

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

Data-base: 29/03/2019

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	227.806.873,67	85,53%			0,57%	2,26%	4,89%	2,26%	6,31%	16,15%	32,44%
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				1,05%	2,48%	3,85%	2,48%	8,70%	15,99%	26,16%
Renda Fixa Total Return	217.176.154,31	81,54%		0,60%	0,56%	3,08%	6,14%	3,08%	7,70%	18,72%	
ATLANTIDA FI MULT	111.197.356,75	41,75%	ITAU	100%	0,65%	0,52%	2,27%	5,70%	2,27%	7,92%	32,78%
ITAPEMA FI MULT	105.978.797,56	39,79%	SUL AMERICA	100%	0,54%	0,61%	2,25%	4,90%	2,25%	5,94%	34,67%
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				1,05%	2,48%	3,85%	2,48%	8,70%	15,99%	26,16%
Renda Fixa ALM	6.034.677,96	2,27%			1,03%	2,75%	4,97%	2,75%	10,92%	23,02%	37,64%
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.034.677,96	2,27%		100%	1,03%	2,75%	4,97%	2,75%	10,92%	23,02%	37,64%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				1,08%	2,57%	4,04%	2,57%	9,11%	16,85%	27,58%
Renda Fixa CDI	4.596.041,41	1,73%		0,01%	0,50%	1,64%	3,44%	1,64%	7,11%	16,46%	32,83%
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	822.512,14	0,31%	BRABESCO	0,01%	0,00%	0,47%	1,50%	3,05%	1,50%	6,29%	15,30%
BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV	1.818.440,30	0,68%	BTG PACTUAL	0,07%	0,01%	0,54%	1,83%	3,75%	1,83%	7,54%	18,01%
ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	838.241,17	0,31%	ITAU	0,08%	0,00%	0,46%	1,49%	3,01%	1,49%	6,21%	30,95%
FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV	1.116.847,81	0,42%	VOTORANTIM	0,09%	0,01%	0,48%	1,57%	3,16%	1,57%	6,57%	15,83%
Benchmark:	CDI				0,47%	1,51%	3,07%	1,51%	6,34%	15,29%	31,15%
Renda Variável	14.600.969,03	5,48%			-0,58%	7,72%	26,84%	7,72%	17,87%	45,50%	80,33%
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.				0,05%	9,34%	22,00%	9,34%	15,10%	55,64%	108,15%
Renda Variável Ativa	14.600.969,03	5,48%		7,71%	-0,58%	5,01%	23,69%	5,01%	14,06%	46,90%	87,89%
AZ QUEST AÇÕES FICFIA	2.291.983,19	0,86%	AZ QUEST	0,27%	7,60%	-0,79%	4,04%	18,55%	4,04%	11,64%	55,00%
BRABESCO FIA SELECTION	2.329.873,84	0,87%	BRABESCO	0,38%	7,83%	0,24%	5,02%	18,80%	5,02%	13,05%	64,29%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	3.505.057,35	1,32%	BTG PACTUAL	0,39%	7,34%	-1,42%	4,12%	25,19%	4,12%	14,40%	50,91%
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FC FI	4.366.616,15	1,64%	ITAU	0,32%	9,03%	-0,92%	5,69%	28,79%	5,69%	19,15%	119,53%
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	2.107.438,49	0,79%	NEO GESTAO	0,47%	7,77%	0,88%	6,07%	21,95%	6,07%	5,90%	47,28%
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.				0,05%	9,34%	22,00%	9,34%	15,10%	55,64%	108,15%
Estruturado	23.944.745,62	8,99%			0,22%	2,09%	3,93%	2,09%	4,63%	15,91%	32,83%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,62%	2,00%	4,08%	2,00%	8,45%	19,88%	39,11%
Multimercado Estruturado	23.944.745,62	8,99%		1,04%	0,22%	1,78%	3,61%	1,78%	4,19%	15,32%	32,99%
ABSOLUTE ALPHA GLOBAL FC FI MULT	5.081.436,93	1,91%	ABSOLUTE	0,31%	0,29%	0,83%	1,83%	3,58%	1,83%	8,91%	20,44%
AZ QUEST MULT FC FI MULT	3.753.966,03	1,41%	AZ QUEST	0,63%	2,06%	-0,24%	0,95%	4,18%	0,95%	5,45%	17,78%
KINEA CHRONOS FI MULT	11.865.785,44	4,46%	KINEA	0,13%	1,22%	-0,03%	1,74%	5,13%	1,74%	7,58%	21,30%
SPX NIMITZ ESTRUTURADO FICFI MULT	3.243.557,23	1,22%	SPX	0,22%	2,23%	0,71%	2,00%	-4,37%	2,00%	0,95%	16,53%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,62%	2,00%	4,08%	2,00%	8,45%	19,88%	39,11%
Total	266.344.689,13	100%			0,96%	0,48%	2,43%	5,94%	2,43%	6,92%	17,03%
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				1,08%	2,57%	4,04%	2,57%	9,11%	16,85%	27,58%

* 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.

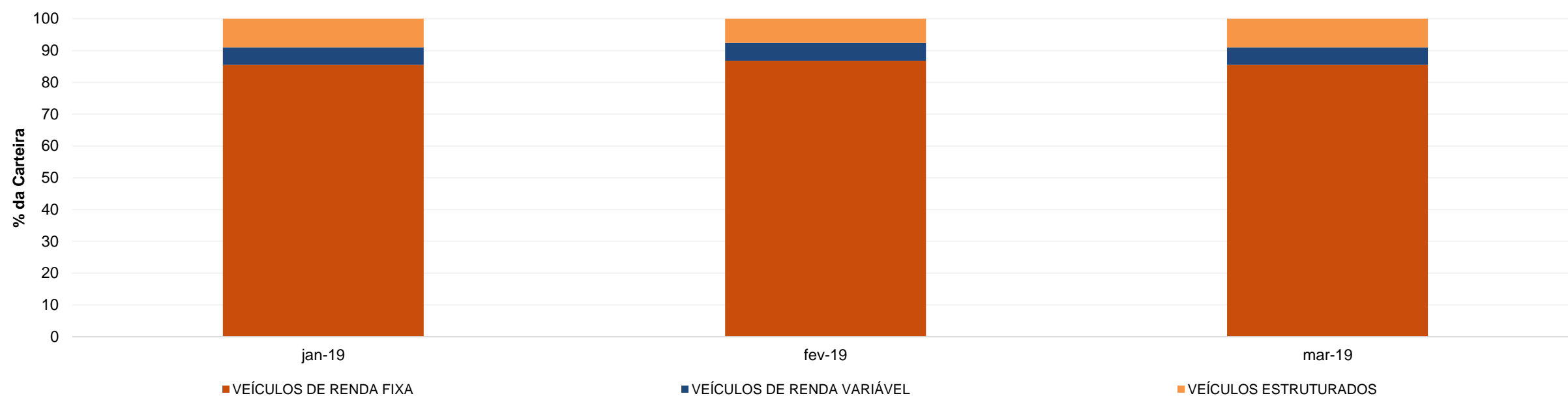
O valor total apresentado nesse relatório é o patrimônio líquido extraído através do arquivo XML do plano.

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.

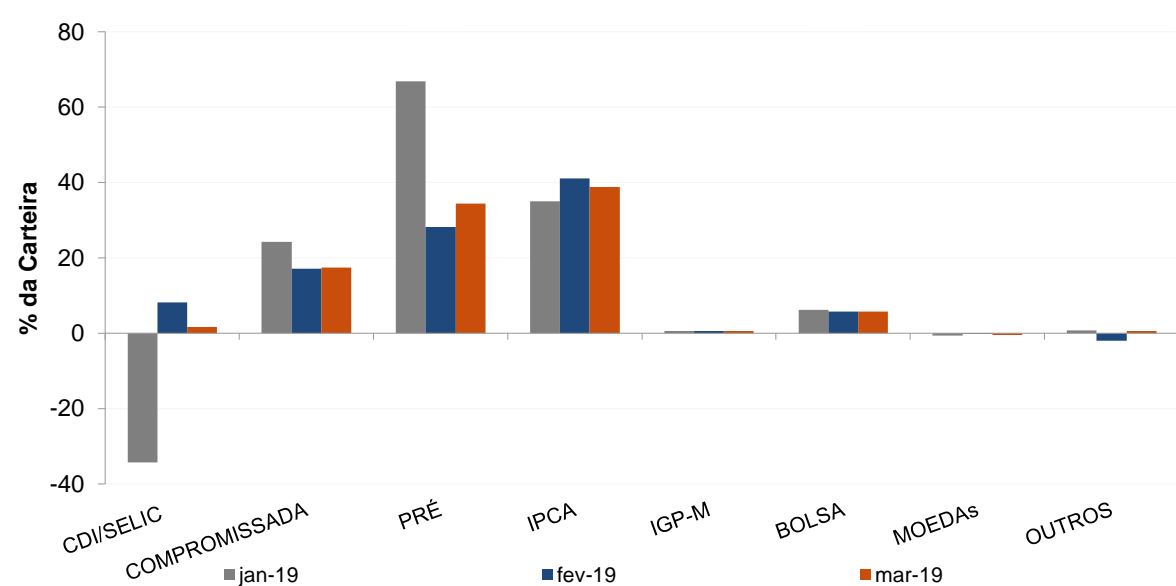
Distribuição da Carteira

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.

