

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO
Data-base: 31/08/2017

O relatório Análise de Investimentos apresenta os principais pontos de acompanhamento mensal da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e rentabilidade. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o adequado 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	7.017.617,49	100%			-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,58%	1,30%	3,10%	4,53%	6,87%	21,51%	38,87%
RF REFERENCIADO DI	755.125,34	10,76%			-	0,80%	2,50%	5,37%	7,43%	12,09%	-	-
BRAM FI REF DI FEDERAL II	755.125,34	10,76%	BRADESCO	0,01%	0,03%	0,80%	2,50%	5,37%	7,43%	12,09%	27,83%	43,64%
Benchmark:	CDI					0,80%	2,43%	5,29%	7,36%	12,07%	27,90%	43,69%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	6.262.492,15	89,26%			-	1,01%	3,16%	5,85%	7,79%	10,96%	-	-
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.262.492,15	89,26%		100,00%	-	1,01%	3,16%	5,85%	7,79%	10,96%	-	-
Benchmark:	CDI					0,80%	2,56%	5,36%	6,50%	12,53%	28,29%	43,77%
Total	7.015.984,40	100,00%			0,00%	0,80%	2,90%	5,59%	7,35%	10,90%	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,58%	1,30%	3,10%	4,53%	6,87%	21,51%	38,87%

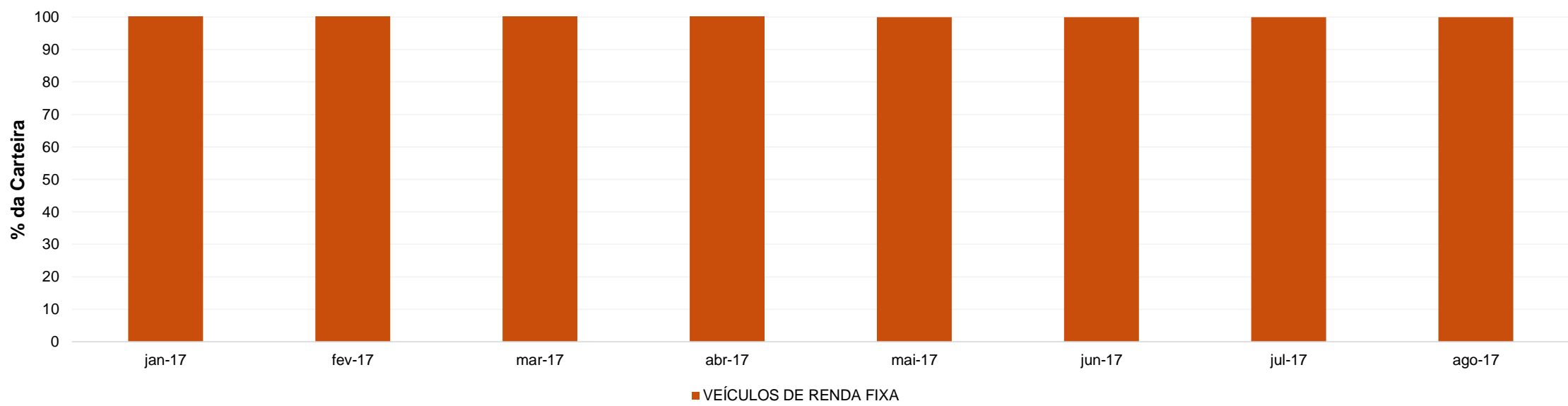
* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatórios foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.



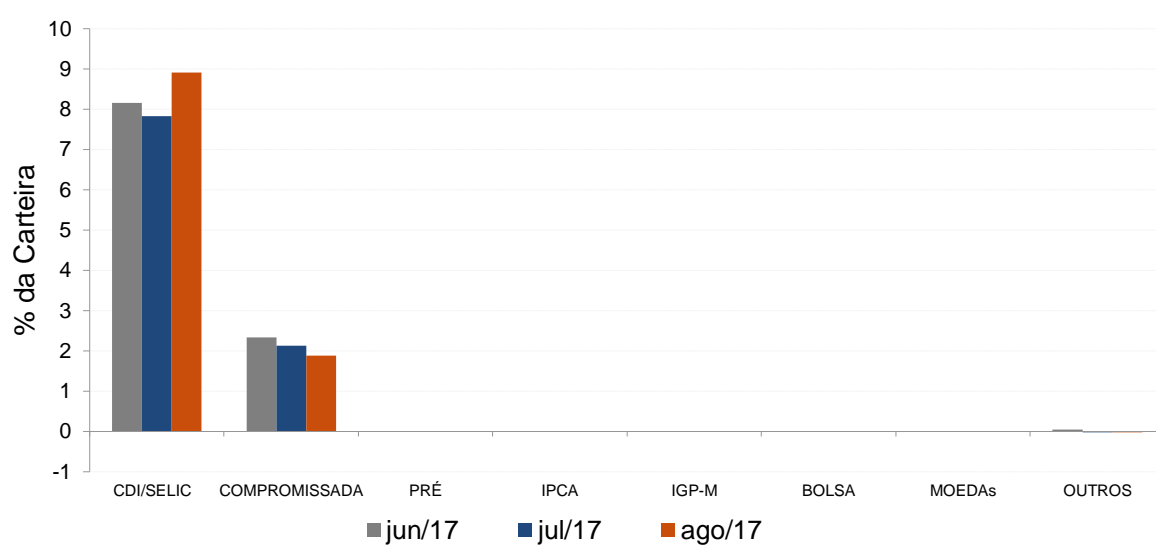
Distribuição da Carteira

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.

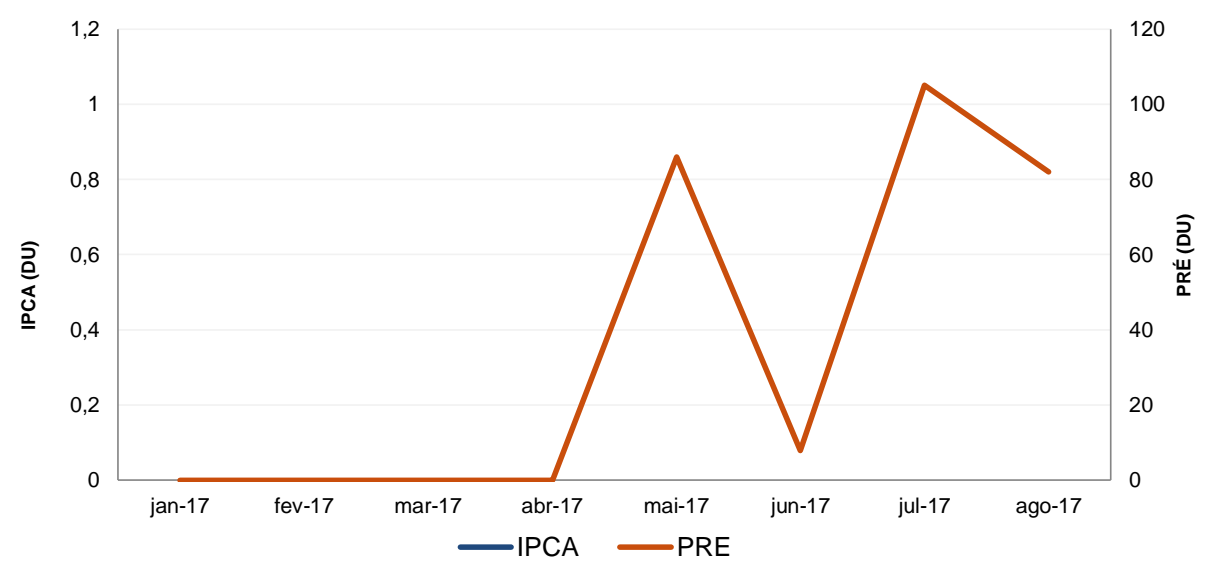
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/08/2017

Análises de Contrapartes

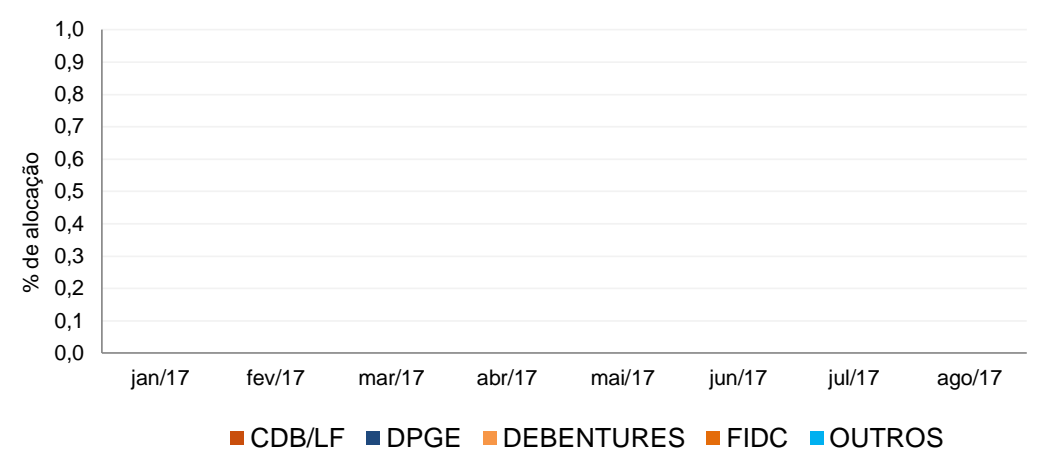
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Anterior	Atual	Agência	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
Nenhuma mudança de rating encontrada.									



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 investidos.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2018-09-01	01-set-18	55.215	0,79%	Selic	10-ago-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	14.204	0,20%	Selic	10-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	3.092	0,04%	Selic	29-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1.506	0,02%	Selic	31-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	159.034	2,27%	Selic	10-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	4	0,00%	Selic	31-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	281	0,00%	Selic	31-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	75	0,00%	Selic	16-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.381	0,02%	Selic	31-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	80	0,00%	Selic	16-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	27.375	0,39%	Selic	18-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	8.137	0,12%	Selic	16-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	468	0,01%	Selic	31-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	173	0,00%	Selic	16-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	140	0,00%	Selic	31-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	11.690	0,17%	Selic	10-ago-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II

