

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/07/2019

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	
Renda Fixa	6.834.573,13	100%			0,72%	2,15%	5,22%	6,10%	9,74%	20,03%	33,36%	
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,55%	1,33%	4,09%	4,78%	7,32%	16,58%	24,51%	
Renda Fixa ALM	6.018.553,92	88,08%										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC	6.018.553,92	88,08%	100%		0,74%	2,22%	5,49%	6,42%	10,22%	22,73%	36,45%	
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.				0,58%	1,43%	4,28%	5,00%	7,72%	17,45%	25,91%	
Renda Fixa CDI	816.019,21	11,94%		0,00%								
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	816.019,21	11,94%	BRADESCO	0,01%	0,00%	0,56%	1,58%	3,08%	3,63%	6,30%	13,80%	28,07%
Benchmark:	CDI				0,57%	1,59%	3,10%	3,66%	6,35%	13,89%	28,15%	
Total	6.832.703,71	100%		0,00%	0,72%	2,15%	5,22%	6,10%	9,74%	20,03%	33,36%	
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.				0,58%	1,43%	4,28%	5,00%	7,72%	17,45%	25,91%	

* 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.

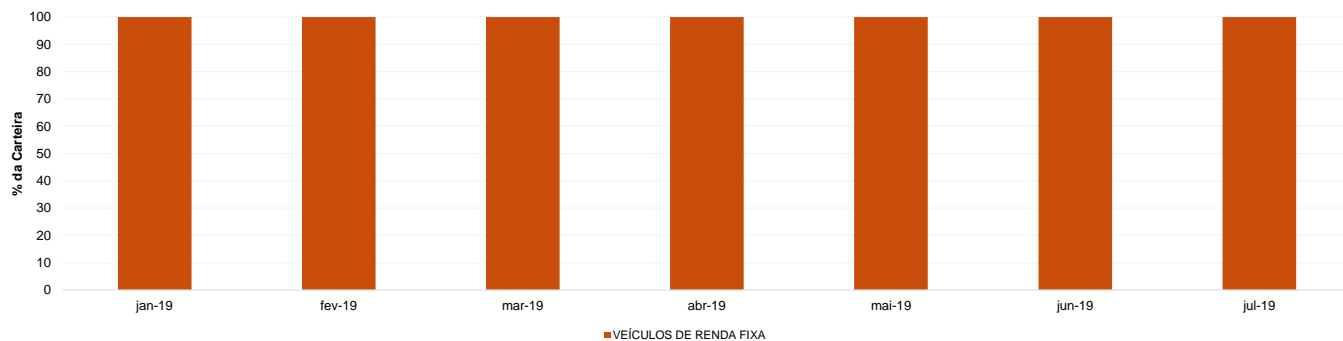
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

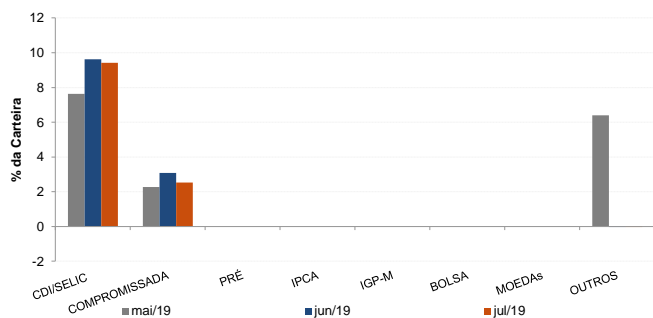
Distribuição da Carteira

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.

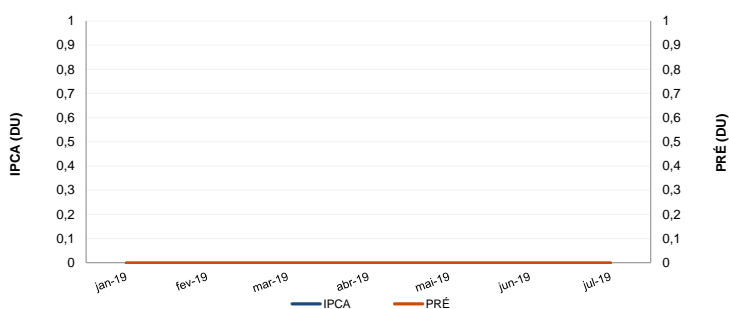
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/07/2019

Análises de Contrapartes

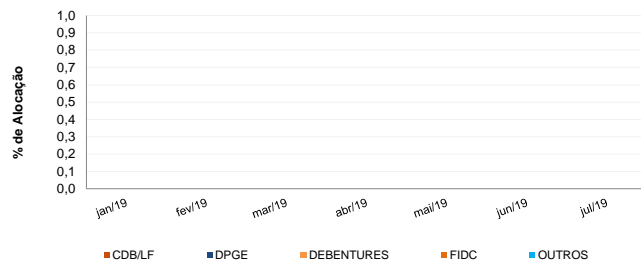
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

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

Nenhuma mudança de rating encontrada.

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base:

31/07/2019

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.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2020-09-01	01-set-20	2.296	0,03%	Selic	23-jul-19	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.148	0,02%	Selic	16-jul-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

