

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/07/2017

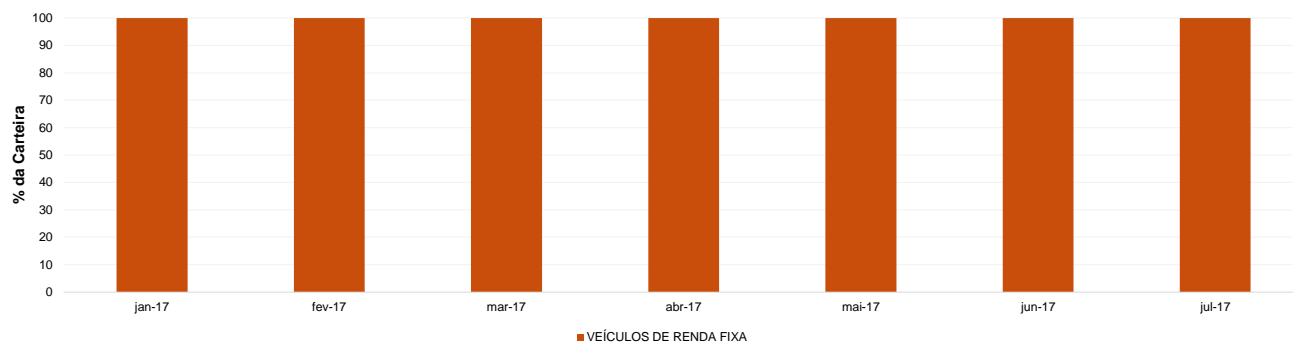
O relatório Análise de Investimentos apresenta os principais pontos de acompanhamento mensal da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e rentabilidade. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o adequado entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. 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	7.033.745,01	100%			-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.				0,59%	1,41%	3,16%	3,93%	7,14%	21,50%	38,91%	
RF REFERENCIADO DI	701.165,51	9,97%			-	0,81%	2,64%	5,44%	6,58%	12,54%	-	-
BRAM FI REF DI FEDERAL II	701.165,51	9,97%	BRADESCO	0,01%	0,03%	0,81%	2,64%	5,44%	6,58%	12,54%	28,22%	43,73%
Benchmark:	CDI				0,80%	2,56%	5,36%	6,50%	12,53%	28,29%	43,77%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	6.332.579,50	90,05%			-	0,45%	3,08%	5,65%	6,71%	11,18%	-	-
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.332.579,50	90,05%		100,00%	-	0,45%	3,08%	5,65%	6,71%	11,18%	-	-
Benchmark:	CDI				0,80%	2,56%	5,36%	6,50%	12,53%	28,29%	43,77%	
Total	7.032.311,30	100,00%			0,00%	0,48%	3,04%	5,60%	6,36%	10,81%	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.				0,59%	1,41%	3,16%	3,93%	7,14%	21,50%	38,91%	

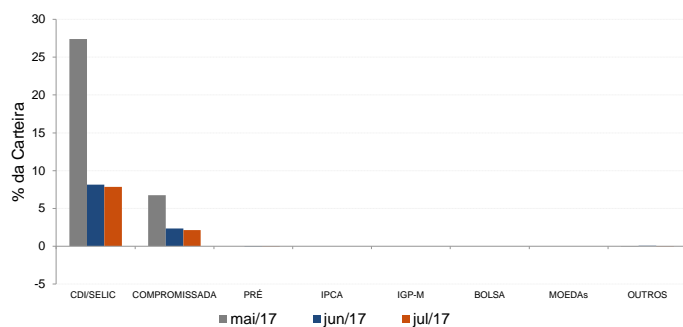
Distribuição da Carteira

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.

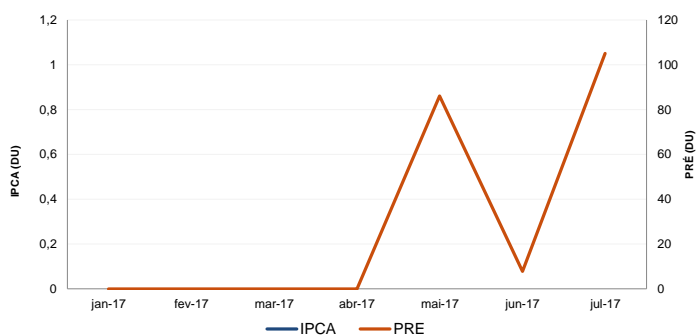
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/07/2017

Análises de Contrapartes

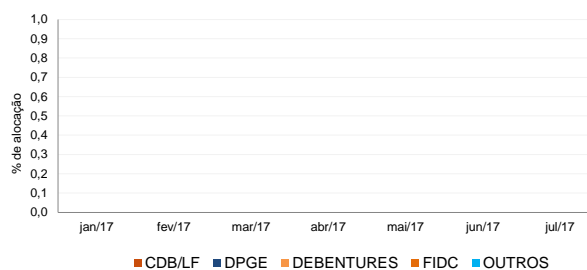
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	6.920	0,10%	Selic	24-jul-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1.409	0,02%	Selic	27-jul-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	45	0,00%	Selic	13-jul-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	6.963	0,10%	Selic	17-jul-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	12.577	0,18%	Selic	17-jul-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	104	0,00%	Selic	13-jul-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.351	0,02%	Selic	11-jul-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	6.978	0,10%	Selic	28-jul-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LTN 2019-01-01	01-jan-19	8.980	0,13%	PRE	21-jul-17	8,31%	8,38%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LTN 2019-01-01	01-jan-19	4.490	0,06%	PRE	21-jul-17	8,31%	8,38%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LTN 2019-07-01	01-jul-19	4.299	0,06%	PRE	24-jul-17	8,65%	8,65%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LTN 2019-07-01	01-jul-19	4.299	0,06%	PRE	24-jul-17	8,65%	8,65%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LTN 2019-07-01	01-jul-19	4.299	0,06%	PRE	24-jul-17	8,65%	8,65%	BRAM FI REF DI FEDERAL II

