

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

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	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
<b>Renda Fixa</b>	<b>3.753.575,75</b>	<b>100%</b>									
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,55%	1,33%	4,09%	4,78%	7,32%	16,58%	24,51%
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>3.753.575,75</b>	<b>100%</b>		<b>0,01%</b>	<b>0,58%</b>	<b>1,65%</b>	<b>3,31%</b>	<b>3,92%</b>	<b>6,83%</b>	<b>14,68%</b>	<b>29,52%</b>
BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV	1.860.935,82	49,59%	BTG PACTUAL	0,09%	0,02%	0,61%	1,75%	3,54%	4,21%	7,48%	16,17%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	1.892.639,93	50,43%	ITAU	0,02%	0,00%	0,55%	1,55%	3,02%	3,57%	6,19%	13,57%
Benchmark:	CDI				0,57%	1,59%	3,10%	3,66%	6,35%	13,89%	28,15%
<b>Total</b>	<b>3.752.840,86</b>	<b>100%</b>		<b>0,01%</b>	<b>0,56%</b>	<b>1,59%</b>	<b>3,18%</b>	<b>3,76%</b>	<b>6,60%</b>	<b>14,31%</b>	<b>29,09%</b>
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.

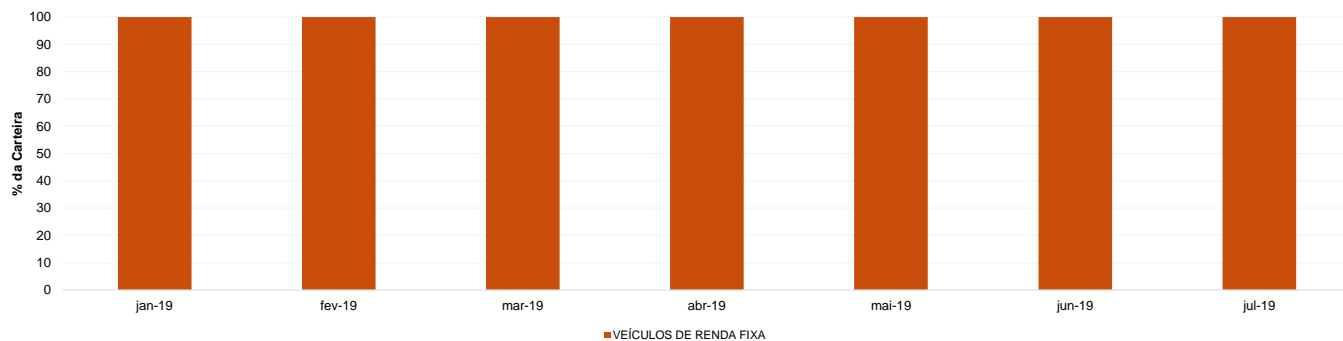
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

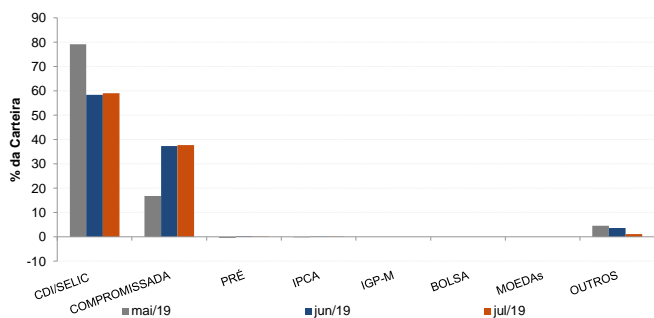
## Distribuição da Carteira

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.

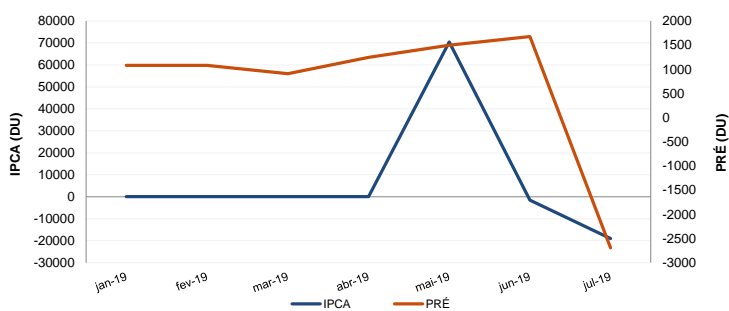
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



## Análises de Contrapartes

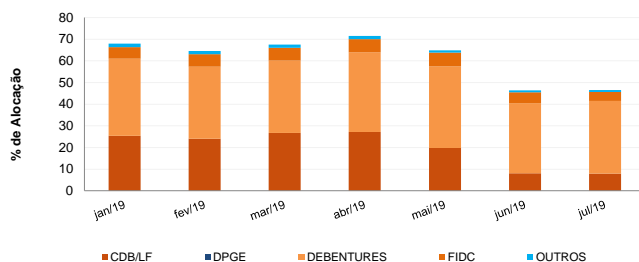
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	159,28	4,22	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	57,70	1,53	AA (bra)		brAAA
LOJAS AMERICANAS SA	55,34	1,47	AA (bra)		
LOCALIZA RENT A CAR SA	52,90	1,40	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO SAFRA SA	50,15	1,33		Aa1.br	brAAA
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	48,85	1,30	AA+ (bra)		
GERDAU SA	48,57	1,29	AAA (bra)	Ba1.br	brAAA
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	47,29	1,25	AA+ (bra)		
NATURA COSMETICOS SA	47,26	1,25	AA (bra)		brAAA
KLABIN SA	46,23	1,23	AAA (bra)		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
HAPV11	33,97	HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	Novo	AAA (bra)	Fitch	10-jul-24	CDI	109,00%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CRED PRIV
HAPV11	0,17	HAPVIDA PARTICIPACOES INVESTIMENTO SA	Novo	AAA (bra)	Fitch	10-jul-24	CDI	109,00%	BTG PAC CRED CORP MAS II FI RF CRED PRIV
MOVI13	2,68	MOVIDA PARTICIPACOES	A+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	07-jun-24	CDI	1,85%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CRED PRIV
MOVI23	10,46	MOVIDA PARTICIPACOES	A+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	07-jun-24	CDI	2,25%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CRED PRIV
MOVI33	10,01	MOVIDA PARTICIPACOES	A+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	07-jun-24	CDI		BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CRED PRIV

RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

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.

Nenhuma operação feita no último mês.