

**RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO**
**Data-base:** 29/12/2017

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.

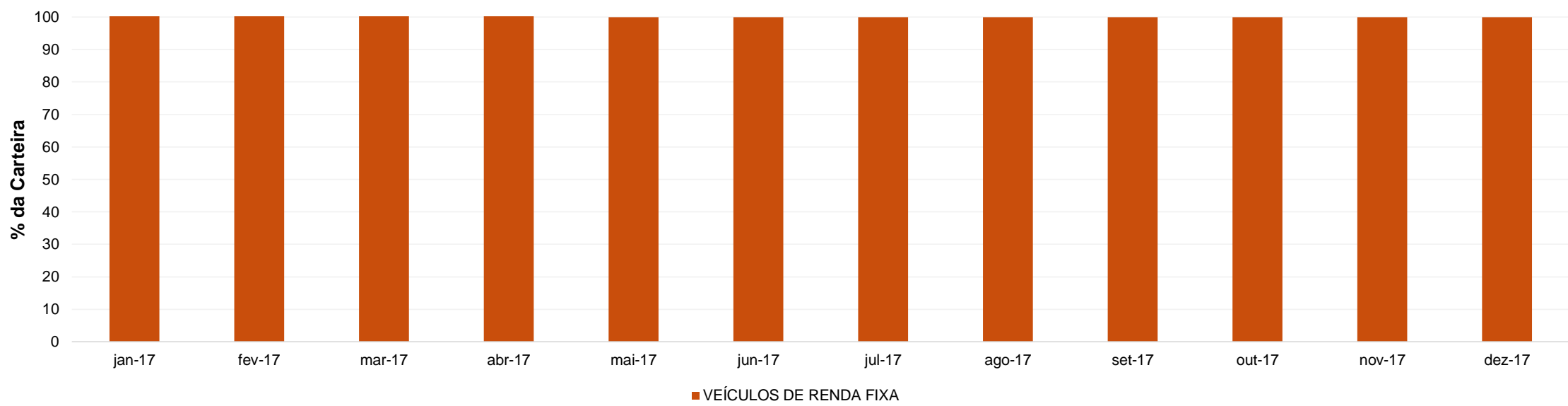
VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
<b>Renda Fixa</b>	<b>6.951.068,95</b>	<b>100%</b>			-	<b>0,73%</b>	<b>1,97%</b>	<b>3,94%</b>	<b>10,16%</b>	<b>10,16%</b>	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,78%	2,19%	3,90%	7,35%	7,35%	19,02%	37,38%
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>556.869,68</b>	<b>8,01%</b>			-	-	-	-	-	-	-	-
BRAM FI REF DI FEDERAL II	556.869,68	8,01%	BRADESCO	0,01%	0,01%	0,54%	1,77%	4,08%	10,03%	10,03%	25,28%	41,87%
Benchmark:	CDI					0,54%	1,76%	4,06%	9,95%	9,95%	25,35%	41,93%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>6.394.199,27</b>	<b>92,01%</b>			-	-	-	-	-	-	-	-
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.394.199,27	92,01%		100,00%	-	0,75%	2,56%	4,62%	11,15%	11,15%	-	-
Benchmark:	CDI					0,54%	1,76%	4,06%	9,95%	9,95%	25,35%	41,93%
<b>Total</b>	<b>6.949.697,11</b>	<b>100,00%</b>			<b>0,00%</b>	<b>0,73%</b>	<b>1,97%</b>	<b>3,94%</b>	<b>10,16%</b>	<b>10,16%</b>	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,78%	2,19%	3,90%	7,35%	7,35%	19,02%	37,38%

\* 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.

