

RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

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	6.490.533,99	100,01%											
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,80%	1,81%	4,84%	6,66%	9,00%	16,56%	31,92%	
Renda Fixa CDI	6.490.533,99	100,01%			0,01%	0,49%	1,75%	3,43%	5,04%	6,90%	19,85%		
BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV	1.752.727,98	27,01%	BTG PACTUAL	0,06%	0,02%	0,55%	1,84%	3,66%	5,57%	7,67%	22,99%	41,46%	
ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	2.729.522,76	42,06%	ITAU	0,24%	0,00%	0,46%	1,55%	3,10%	4,70%	6,52%	18,79%	35,67%	
FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV	2.008.283,25	30,95%	VOTORANTIM	0,15%	0,03%	0,48%	1,71%	3,30%	4,92%	6,80%	19,79%	36,91%	
Benchmark:	CDI					0,47%	1,59%	3,17%	4,81%	6,66%	18,98%	35,79%	
Total	6.489.671,17	100%			0,01%	0,47%	1,71%	3,33%	4,90%	6,75%	19,68%	36,62%	
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,80%	1,81%	4,84%	6,66%	9,00%	16,56%	31,92%	

* 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.

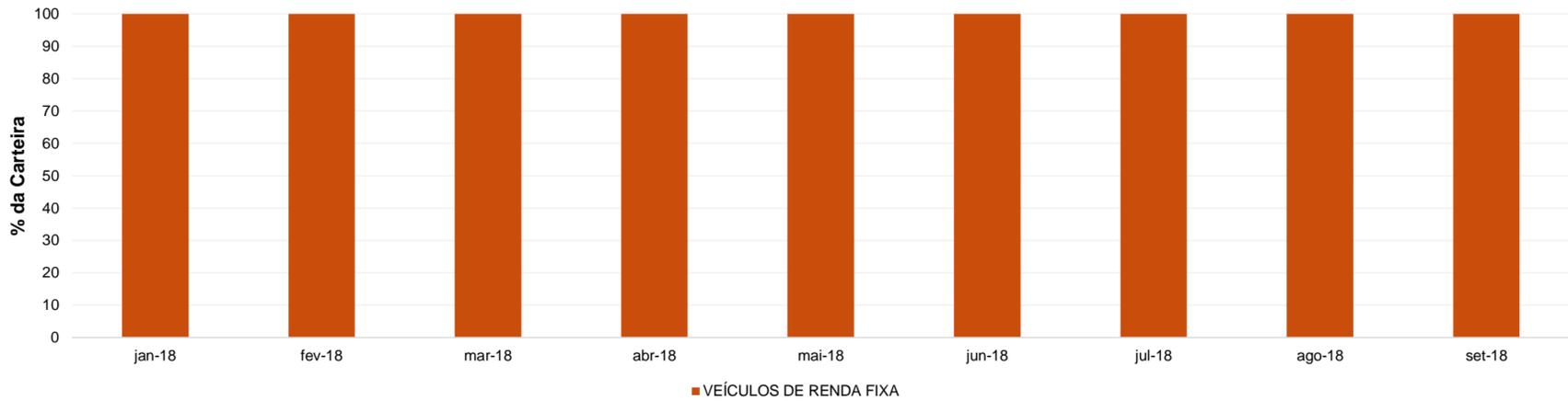


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma. Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se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

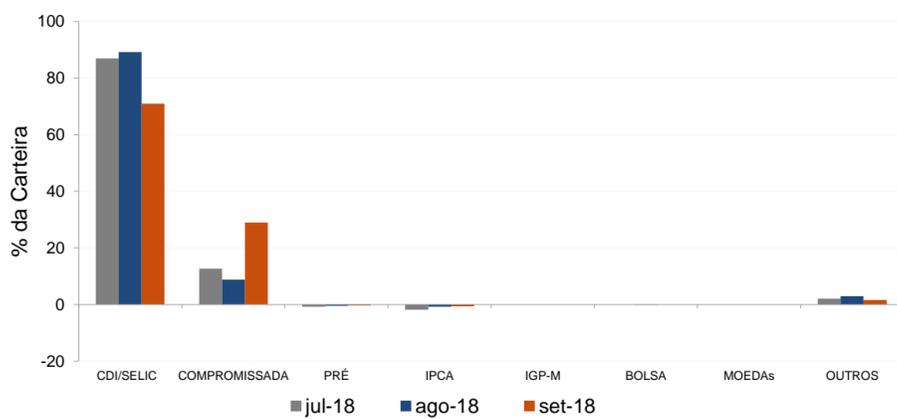
Distribuição da Carteira

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.

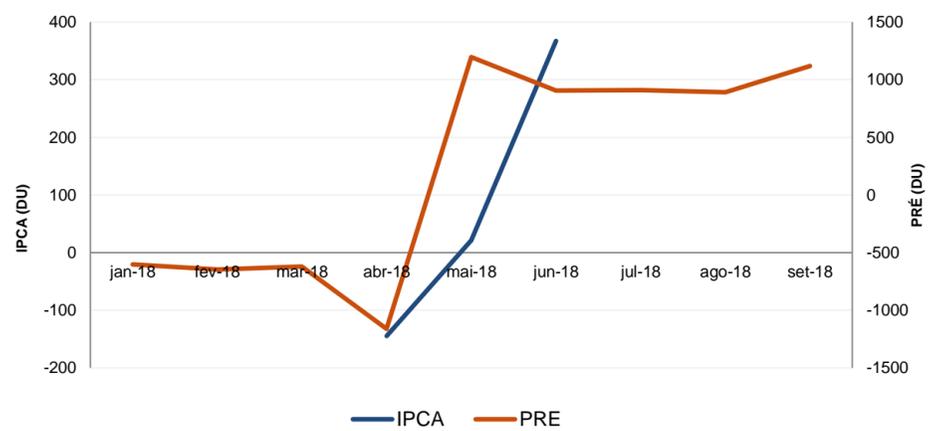
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

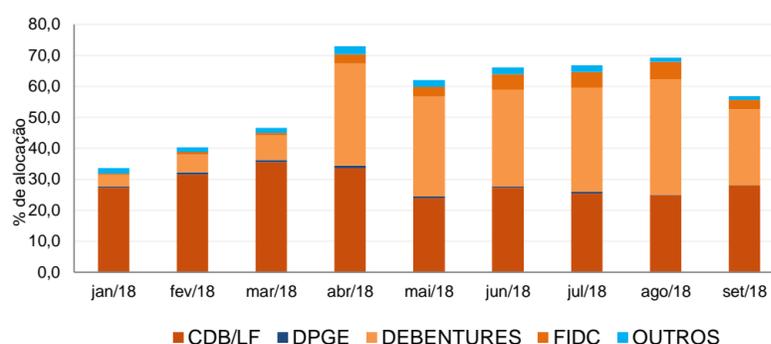
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO VOTORANTIM SA	395,99	6,08		Aa3.br	brAAA
BCO BRADESCO SA	310,34	4,76	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO SAFRA SA	151,35	2,32		Aa1.br	brAAA
BCO ITAU SA	148,02	2,27	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	147,47	2,26	AA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO BRASIL SA	122,50	1,88	AA (bra)	Aa1.br	
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	96,06	1,47		Aaa.br	brAAA
LOCALIZA RENT A CAR SA	80,47	1,23	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	74,44	1,14	AA+ (bra)		
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	74,22	1,14	AA (bra)	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
BRML22	0,00	BR MALLS PARTICIPACOES SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-19	IPCA	3,57%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F
BRML22	0,01	BR MALLS PARTICIPACOES SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-19	IPCA	3,48%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F
BRML22	0,65	BR MALLS PARTICIPACOES SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-19	IPCA	3,48%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI
CEMT18	0,02	ENERGISA MATO GROSSO DISTRIBUIDORA ENEI	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-21	CDI	1,10%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F
CEMT18	0,08	ENERGISA MATO GROSSO DISTRIBUIDORA ENEI	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-21	CDI	1,10%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F
CEMT18	16,97	ENERGISA MATO GROSSO DISTRIBUIDORA ENEI	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-21	CDI	1,10%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
CEMT18	0,60	ENERGISA MATO GROSSO DISTRIBUIDORA ENEI	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-21	CDI	0,79%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
CEMT18	4,54	ENERGISA MATO GROSSO DISTRIBUIDORA ENEI	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-21	CDI	1,10%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI
ELPLA3	15,04	ELETROPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE	Novo	AAA (bra)	Fitch	13-set-21	CDI	108,25%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
ESUL18	0,02	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDOR/	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,50%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F
ESUL18	0,05	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDOR/	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,50%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F
ESUL18	0,05	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDOR/	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,50%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F
ESUL18	6,09	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDOR/	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,50%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI
ESULA0	0,00	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDOR/	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-21	CDI	0,95%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F
ESULA0	0,36	ENERGISA MATO GROSSO SUL - DISTRIBUIDOR/	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-21	CDI	1,66%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI
OVTL14	2,53	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	A (bra)	A+ (bra)	Fitch	11-nov-18	CDI	3,73%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI
OVTL14	0,01	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	A (bra)	A+ (bra)	Fitch	11-nov-18	CDI	3,51%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F
OVTL14	0,04	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	A (bra)	A+ (bra)	Fitch	11-nov-18	CDI	3,51%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F
SAEL14	3,41	ENERGISA PARAIBA DISTRIBUIDORA ENERGIA S	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-21	CDI	1,00%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI
SAEL14	0,01	ENERGISA PARAIBA DISTRIBUIDORA ENERGIA S	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-21	CDI	1,00%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F
SAEL14	0,06	ENERGISA PARAIBA DISTRIBUIDORA ENERGIA S	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	15-fev-21	CDI	1,00%	BTG PAC CRED CORP 60 FI RF CRED F



