

RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

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	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	3.703.103,37	100%										
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,29%	1,30%	3,00%	5,55%	6,99%	16,25%	23,93%	
Renda Fixa CDI	3.703.103,37	100%		0,01%	0,47%	1,56%	3,21%	4,93%	6,64%	14,00%	27,81%	
BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV	1.879.629,67	50,77%	BTG PACTUAL	0,10%	0,48%	1,62%	3,36%	5,25%	7,24%	15,47%	31,89%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	1.823.473,70	49,25%	ITAU	0,01%	0,45%	1,51%	3,03%	4,55%	6,12%	13,03%	25,98%	
Benchmark:	CDI				0,47%	1,54%	3,11%	4,67%	6,28%	13,35%	26,45%	
Total	3.702.426,45	100%		0,01%	0,45%	1,50%	3,09%	4,74%	6,40%	13,58%	27,34%	
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.

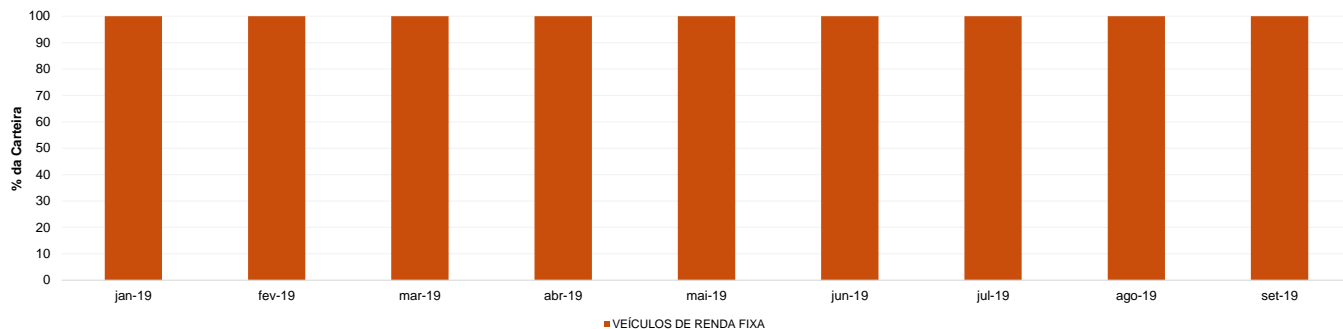
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

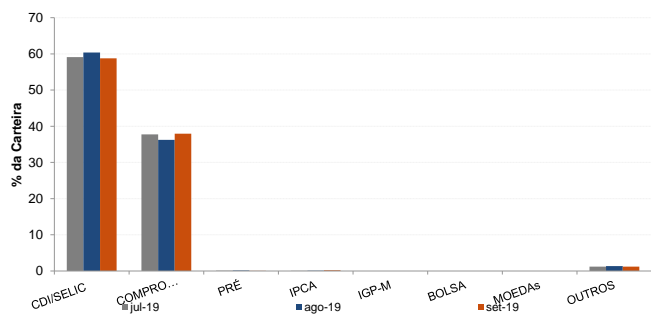
Distribuição da Carteira

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.

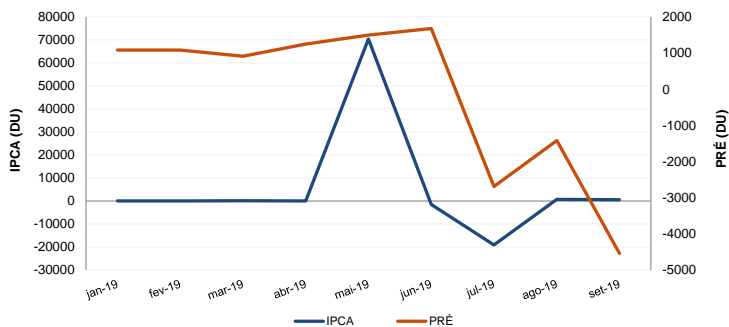
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

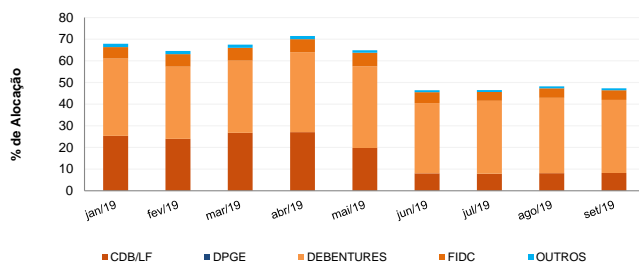
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	154,85	4,17	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
LOJAS AMERICANAS SA	59,29	1,60	AA (bra)		
LOCALIZA RENT A CAR SA	57,71	1,55	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO SAFRA SA	56,83	1,53		Aa1.br	brAAA
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICO	55,35	1,49		Aa3.br	brAAA
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	45,15	1,22	AA+ (bra)		
KLABIN SA	45,10	1,21	AAA (bra)		brAAA
AEGEA SANEAMENTO PARTICIPACOES S	43,70	1,18	AA (bra)		
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	43,54	1,17	AA (bra)		brAAA
GERDAU SA	43,40	1,17	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. As alterações são checadas 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 PERFIL SUPER CONSERVADOR

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.

Nenhuma operação feita no último mês.

