

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/09/2019

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	6.716.256,97	100%			0,59%	2,02%	4,75%	7,47%	9,70%	19,84%	32,17%
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,29%	1,30%	3,00%	5,55%	6,99%	16,25%	23,93%
Renda Fixa ALM	5.973.907,03	88,97%									
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PRC	5.973.907,03	88,97%	100%		0,61%	2,08%	4,96%	7,84%	10,17%	22,46%	35,37%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.				0,32%	1,39%	3,20%	5,85%	7,39%	17,12%	25,32%
Renda Fixa CDI	742.349,94	11,06%		0,00%							
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	742.349,94	11,06%	BRADESCO	0,00%	0,00%	0,46%	1,53%	3,08%	4,63%	6,23%	13,26%
Benchmark:	CDI				0,47%	1,54%	3,11%	4,67%	6,28%	13,35%	26,45%
Total	6.714.477,89	100%		0,00%	0,59%	1,99%	4,72%	7,44%	9,67%	19,81%	32,13%
Benchmark:	IPCA + 4,39% a.a.				0,32%	1,39%	3,20%	5,85%	7,39%	17,12%	25,32%

* As rentabilidades dos fundos de investimentos foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.

O valor total apresentado é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

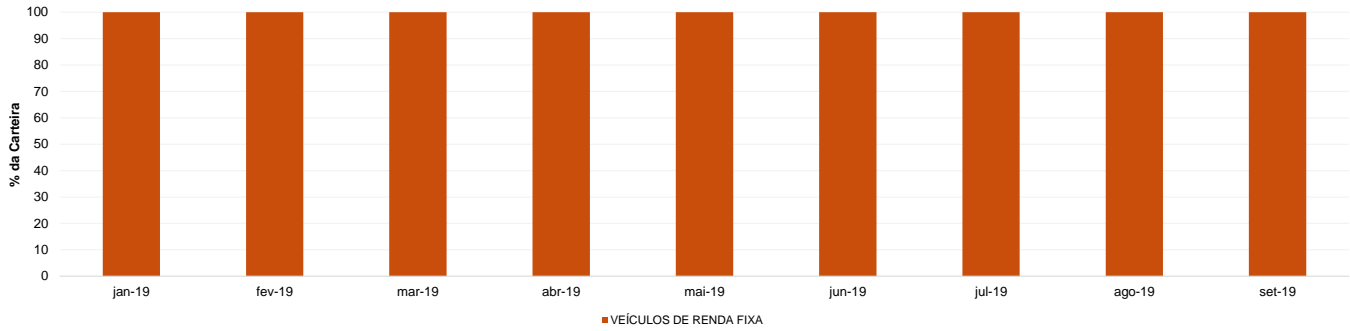
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

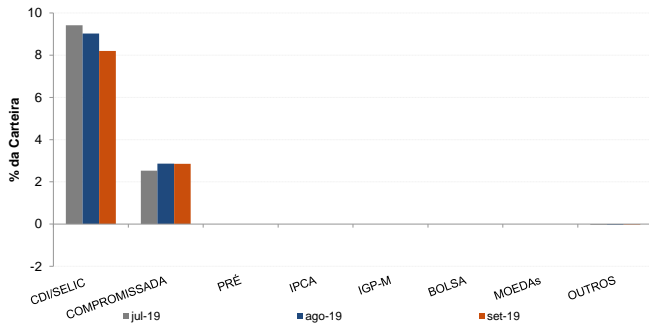
Distribuição da Carteira

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.

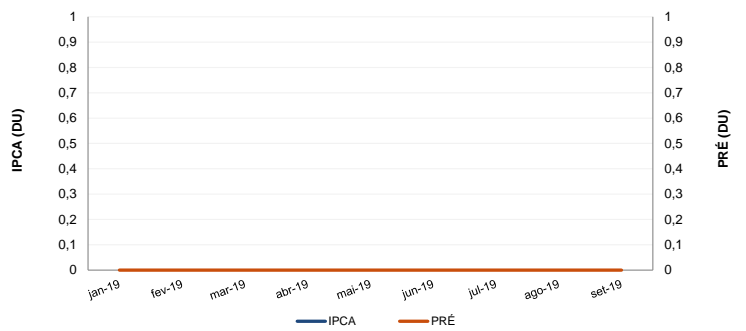
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/09/2019

Análises de Contrapartes

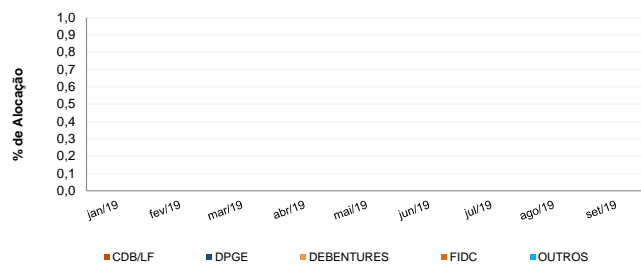
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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. As alterações são chegadas primeiro verificando o rating da emissão e, em seguida, do emissor.

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

Nenhuma mudança de rating encontrada.

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base:

30/09/2019

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.

No caso dos ratings, é apresentada a nota da emissão e, em caso de inexistência de nota, apresenta-se a nota do emissor.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1.321	0,02%	Selic	04-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	661	0,01%	Selic	25-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	538	0,01%	Selic	05-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	294	0,00%	Selic	03-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	93	0,00%	Selic	03-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	3	0,00%	Selic	03-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2	0,00%	Selic	04-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-09-01	01-set-20	797	0,01%	Selic	23-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-09-01	01-set-20	59	0,00%	Selic	02-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2020-09-01	01-set-20	24	0,00%	Selic	03-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.272	0,02%	Selic	03-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.042	0,02%	Selic	02-set-19	0,00%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	783	0,01%	Selic	03-set-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	568	0,01%	Selic	02-set-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	4.834	0,07%	Selic	30-set-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	235	0,00%	Selic	02-set-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	215	0,00%	Selic	02-set-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	249	0,00%	Selic	02-set-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	323	0,00%	Selic	02-set-19	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	73	0,00%	Selic	02-set-19	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2024-09-01	01-set-24	259	0,00%	Selic	02-set-19	0,02%	0,00%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-03-01	01-mar-25	64	0,00%	Selic	02-set-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	142	0,00%	Selic	02-set-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2025-09-01	01-set-25	49	0,00%	Selic	24-set-19	0,02%	0,02%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II