

RBSPREV - RBSPREV PGA

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	752.699,07	100%				0,46%	1,54%	2,92%	4,30%	5,71%	12,15%	24,98%
Benchmark:	CDI					0,47%	1,54%	3,11%	4,67%	6,28%	13,35%	26,45%
RF CRÉDITO	574.825,59	76,41%										
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	574.825,59	76,41%	VOTORANTIM	0,32%	0,00%	0,46%	1,55%	3,13%	4,71%	6,32%	13,44%	26,94%
Benchmark:	CDI					0,47%	1,54%	3,11%	4,67%	6,28%	13,35%	26,45%
RF REFERENCIADO DI	177.873,49	23,65%										
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	177.873,49	23,65%	BRADESCO	0,00%	0,00%	0,45%	1,50%	3,02%	4,53%	6,09%	12,96%	25,90%
Benchmark:	CDI					0,47%	1,54%	3,11%	4,67%	6,28%	13,35%	26,45%
Total	752.253,79	100%				0,00%	1,54%	2,92%	4,30%	5,71%	12,15%	24,98%
Benchmark:	CDI					0,47%	1,54%	3,11%	4,67%	6,28%	13,35%	26,45%

* 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.

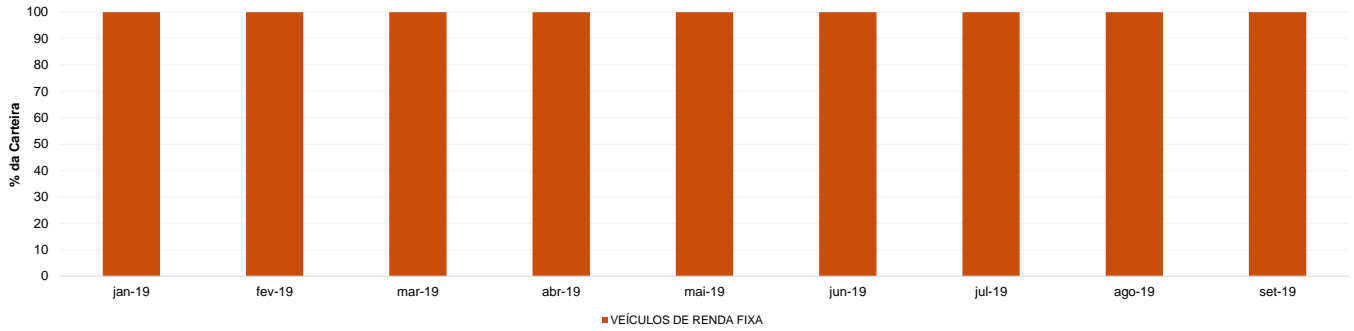
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

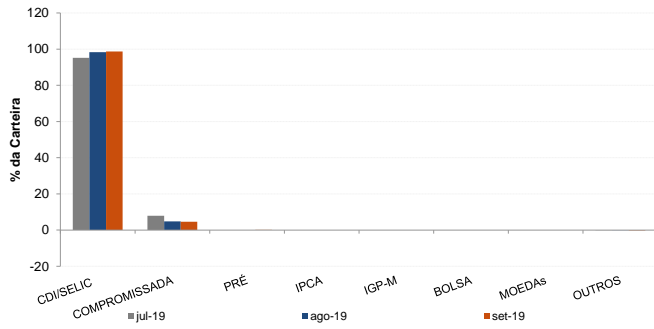
Distribuição da Carteira

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.

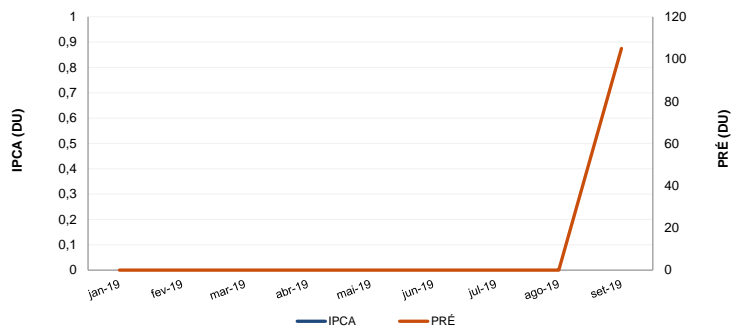
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/09/2019

Análises de Contrapartes

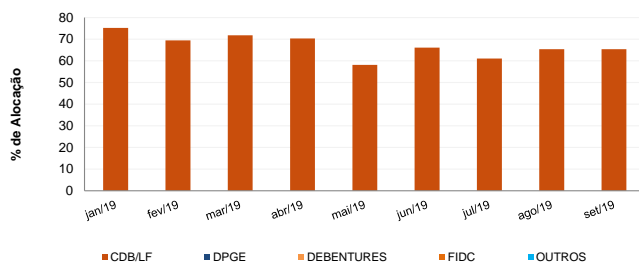
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emisoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO ITAU SA	64,82	8,56	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO VOTORANTIM SA	64,19	8,48		Aa3.br	brAAA
BCO SAFRA SA	63,51	8,39		Aa1.br	brAAA
BCO BBM SA	43,64	5,76	AAA (bra)	Aaa.br	
BCO VOLKSWAGEN SA	39,32	5,19			brAAA
BCO BTG PACTUAL SA	32,51	4,29	AA (bra)	Aa2.br	brAA+
BANCO RCI BRASIL SA	32,33	4,27		Aaa.br	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	27,00	3,57			brAAA
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INV	26,34	3,48	AA (bra)	Aa1.br	
BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSIC	24,81	3,28	AA (bra)	Aa2.br	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 cheçadas 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 PGA

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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Rating	Agência	Veículo
LF CDI	05-out-20	13.712	1,81%	CDI	BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA	13-set-19	104,50%	Aa2.br	Moody's	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	07-out-20	9.432	1,25%	CDI	BCO CREDIT SUISSE (BRASIL) SA	18-set-19	105,00%	AAA (bra)	Fitch	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	21-dez-20	15.247	2,01%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	11-set-19	109,00%	AA (bra)	Fitch	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	22-fev-21	25.388	3,35%	CDI	BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	13-set-19	103,40%	brAAA	S&P	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LF CDI	19-jul-23	3.431	0,45%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	11-set-19	113,50%	Aa3.br	Moody's	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2020-03-01	01-mar-20	274	0,04%	Selic	18-set-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	225	0,03%	Selic	16-set-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	205	0,03%	Selic	30-set-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	170	0,02%	Selic	19-set-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2020-03-01	01-mar-20	164	0,02%	Selic	27-set-19	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2022-09-01	01-set-22	368	0,05%	Selic	23-set-19	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2023-03-01	01-mar-23	102	0,01%	Selic	18-set-19	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA
LFT 2024-09-01	01-set-24	32.244	4,26%	Selic	16-set-19	0,02%	0,00%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LFT 2025-03-01	01-mar-25	12.896	1,70%	Selic	30-set-19	0,02%	0,02%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV