

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

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	ALOCÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
<b>Renda Fixa</b>	<b>3.710.366,61</b>	<b>100%</b>										
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,45%	1,31%	3,79%	5,25%	7,52%	16,47%	24,08%	
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>3.710.366,61</b>	<b>100%</b>		<b>0,01%</b>	<b>0,51%</b>	<b>1,58%</b>	<b>3,24%</b>	<b>4,45%</b>	<b>6,67%</b>	<b>14,19%</b>	<b>28,61%</b>	
BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV	1.870.629,58	50,43%	BTG PACTUAL	0,09%	0,02%	0,52%	1,65%	3,43%	4,75%	7,32%	15,74%	32,97%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	1.839.737,03	49,59%	ITAU	0,02%	0,00%	0,49%	1,51%	3,03%	4,08%	6,13%	13,23%	26,78%
Benchmark:	CDI				0,50%	1,55%	3,11%	4,18%	6,28%	13,55%	27,25%	
<b>Total</b>	<b>3.709.639,07</b>	<b>100%</b>		<b>0,01%</b>	<b>0,49%</b>	<b>1,51%</b>	<b>3,13%</b>	<b>4,27%</b>	<b>6,42%</b>	<b>13,79%</b>	<b>28,16%</b>	
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.

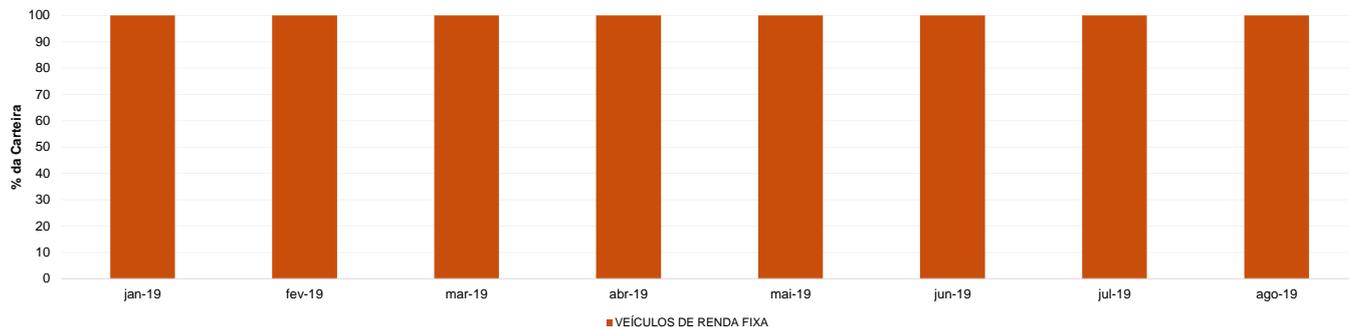
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

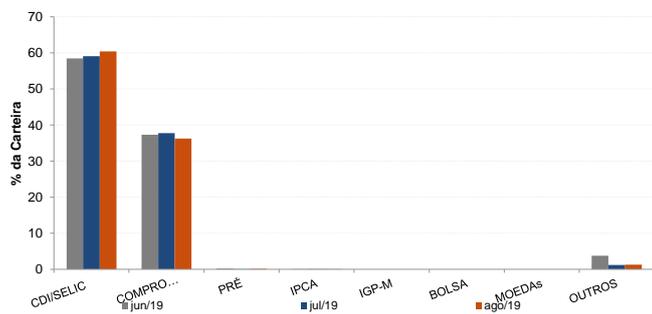
## Distribuição da Carteira

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.

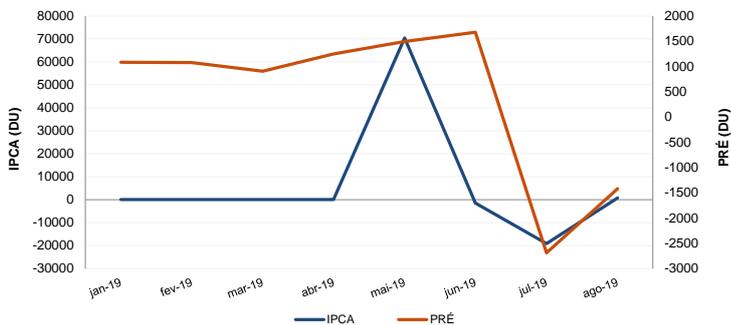
### Evolução do Patrimônio Líquido



### Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



### Evolução da Duration



## Análises de Contrapartes

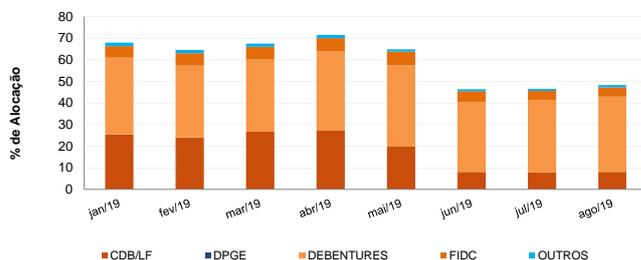
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	159,78	4,28	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
LOJAS AMERICANAS SA	59,31	1,59	AA (bra)		
LOCALIZA RENT A CAR SA	56,87	1,52	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	54,60	1,46	AA (bra)		brAAA
BCO SAFRA SA	53,91	1,44		Aa1.br	brAAA
GERDAU SA	52,16	1,40	AAA (bra)	Ba1.br	brAAA
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	49,94	1,34	AA+ (bra)		
KLABIN SA	49,12	1,32	AAA (bra)		brAAA
NATURA COSMETICOS SA	48,24	1,29	AA (bra)		brAAA
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICO	47,85	1,28		Aa3.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. As alterações são cheçadas primeiro verificando o rating da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Anterior	Atual	Agência	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
MOVI24	7,08	MOVIDA PARTICIPACOES	brAA-	brAA	S&P	27-jun-24	CDI	1,60%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CRED PRIV
SNGO15	6,47	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	BBB+ (bra)	A- (bra)	Fitch	15-nov-23	CDI	2,51%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

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.

Nenhuma operação feita no último mês.