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	22-fev-19	30.418	0,47%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	14-set-18	104,50%	AA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
CDB CDI	19-set-19	11.721	0,18%	CDI	BCO CAIXA GERAL BRASIL SA	19-set-18	110,50%	A- (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
CDB CDI	28-set-20	25.085	0,38%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	28-set-18	104,75%	brAAA	S&P	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
CDB CDI	23-fev-23	4.717	0,07%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	24-set-18	104,00%	Aa3.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
DPGE PRE Anual	03-out-18	5.026	0,08%	PRE	BCO A J RENNEN SA	05-set-18	29,80%	Rating	Agência	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
ELPLA3	13-set-21	15.039	0,23%	CDI	ELETROPAULO METROPOLITANA ELETRI	13-set-18	108,25%	AAA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
ELPLB3	13-set-23	35.819	0,55%	CDI	ELETROPAULO METROPOLITANA ELETRI	13-set-18	111,00%	AAA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
ERSA11	21-mai-22	19.963	0,31%	CDI	CPFL ENERGIAS RENOVAVEIS SA	12-set-18	29,43%	AAA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
IOCH18	26-mar-23	6.745	0,10%	CDI	IOCHPE MAXION SA	14-set-18	1,24%	brAAA	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	01-out-18	15.198	0,23%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	19-set-18	106,00%	Aa3.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	28-ago-19	29.483	0,45%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	14-set-18	108,50%	AA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	04-set-20	19.096	0,29%	CDI	BCO ESTADO RIO GRANDE SUL SA	04-set-18	106,50%	A (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	04-set-20	11.750	0,18%	CDI	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVE	04-set-18	104,50%	AA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	08-set-20	24.963	0,38%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	05-set-18	105,00%	Aa3.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	28-set-20	14.624	0,22%	CDI	BCO ESTADO RIO GRANDE SUL SA	28-set-18	106,50%	A (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	01-out-20	21.941	0,34%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	27-set-18	105,00%	Aa3.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	01-out-20	8.776	0,13%	CDI	CHINA CONSTRUCTION BANK (BRASIL) B	27-set-18	104,50%	AAA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	20-out-20	29.219	0,45%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	20-set-18	103,50%	Aaa.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI Anual	25-set-20	10.244	0,16%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	25-set-18	102,80%	brAAA	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI Semestral	10-abr-20	18.121	0,28%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	19-set-18	105,60%	Aaa.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
PETR35	15-ago-22	7.532	0,12%	CDI	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	14-set-18	106,75%	brA+	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
PETR35	15-ago-22	7.532	0,12%	CDI	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	14-set-18	106,75%	brA+	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
RILA11	20-dez-20	10.778	0,17%	CDI	RIOLOAN 2 COMPANHIA SECURITIZADOR	17-set-18	130,00%	AA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
RILA11	20-dez-20	9.103	0,14%	CDI	RIOLOAN 2 COMPANHIA SECURITIZADOR	14-set-18	130,00%	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	3.051	0,05%	Selic		24-set-18	0,00%	0,00%		ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI

