

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

Data-base: 28/02/2019

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	231.516.106,31	87,06%			0,46%	2,28%	4,75%	1,68%	6,50%	16,79%		
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,74%	1,88%	3,59%	1,41%	8,05%	15,51%	25,85%	
Renda Fixa Total Return	216.746.890,00	81,50%		0,52%	0,44%	2,64%	5,17%	1,69%	7,51%	18,47%		
ATLANTIDA FI MULT	110.451.521,91	41,53%	ITAU	100%	0,61%	0,36%	2,79%	5,49%	1,75%	8,59%	18,22%	33,35%
ITAPEMA FI MULT	106.295.368,09	39,97%	SUL AMERICA	100%	0,44%	0,53%	2,49%	4,84%	1,63%	6,60%	18,71%	35,86%
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,74%	1,88%	3,59%	1,41%	8,05%	15,51%	25,85%	
Renda Fixa ALM	10.237.293,53	3,85%										
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	10.237.293,53	2,25%		100%	0,81%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,77%	1,97%	3,78%	1,48%	8,45%	16,37%	27,26%	
Renda Fixa CDI	4.531.922,78	1,70%		0,00%	0,55%	1,74%	3,46%	1,14%	7,15%	17,10%		
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	763.319,89	0,29%	BRABESCO	0,01%	0,00%	0,49%	1,53%	3,05%	1,03%	6,36%	15,97%	31,91%
BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV	1.808.643,53	0,68%	BTG PACTUAL	0,07%	0,01%	0,63%	1,93%	3,76%	1,28%	7,62%	18,84%	39,05%
ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	860.654,37	0,32%	ITAU	0,08%	0,00%	0,49%	1,51%	3,01%	1,02%	6,27%	15,71%	31,86%
FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV	1.099.304,99	0,41%	VOTORANTIM	0,08%	0,01%	0,53%	1,60%	3,16%	1,09%	6,62%	16,53%	33,54%
Benchmark:	CDI				0,49%	1,54%	3,07%	1,04%	6,41%	15,95%	32,05%	
Renda Variável	14.686.491,38	5,52%			0,81%	10,93%	29,12%	8,36%	19,68%	44,06%		
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.				-1,63%	7,57%	26,47%	9,30%	15,35%	52,07%	143,99%	
Renda Variável Ativa	14.686.491,38	5,52%		6,32%	-1,80%	8,13%	25,97%	5,62%	16,46%	45,00%		
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.310.207,09	0,87%	AZ QUEST	0,26%	6,59%	-2,38%	4,84%	23,19%	4,87%	13,97%	50,08%	110,54%
BRABESCO FIA SELECTION	2.324.363,75	0,87%	BRABESCO	0,38%	6,07%	-1,06%	5,08%	23,56%	4,77%	15,04%	55,25%	136,67%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	3.555.607,22	1,34%	BTG PACTUAL	0,36%	5,43%	-1,86%	8,67%	29,79%	5,63%	18,26%	54,14%	93,98%
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FC FI	4.407.184,43	1,66%	ITAU	0,31%	8,12%	-1,49%	10,59%	28,32%	6,67%	22,46%	56,26%	147,52%
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	2.089.128,89	0,79%	NEO GESTAO	0,45%	6,19%	-2,56%	9,13%	19,94%	5,15%	5,62%	48,90%	106,02%
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.				-1,63%	7,57%	26,47%	9,30%	15,35%	52,07%	143,99%	
Estruturado	19.739.440,96	7,42%			0,21%	2,10%	4,12%	1,87%	5,44%	17,07%		
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,65%	2,03%	4,07%	1,37%	8,54%	20,61%	40,10%	
Multimercado Estruturado	19.739.440,96	7,42%		0,75%	-0,03%	1,79%	3,80%	1,56%	5,01%	16,48%		
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	5.039.764,57	1,90%	ABSOLUTE	0,36%	0,33%	0,22%	1,43%	3,28%	1,00%	8,36%	21,11%	54,96%
AZ QUEST MULT FC FI MULT	3.763.168,42	1,42%	AZ QUEST	0,62%	1,53%	-0,48%	1,45%	4,20%	1,20%	6,54%	19,84%	52,63%
KINEA CHRONOS FI MULT	9.368.365,86	3,52%	KINEA	0,12%	0,83%	-0,04%	2,79%	5,41%	1,77%	9,07%	22,44%	53,49%
SPX NIMITZ ESTRUTURADO FICFI MULT	1.568.142,11	0,59%	SPX	0,11%	3,13%	0,24%	-1,91%	-4,09%	1,29%	0,63%	17,91%	39,78%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,65%	2,03%	4,07%	1,37%	8,54%	20,61%	40,10%	
Total	265.933.976,46	100%		0,80%	0,31%	3,04%	5,93%	1,94%	7,24%	17,77%		
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,77%	1,97%	3,78%	1,48%	8,45%	16,37%	27,26%	

* 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.