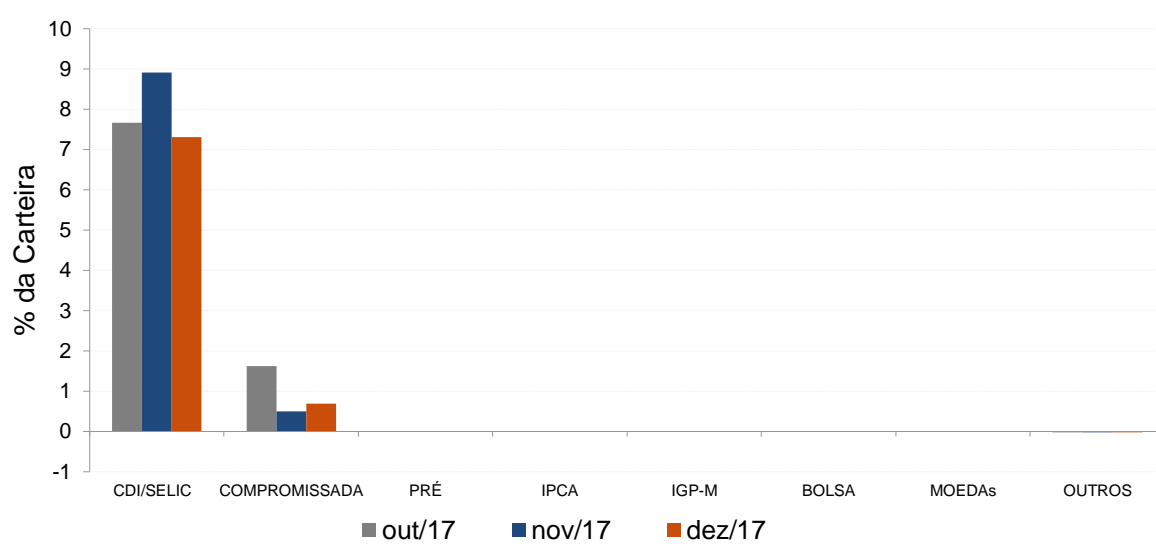
## Distribuição da Carteira

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.

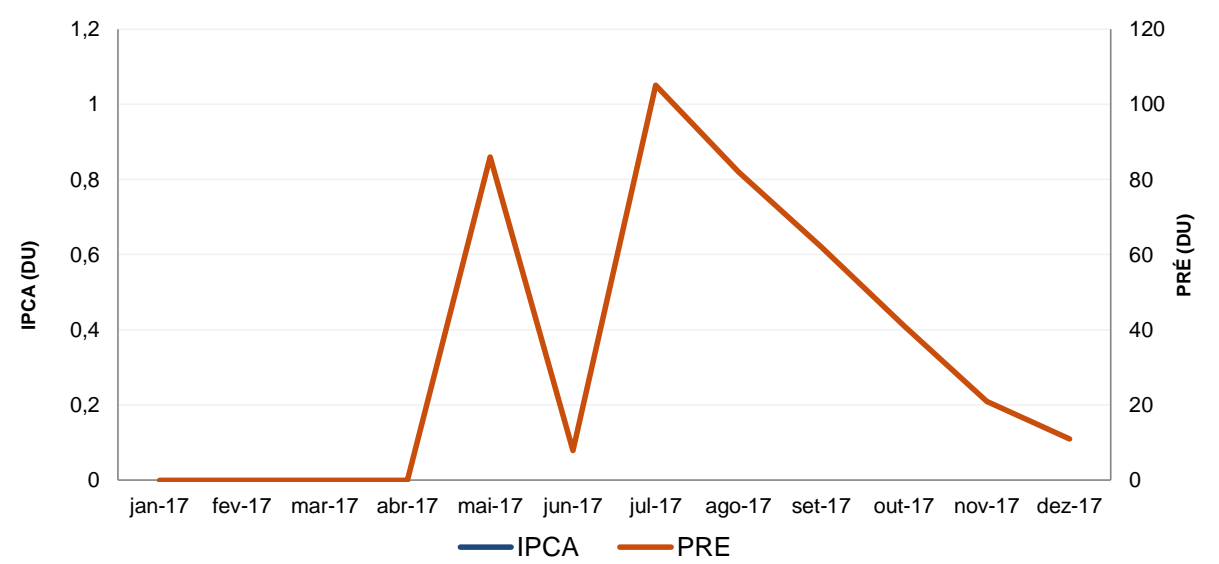
### Evolução do Patrimônio Líquido



### Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/12/2017

## Análises de Contrapartes

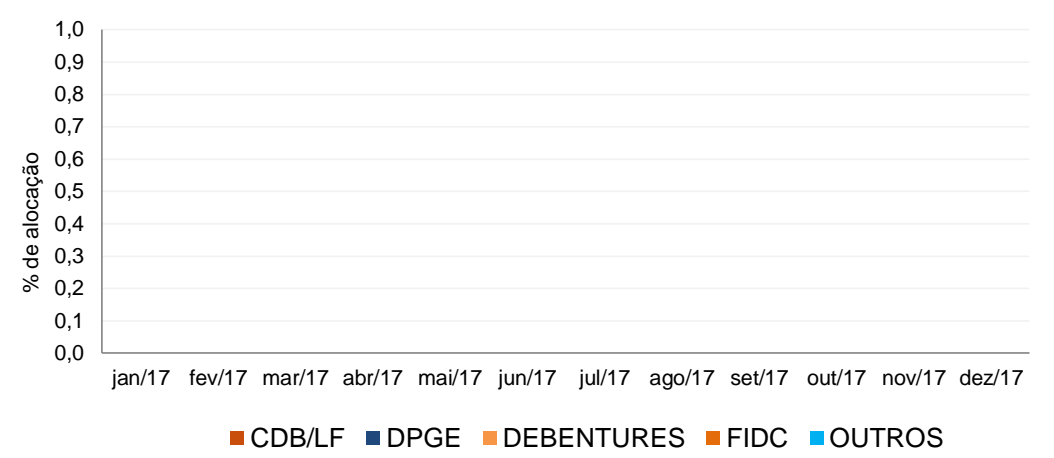
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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 2018-03-01	01-mar-18	6.233	0,09%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	20	0,00%	Selic	29-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	18	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	13	0,00%	Selic	06-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	13	0,00%	Selic	27-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	10	0,00%	Selic	06-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	10	0,00%	Selic	29-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	9	0,00%	Selic	26-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	8	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	7	0,00%	Selic	04-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	7	0,00%	Selic	11-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	7	0,00%	Selic	12-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	6	0,00%	Selic	07-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	6	0,00%	Selic	07-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	6	0,00%	Selic	19-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	6	0,00%	Selic	20-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	5	0,00%	Selic	13-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	5	0,00%	Selic	26-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	5	0,00%	Selic	27-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4	0,00%	Selic	15-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4	0,00%	Selic	26-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4	0,00%	Selic	27-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4	0,00%	Selic	07-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4	0,00%	Selic	07-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4	0,00%	Selic	11-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4	0,00%	Selic	18-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4	0,00%	Selic	18-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4	0,00%	Selic	28-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	3	0,00%	Selic	05-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	3	0,00%	Selic	26-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	07-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	19-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	20-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	29-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	06-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	08-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	11-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	12-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	15-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	22-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	22-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	2	0,00%	Selic	22-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	04-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	04-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	04-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	04-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	07-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	13-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	13-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	14-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	14-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	15-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	19-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	20-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	21-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	21-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	21-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	21-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	27-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	27-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	29-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	04-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	06-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	08-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	08-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	13-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	15-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	18-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	20-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	20-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	20-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	21-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	22-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	22-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	26-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	27-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	28-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1	0,00%	Selic	29-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	16.516	0,24%	Selic	26-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	2.337	0,03%	Selic	26-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	2	0,00%	Selic	22-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	1	0,00%	Selic	22-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	623	0,01%	Selic	22-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	280	0,00%	Selic	20-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	176	0,00%	Selic	22-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-09-01	01-set-20	1	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	12.464	0,18%	Selic	20-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	5.328	0,08%	Selic	05-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.119	0,03%	Selic	14-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	276	0,00%	Selic	22-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	17	0,00%	Selic	22-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	1	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1	0,00%	Selic	01-dez-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II