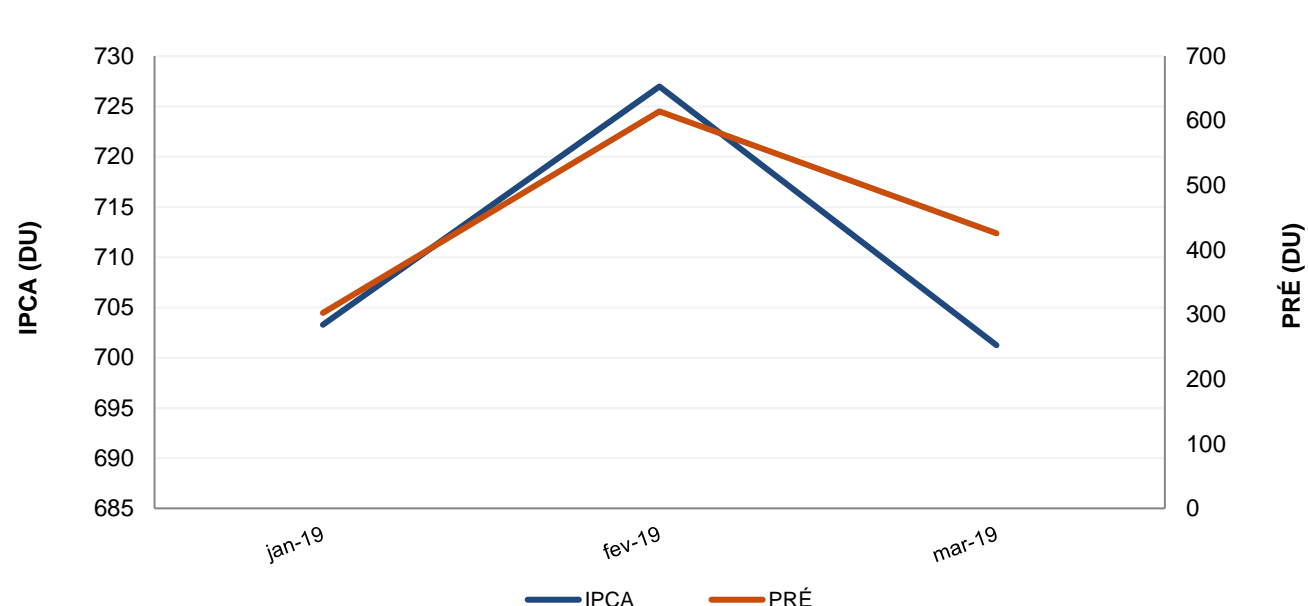
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
RENT3	Diversos	865,08	5,45	862,77	5,65
BBDC4	Intermediários Financeiros	839,12	5,29	674,49	4,42
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	807,79	5,09	985,29	6,46
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	772,50	4,87	751,68	4,93
VALE3	Mineração	771,59	4,86	712,91	4,67
LREN3	Comércio	768,16	4,84	647,97	4,25
ITUB4	Intermediários Financeiros	758,93	4,78	928,37	6,08
EQTL3	Energia Elétrica	541,35	3,41	574,02	3,76
BBAS3	Intermediários Financeiros	515,38	3,25	414,10	2,71
LINX3	Programas e Serviços	453,29	2,86	270,16	1,77