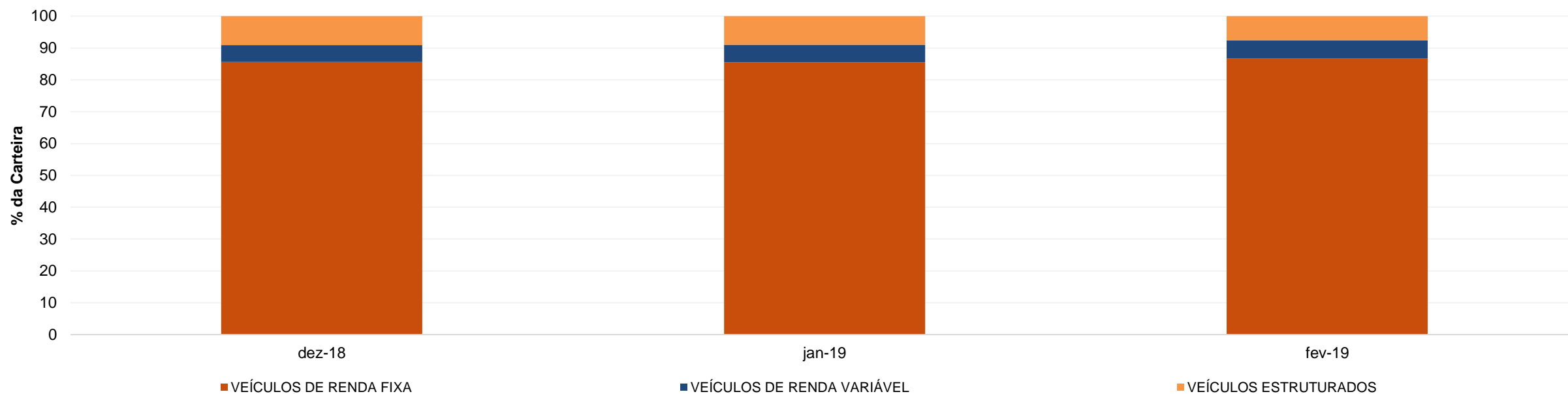
O valor total apresentado nesse relatório é o patrimônio líquido extraído através do arquivo XML do plano.

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.

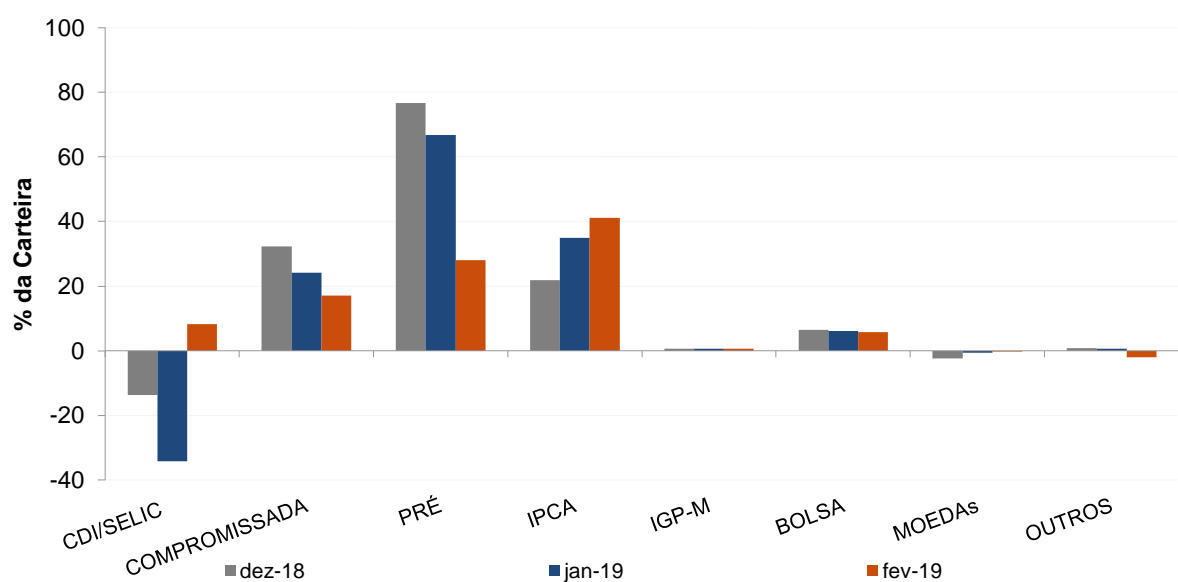
Distribuição da Carteira

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.

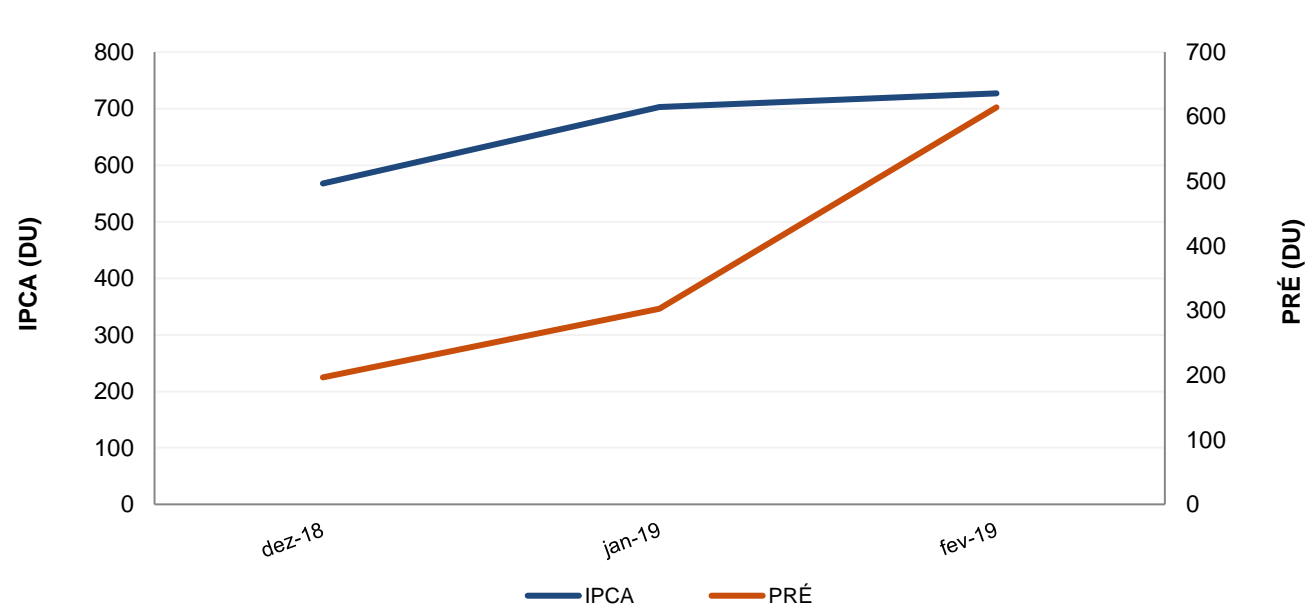
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Renda Variável

Essa seção abrange análises sobre a carteira de Renda Variável. Todas as informações sobre concentração são relativas ao total da carteira de Renda Variável do plano.

Maiores Exposições

A análise de maiores exposições apresenta as ações com maior participação na carteira, o setor ao qual pertencem e a evolução da posição em relação ao mês anterior.

Nome	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	985,29	6,46	585,10	3,53
ITUB4	Intermediários Financeiros	928,37	6,08	1.001,18	6,04
RENT3	Diversos	862,77	5,65	779,25	4,70
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	751,68	4,93	816,80	4,93
VALE3	Mineração	712,91	4,67	618,60	3,73
BBDC4	Intermediários Financeiros	674,49	4,42	946,54	5,71
LREN3	Comércio	647,97	4,25	923,54	5,57
EQTL3	Energia Elétrica	574,02	3,76	708,69	4,27
BBAS3	Intermediários Financeiros	414,10	2,71	524,88	3,17
RAIL3	Transporte	374,78	2,46	337,35	2,03

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

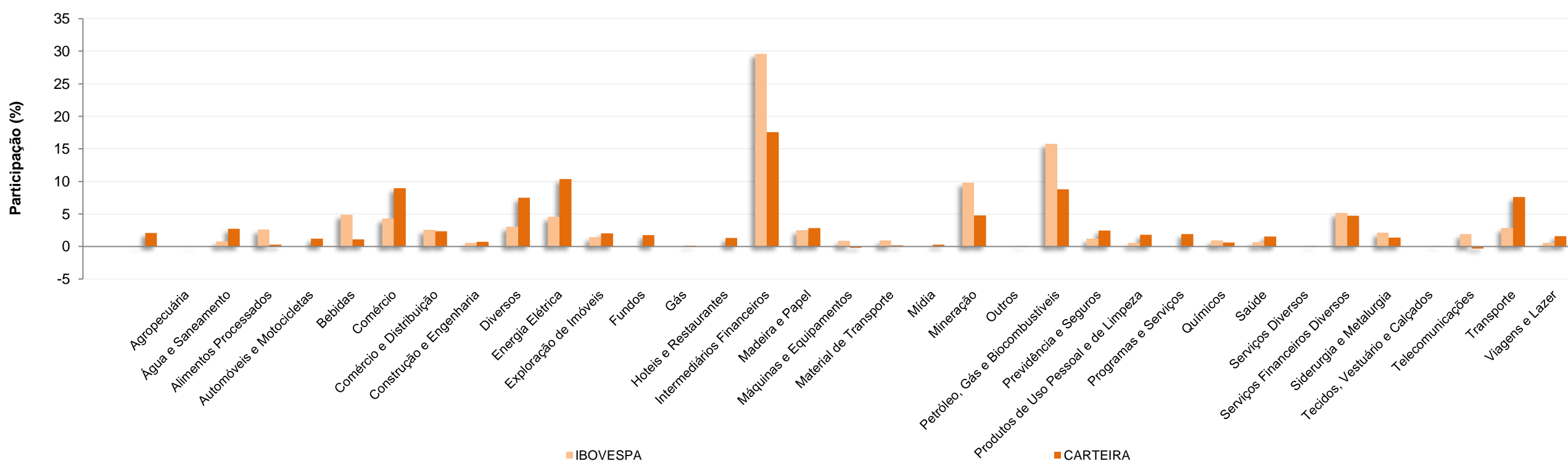
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
FIBR3	22,21	0,15	0,00	Sem Liquidez
PETR4	985,29	6,46	0,00	1
ITUB4	928,37	6,08	0,00	1
RENT3	862,77	5,65	0,00	1
B3SA3	751,68	4,93	0,00	1
VALE3	712,91	4,67	0,00	1
BBDC4	674,49	4,42	0,00	1
LREN3	647,97	4,25	0,00	1
EQTL3	574,02	3,76	0,00	1
BBAS3	414,10	2,71	0,00	1

* em mil R\$

Concentração por setor

A concentração por setor segrega as ações da carteira em setores da Bovespa e compara os percentuais de alocação da carteira com os do benchmark de renda variável.



RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

Data-base: 28/02/2019

Análises de Contrapartes

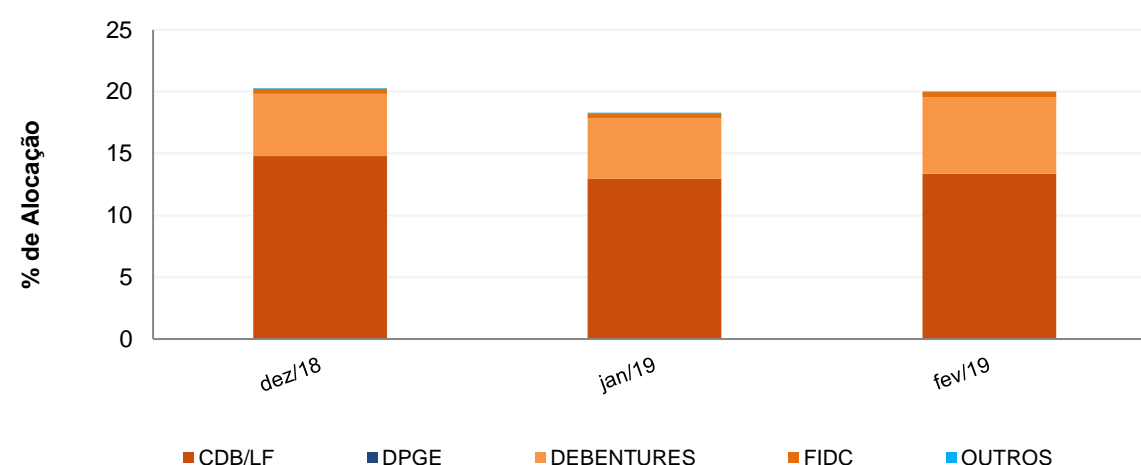
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO BRADESCO SA	12.473,55	4,74	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO ITAU SA	5.814,32	2,21	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO BRASIL SA	5.737,18	2,18	AA (bra)	Aa1.br	
LOCALIZA RENT A CAR SA	4.225,19	1,61	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO SAFRA SA	3.304,97	1,26		Aa1.br	brAAA
BCO VOTORANTIM SA	2.980,66	1,13		Aa3.br	brAAA
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	2.596,44	0,99	AA (bra)	Aaa.br	brAAA
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.471,21	0,94			brAAA
CCR SA	2.112,65	0,80	AA (bra)	A2.br	
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	1.496,90	0,57		Aaa.br	

