

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/08/2019

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	6.738.181,16	100%			0,69%	1,91%	5,13%	6,84%	9,68%	19,90%	32,97%
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,45%	1,31%	3,79%	5,25%	7,52%	16,47%	24,08%
Renda Fixa ALM	5.937.658,61	88,14%									
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC	5.937.658,61	88,14%	100%		0,72%	1,96%	5,40%	7,18%	10,15%	22,38%	35,79%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.				0,49%	1,41%	3,98%	5,51%	7,91%	17,33%	25,47%
Renda Fixa CDI	800.522,55	11,88%		0,00%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	800.522,55	11,88%	BRADESCO	0,01%	0,00%	0,50%	1,54%	3,09%	4,15%	6,24%	13,46%
Benchmark:	CDI				0,50%	1,55%	3,11%	4,18%	6,28%	13,55%	27,25%
Total	6.736.373,13	100%		0,00%	0,67%	1,89%	5,11%	6,81%	9,65%	19,87%	32,94%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.				0,49%	1,41%	3,98%	5,51%	7,91%	17,33%	25,47%

* 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.

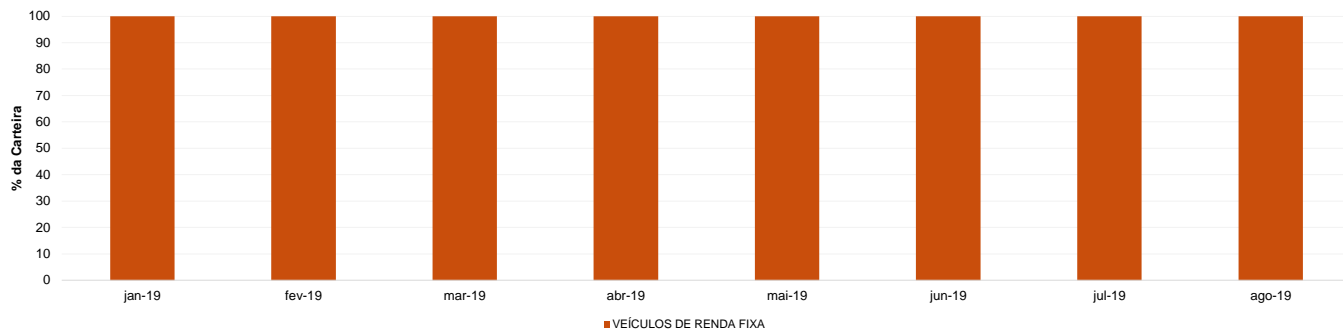
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

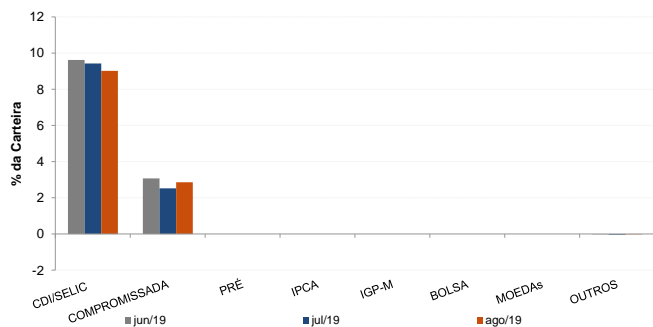
Distribuição da Carteira

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.

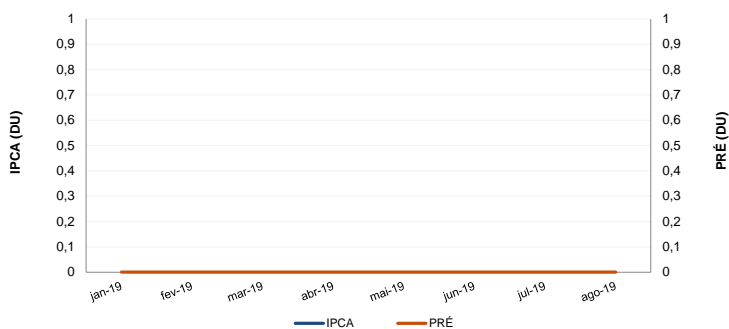
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/08/2019

Análises de Contrapartes

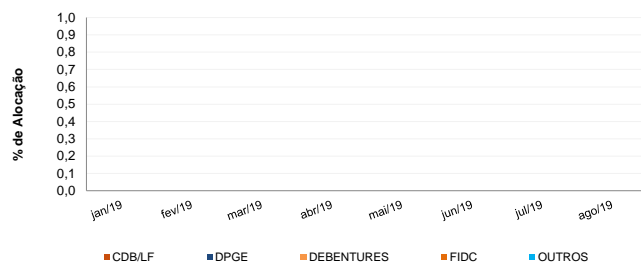
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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. As alterações são checadas primeiro verificando o rating da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Anterior	Atual	Agência	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
------------------	-----------------	-------------	----------	-------	---------	-------	--------	------	---------

Nenhuma mudança de rating encontrada.

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base:

30/08/2019

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 com alocação direta.

No caso dos ratings, é apresentada a nota da emissão e, em caso de inexistência de nota, apresenta-se a nota do emissor.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2020-09-01	01-set-20	82	0,00%	Selic	05-ago-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	977	0,01%	Selic	05-ago-19	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	496	0,01%	Selic	06-ago-19	0,01%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	576	0,01%	Selic	05-ago-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	230	0,00%	Selic	05-ago-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	8.227	0,12%	Selic	01-ago-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	378	0,01%	Selic	05-ago-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	214	0,00%	Selic	05-ago-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	817	0,01%	Selic	05-ago-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	274	0,00%	Selic	05-ago-19	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	685	0,01%	Selic	05-ago-19	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	455	0,01%	Selic	05-ago-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	137	0,00%	Selic	05-ago-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II