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

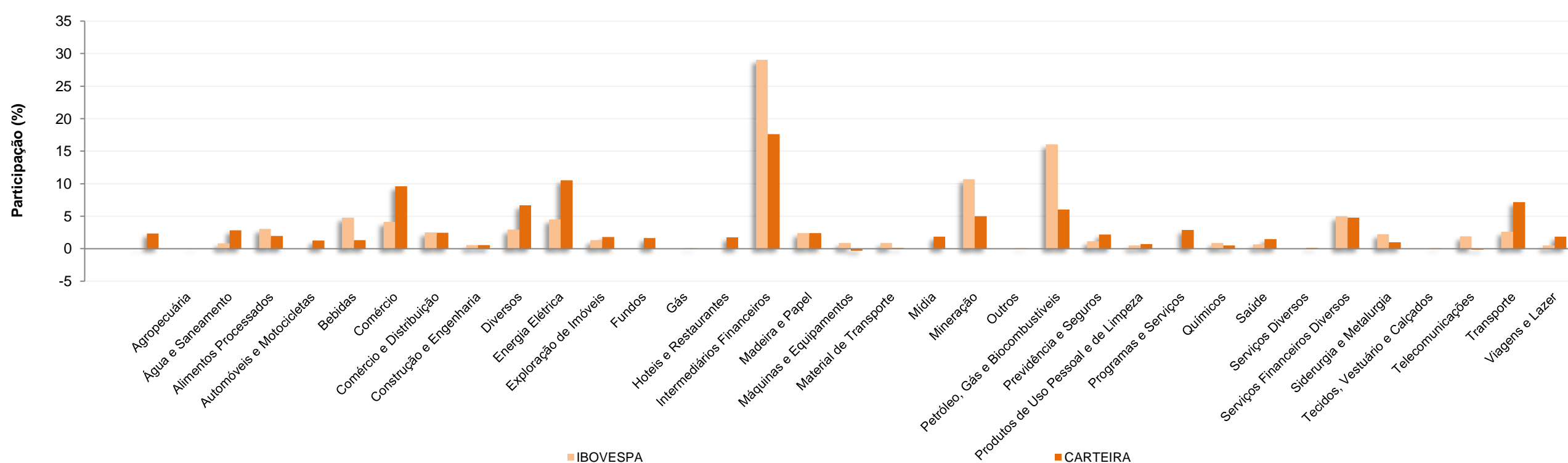
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
RENT3	865,08	5,45	0,00	1
BBDC4	839,12	5,29	0,00	1
PETR4	807,79	5,09	0,00	1
B3SA3	772,50	4,87	0,00	1
VALE3	771,59	4,86	0,00	1
LREN3	768,16	4,84	0,00	1
ITUB4	758,93	4,78	0,00	1
EQTL3	541,35	3,41	0,00	1
BBAS3	515,38	3,25	0,00	1
LINX3	453,29	2,86	0,01	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: 29/03/2019

Análises de Contrapartes

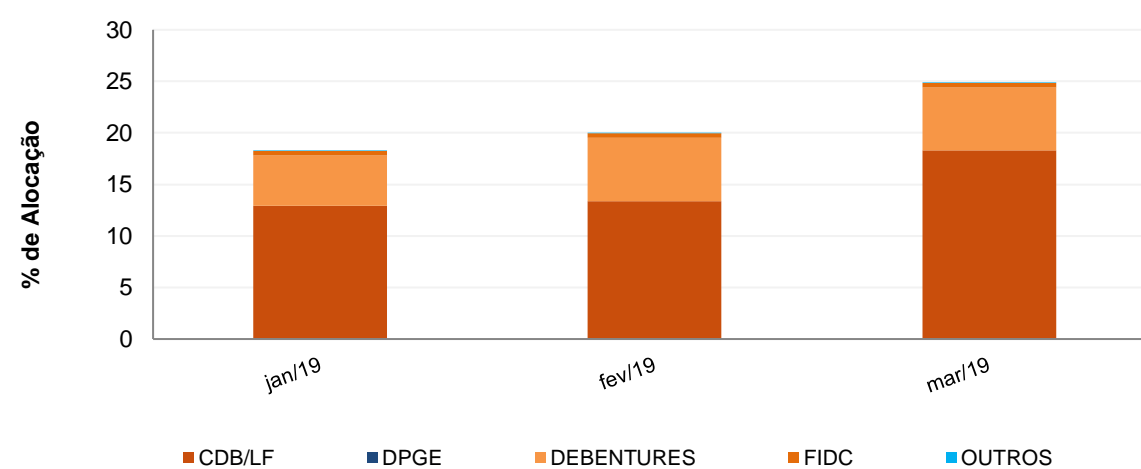
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	15.790,07	5,93	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO VOTORANTIM SA	8.198,91	3,08		Aa3.br	brAAA
BCO SAFRA SA	7.733,84	2,91		Aa1.br	brAAA
BCO BRASIL SA	5.871,34	2,21	AA (bra)	Aa1.br	
BCO ITAU SA	5.866,99	2,21	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
LOCALIZA RENT A CAR SA	4.239,57	1,59	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
ESTACIO PARTICIPACOES SA	2.484,65	0,93			brAAA
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	2.425,83	0,91	AA (bra)	Aaa.br	brAAA
CCR SA	2.113,54	0,79	AA (bra)	A2.br	
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	1.521,48	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
LLIS10	15,68	RESTOQUE COMERCIO CONFECOES ROUPAS S	Novo	A- (bra)	Fitch	20-mar-22	CDI	2,30%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CRED PRIV



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.