* 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 com alocação direta.

Títulos Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	x de Compr	Rating	Agência	Veículo
ALGA18	15-fev-24	328.877	0,13%	CDI	ALGAR TELECOM SA	28-fev-19	0,60%	brAAA	S&P	ATLANTIDA FI MULT
ESTC15	15-fev-22	1.130.391	0,43%	CDI	ESTACIO PARTICIPACOES SA	21-fev-19	0,58%	brAAA	S&P	ATLANTIDA FI MULT
ESTC25	15-fev-24	1.146.411	0,44%	CDI	ESTACIO PARTICIPACOES SA	21-fev-19	0,79%	brAAA	S&P	ATLANTIDA FI MULT
ESTC25	15-fev-24	335	0,00%	CDI	ESTACIO PARTICIPACOES SA	21-fev-19	0,81%	brAAA	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
IOCH19	11-fev-24	695.875	0,26%	CDI	IOCHPE MAXION SA	15-fev-19	0,75%	brAAA	S&P	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	22-fev-21	12.490	0,00%	CDI	BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	22-fev-19	103,40%	brAAA	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	28-fev-21	200.000	0,08%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	28-fev-19	103,00%	brAAA	S&P	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	28-fev-22	400.000	0,15%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	28-fev-19	103,40%	brAAA	S&P	ATLANTIDA FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	x de Compr	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2019-03-01	01-mar-19	1.666	0,00%	Selic		13-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	1.245	0,00%	Selic		13-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	787	0,00%	Selic		13-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	658	0,00%	Selic		12-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	600	0,00%	Selic		13-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	538	0,00%	Selic		13-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	105	0,00%	Selic		13-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	52	0,00%	Selic		13-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	7.273	0,00%	Selic		05-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	399	0,00%	Selic		12-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	10.014	0,00%	Selic		12-fev-19	0,02%	0,00%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2021-03-01	01-mar-21	7.863	0,00%	Selic		21-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	4.168	0,00%	Selic		22-fev-19	0,02%	0,00%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.609	0,00%	Selic		06-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.245	0,00%	Selic		05-fev-19	0,02%	0,00%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2021-03-01	01-mar-21	509	0,00%	Selic		01-fev-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	8	0,00%	Selic		07-fev-19	0,02%	0,00%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.621	0,00%	Selic		21-fev-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	917	0,00%	Selic		25-fev-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	765	0,00%	Selic		26-fev-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	15.373	0,01%	Selic		05-fev-19	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2022-09-01	01-set-22	8.351	0,00%	Selic		08-fev-19	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2022-09-01	01-set-22	576	0,00%	Selic		05-fev-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	423	0,00%	Selic		08-fev-19	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	33.348	0,01%	Selic		15-fev-19	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	31.572	0,01%	Selic		01-fev-19	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	4.175	0,00%	Selic		15-fev-19	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.091	0,00%	Selic		06-fev-19	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	589	0,00%	Selic		12-fev-19	0,02%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2023-09-01	01-set-23	5.693	0,00%	Selic		11-fev-19	0,01%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2.506	0,00%	Selic		19-fev-19	0,02%	0,00%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	5.039.424	1,92%	IPCA		21-fev-19	3,67%	3,70%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	4.427.860	1,68%	IPCA		21-fev-19	3,68%	3,70%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	3.337.978	1,27%	IPCA		25-fev-19	3,67%	3,68%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.680.947	0,64%	IPCA		21-fev-19	3,68%	3,70%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	594.481	0,23%	IPCA		20-fev-19	3,66%	3,72%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	362.155	0,14%	IPCA		21-fev-19	3,68%	3,70%	ATLANTIDA FI MULT

