

## RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/05/2017

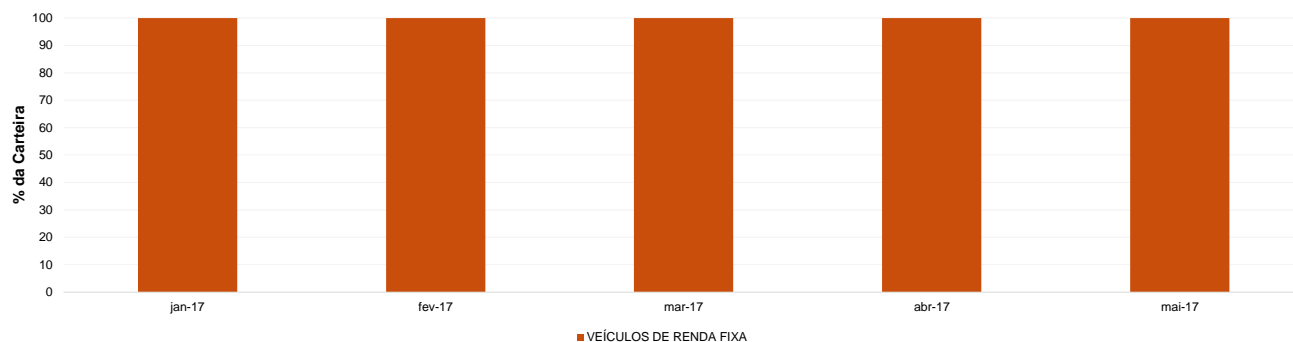
O relatório Análise de Investimentos apresenta os principais pontos de acompanhamento mensal da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e rentabilidade. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o adequado entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. 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>1.725.458,63</b>	<b>24,45%</b>			-	0,94%	2,62%	5,07%	4,19%	10,97%	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,68%	1,53%	3,64%	2,94%	7,83%	22,96%	39,15%
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>1.725.458,63</b>	<b>24,45%</b>			-	-	-	-	-	-	-	-
BRAM FI REF DI FEDERAL II	1.725.458,63	24,45%	BRADESCO	0,02%	0,01%	0,94%	2,80%	5,98%	4,82%	13,20%	28,93%	43,83%
Benchmark:	CDI					0,93%	2,79%	5,98%	4,81%	13,26%	29,09%	43,98%
<b>Total</b>	<b>7.057.987,00</b>	<b>100,00%</b>			0,00%	0,94%	2,62%	5,07%	4,19%	10,97%	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,68%	1,53%	3,64%	2,94%	7,83%	22,96%	39,15%

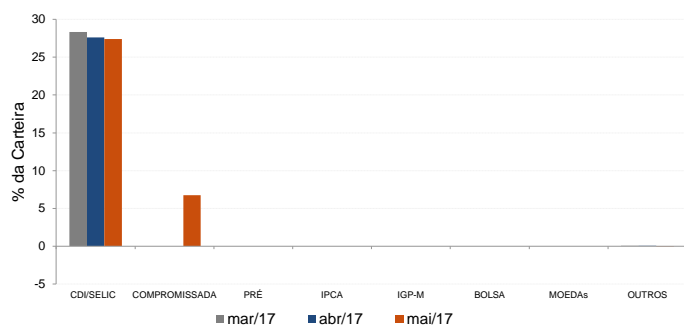
## Distribuição da Carteira

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.

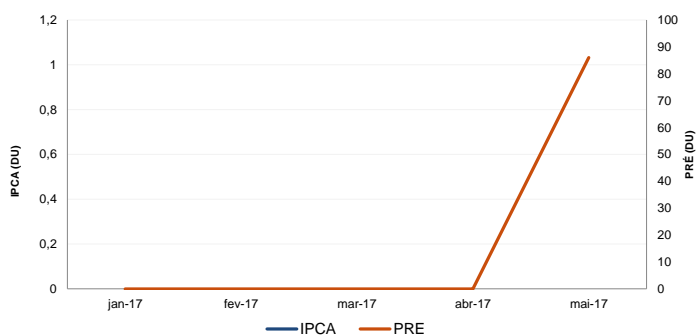
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/05/2017

## Análises de Contrapartes

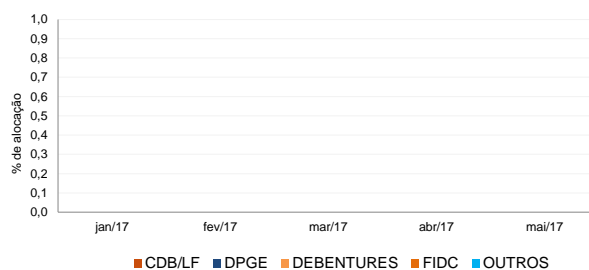
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

### Contrapartes 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	495.450	7,02%	Selic	15-mai-17	0,01%	0,01%	RBSPREV CONSERVADOR VITALICIO
LFT 2019-03-01	01-mar-19	94	0,00%	Selic	05-mai-17	0,02%	0,02%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	54	0,00%	Selic	18-mai-17	0,02%	0,02%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	50	0,00%	Selic	03-mai-17	0,02%	0,02%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	28	0,00%	Selic	09-mai-17	0,02%	0,02%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	2	0,00%	Selic	02-mai-17	0,02%	0,02%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2019-03-01	01-mar-19	2	0,00%	Selic	17-mai-17	0,02%	0,02%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	10.039	0,14%	Selic	17-mai-17	0,03%	0,03%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-09-01	01-set-20	602	0,01%	Selic	09-mai-17	0,03%	0,03%	BRAM FI REF DI FEDERAL II