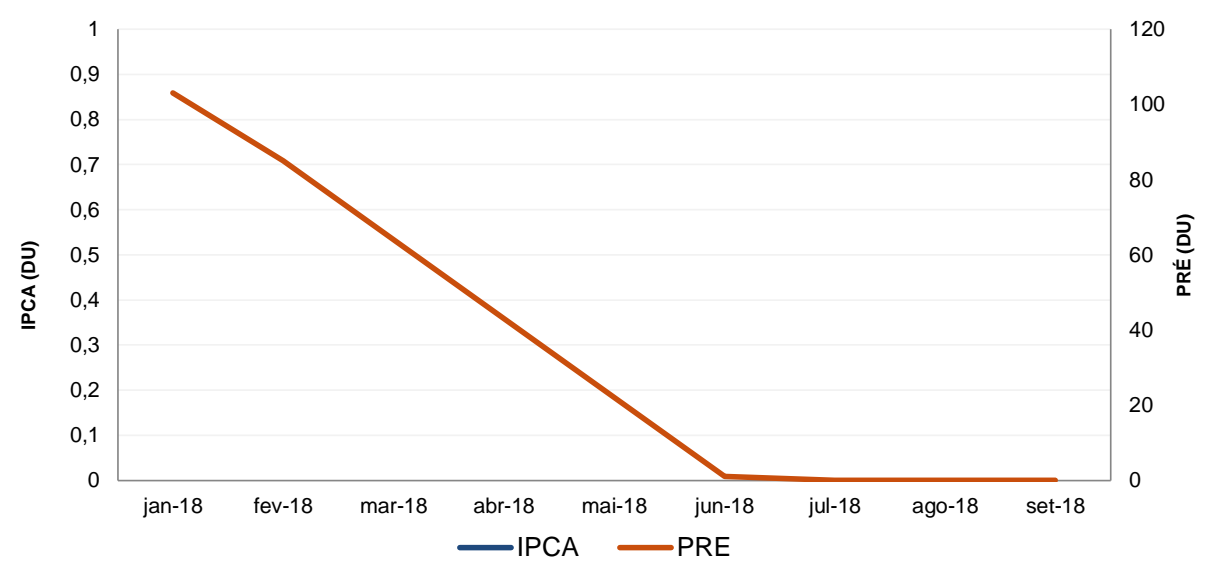
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 28/09/2018

Análises de Contrapartes

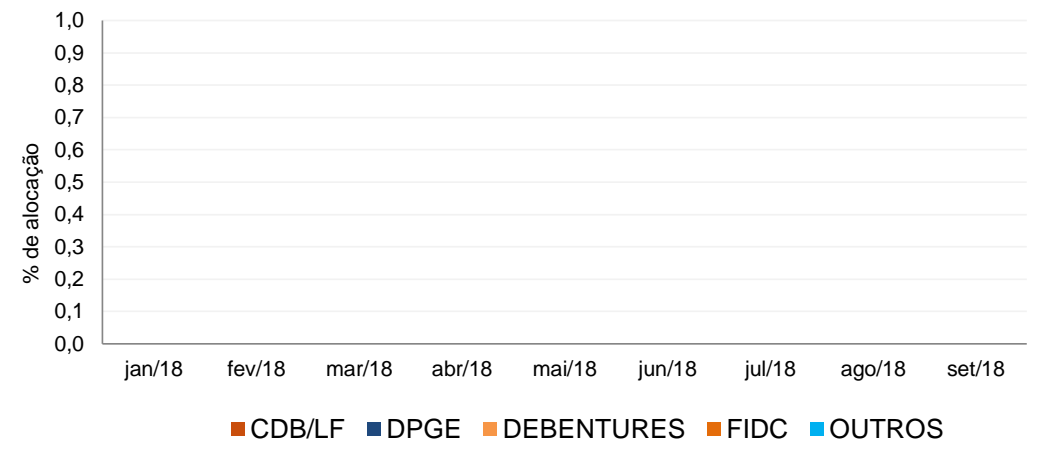
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	618	0,01%	Selic	26-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	211	0,00%	Selic	26-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	195	0,00%	Selic	26-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	171	0,00%	Selic	26-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	39	0,00%	Selic	26-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	35	0,00%	Selic	26-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	7	0,00%	Selic	26-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6	0,00%	Selic	26-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6	0,00%	Selic	26-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	4	0,00%	Selic	21-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	3	0,00%	Selic	26-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	3	0,00%	Selic	28-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	3	0,00%	Selic	20-set-18	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	21.793	0,31%	Selic	28-set-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	16.811	0,24%	Selic	19-set-18	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