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
CSAN12	28-fev-21	4.224	0,00%	CDI	COSAN SA	01-mar-19	106,00%	AAA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	17-jan-20	1.940.468	0,73%	CDI	BCO BRADESCO SA	22-mar-19	101,25%	Aa1.br	Moody's	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	17-jan-20	1.078.038	0,41%	CDI	BCO BRADESCO SA	22-mar-19	101,25%	Aa1.br	Moody's	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	03-ago-20	1.197	0,00%	CDI	BCO BRADESCO SA	22-mar-19	102,25%	Aa1.br	Moody's	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
LF CDI	07-ago-20	4.745	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	15-mar-19	104,00%	Aa1.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	03-nov-20	3.463	0,00%	CDI	BCO BRADESCO SA	21-mar-19	102,75%	Aa1.br	Moody's	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
LF CDI	21-dez-20	13.796	0,01%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	28-mar-19	109,00%	AA- (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	11-mar-21	4.626	0,00%	CDI	BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	11-mar-19	103,40%	brAAA	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	15-mar-21	602.047	0,23%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	12-mar-19	106,45%	AA (bra)	Fitch	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	15-mar-21	12.027	0,00%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	12-mar-19	106,45%	AA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	25-mar-21	29.478	0,01%	CDI	BCO BRADESCO SA	25-mar-19	102,50%	Aa1.br	Moody's	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
LF CDI	29-mar-21	5.200.000	1,95%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	29-mar-19	104,50%	Aa3.br	Moody's	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	31-mar-21	9.696	0,00%	CDI	BCO CNH CAPITAL SA	21-mar-19	103,90%	AAA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	25-fev-22	29.638	0,01%	CDI	BCO BRADESCO SA	25-mar-19	103,25%	Aa1.br	Moody's	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
LF CDI	18-mar-22	4.409.151	1,66%	CDI	BCO SAFRA SA	19-mar-19	105,50%	Aa1.br	Moody's	ATLANTIDA FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	x de Compr	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2021-03-01	01-mar-21	8.601	0,00%	Selic	29-mar-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	665	0,00%	Selic	28-mar-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.294	0,00%	Selic	01-mar-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.857	0,00%	Selic	18-mar-19	0,02%	0,00%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2024-03-01	01-mar-24	1.375	0,00%	Selic	26-mar-19	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	69	0,00%	Selic	26-mar-19	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	12.019	0,00%	Selic	11-mar-19	0,02%	0,00%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2025-03-01	01-mar-25	2.864	0,00%	Selic	22-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	1.432	0,00%	Selic	22-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	1.432	0,00%	Selic	22-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	859	0,00%	Selic	22-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	573	0,00%	Selic	18-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	573	0,00%	Selic	22-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	573	0,00%	Selic	22-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	286	0,00%	Selic	18-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	143	0,00%	Selic	18-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	8.173	0,00%	Selic	08-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	8.172	0,00%	Selic	08-mar-19	0,03%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	669	0,00%	Selic	08-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	624	0,00%	Selic	08-mar-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
NTN-B 2020-08-15	15-ago-20	16.765	0,01%	IPCA	14-mar-19	2,53%	2,51%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	20.702	0,01%	IPCA	14-mar-19	2,88%	2,90%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	11.139.218	4,19%	IPCA	01-mar-19	3,68%	3,68%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	5.822.852	2,19%	IPCA	14-mar-19	3,49%	3,49%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	5.726.378	2,15%	IPCA	15-mar-19	3,48%	3,47%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.950.138	0,73%	IPCA	28-mar-19	3,81%	3,68%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	720.104	0,27%	IPCA	14-mar-19	3,51%	3,49%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	151.601	0,06%	IPCA	25-mar-19	3,59%	3,57%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	41.346	0,02%	IPCA	21-mar-19	3,39%	3,40%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	37.900	0,01%	IPCA	21-mar-19	3,39%	3,40%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	17.227	0,01%	IPCA	14-mar-19	3,49%	3,49%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	31.690	0,01%	IPCA	14-mar-19	3,70%	3,69%	ATLANTIDA FI MULT

