

RBSPREV - RBSPREV PGA

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
Renda Fixa	774.061,48	100%				0,57%	1,48%	2,80%	3,30%	5,65%	12,64%	26,68%
Benchmark:	CDI					0,57%	1,59%	3,10%	3,66%	6,35%	13,89%	28,15%
RF CRÉDITO	569.283,89	73,59%										
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	569.283,89	73,59%	VOTORANTIM	0,34%	0,00%	0,57%	1,61%	3,14%	3,70%	6,38%	14,06%	28,72%
Benchmark:	CDI					0,57%	1,59%	3,10%	3,66%	6,35%	13,89%	28,15%
RF REFERENCIADO DI	204.777,59	26,47%										
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	204.777,59	26,47%	BRADESCO	0,00%	0,00%	0,55%	1,54%	3,01%	3,55%	6,17%	13,51%	27,58%
Benchmark:	CDI					0,57%	1,59%	3,10%	3,66%	6,35%	13,89%	28,15%
Total	773.608,40	100%			0,00%	0,57%	1,48%	2,80%	3,30%	5,65%	12,64%	26,68%
Benchmark:	CDI					0,57%	1,59%	3,10%	3,66%	6,35%	13,89%	28,15%

* 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.

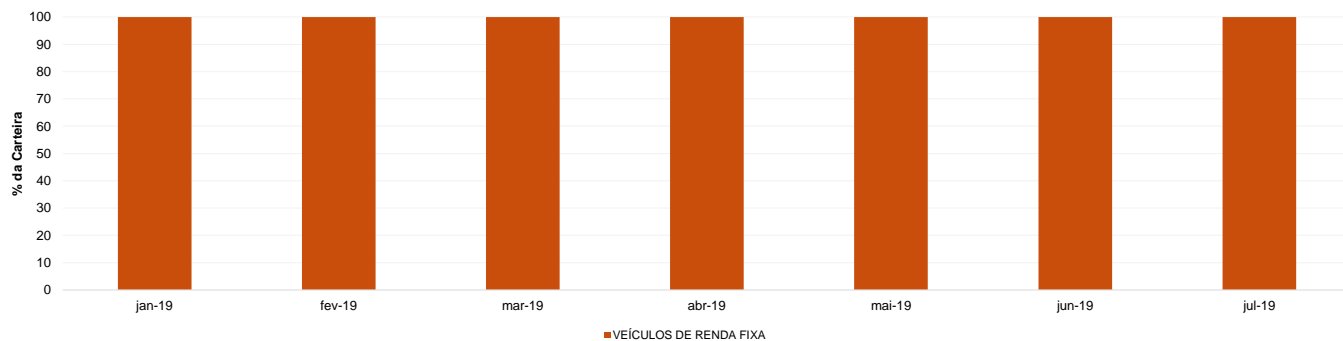
O valor total apresentado nesse relatório é o patrimônio líquido extraído através do arquivo XML do plano.

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.

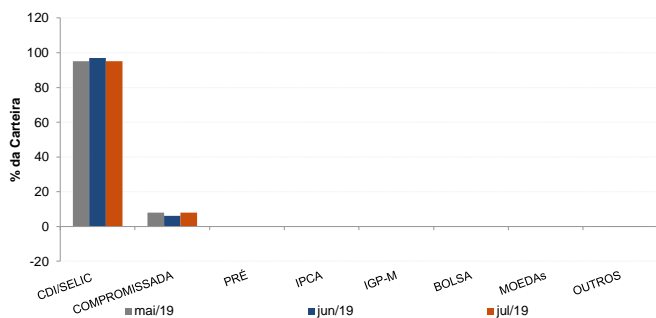
Distribuição da Carteira

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.

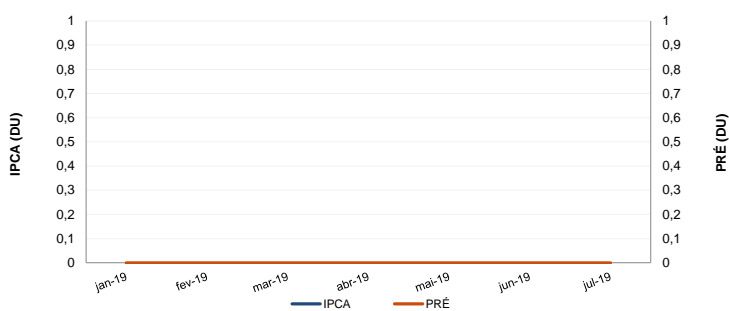
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/07/2019

Análises de Contrapartes

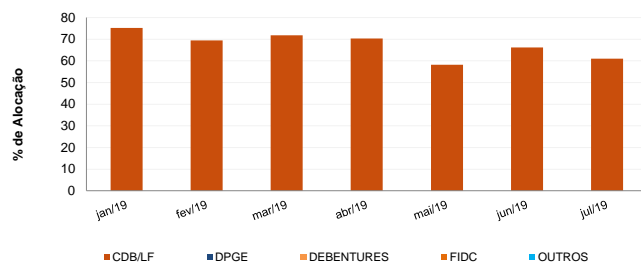
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO SAFRA SA	80,17	10,17		Aa1.br	brAAA
BCO BBM SA	75,04	9,52	AAA (bra)	Aaa.br	
BCO VOTORANTIM SA	62,53	7,93		Aa3.br	brAAA
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM ^A)	58,64	7,44	AAA (bra)	Aa2.br	brAAA
BCO VOLKSWAGEN SA	40,54	5,14			brAAA
BANCO RCI BRASIL SA	33,34	4,23		Aaa.br	
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INV	27,16	3,45	AA (bra)	Aa1.br	
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	25,58	3,24	AA (bra)	Aa2.br	brAAA
BCO TOYOTA BRASIL SA	22,93	2,91			brAAA
BCO BTG PACTUAL SA	17,79	2,26	AA (bra)	Aa2.br	brAA+

* 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 PGA

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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx Compra	Rating	Agência	Veículo
LF CDI	16-set-19	2.843	0,36%	CDI	BCO GMAC SA	30-jul-19	0,14%	AAA (bra)	Fitch	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	09-jul-21	25.577	3,24%	CDI	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICI	08-jul-19	105,00%	AA (bra)	Fitch	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1.047	0,13%	Selic	19-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	940	0,12%	Selic	15-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	537	0,07%	Selic	12-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	246	0,03%	Selic	16-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	224	0,03%	Selic	25-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	157	0,02%	Selic	30-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	35	0,00%	Selic	19-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	17	0,00%	Selic	12-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	8	0,00%	Selic	12-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	3	0,00%	Selic	12-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2	0,00%	Selic	30-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2	0,00%	Selic	15-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2	0,00%	Selic	15-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	16-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	17-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	16-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	22-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	18-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1	0,00%	Selic	23-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	0	0,00%	Selic	16-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-09-01	01-set-20	671	0,09%	Selic	25-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.681	0,21%	Selic	29-jul-19	0,03%	0,00%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LFT 2021-03-01	01-mar-21	123	0,02%	Selic	31-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2021-03-01	01-mar-21	40	0,01%	Selic	19-jul-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2021-09-01	01-set-21	7	0,00%	Selic	19-jul-19	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2022-03-01	01-mar-22	895	0,11%	Selic	30-jul-19	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.029	0,13%	Selic	29-jul-19	0,02%	0,00%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LFT 2024-09-01	01-set-24	50.265	6,38%	Selic	31-jul-19	0,02%	0,00%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LFT 2024-09-01	01-set-24	280	0,04%	Selic	29-jul-19	0,02%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA