

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO
Data-base: 31/10/2017

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	650.049,81	9,28%			-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.				0,78%	1,86%	3,29%	5,87%	7,13%	20,55%	38,21%	
RF REFERENCIADO DI	650.049,81	9,28%			-	0,65%	2,11%	4,80%	8,83%	11,17%	-	-
BRAM FI REF DI FEDERAL II	650.049,81	9,28%	BRADESCO	0,01%	0,01%	0,65%	2,11%	4,80%	8,83%	11,17%	26,67%	42,85%
Benchmark:	CDI				0,65%	2,10%	4,72%	8,75%	11,11%	26,73%	42,90%	
Total	7.002.817,49	100,00%			0,00%	0,65%	2,11%	5,21%	8,74%	9,99%	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.				0,78%	1,86%	3,29%	5,87%	7,13%	20,55%	38,21%	

* 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.

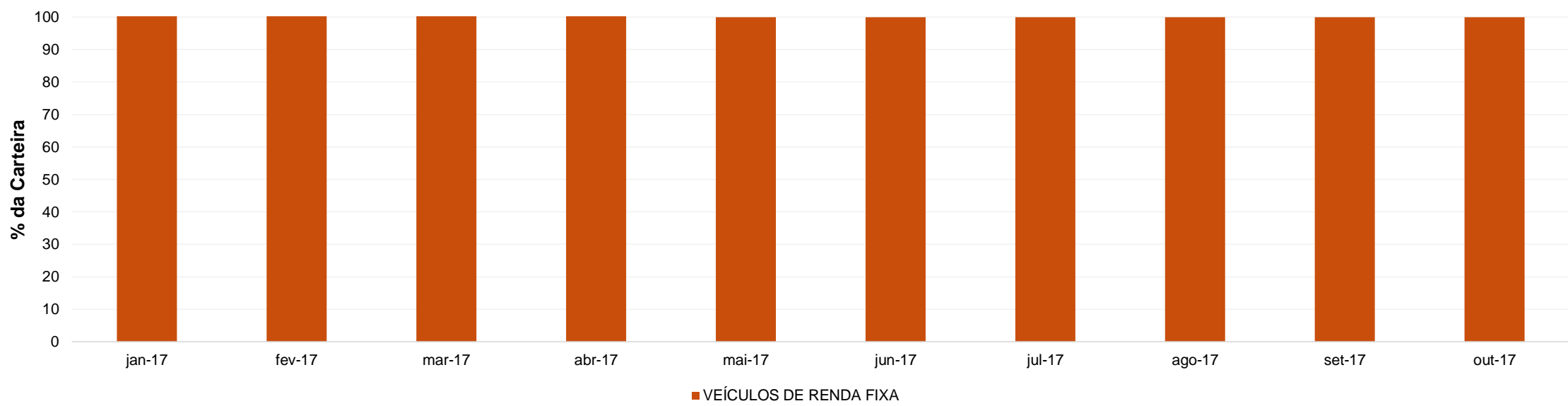


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira, e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.
Nenhuma das análises aqui apresentadas pode ser interpretada como recomendação de investimento ou de desinvestimento.

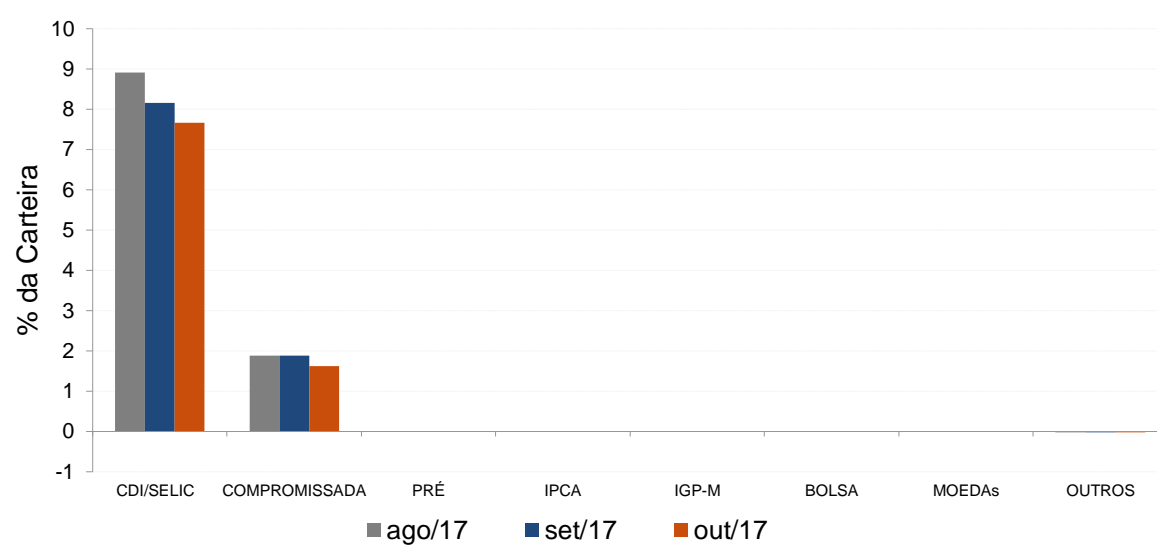
Distribuição da Carteira

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.

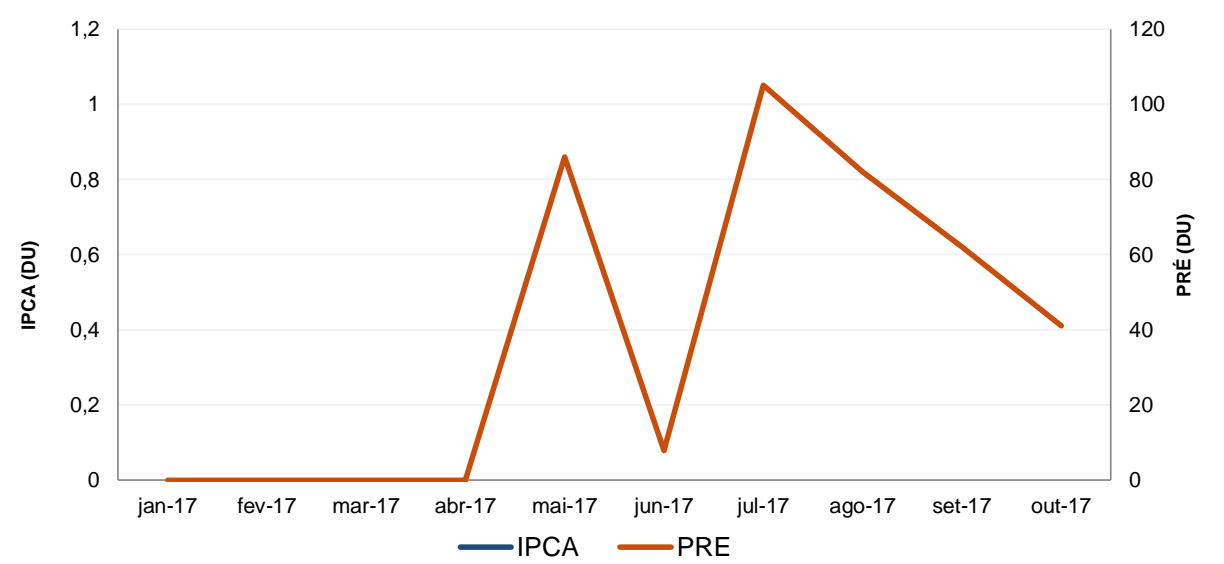
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/10/2017

Análises de Contrapartes

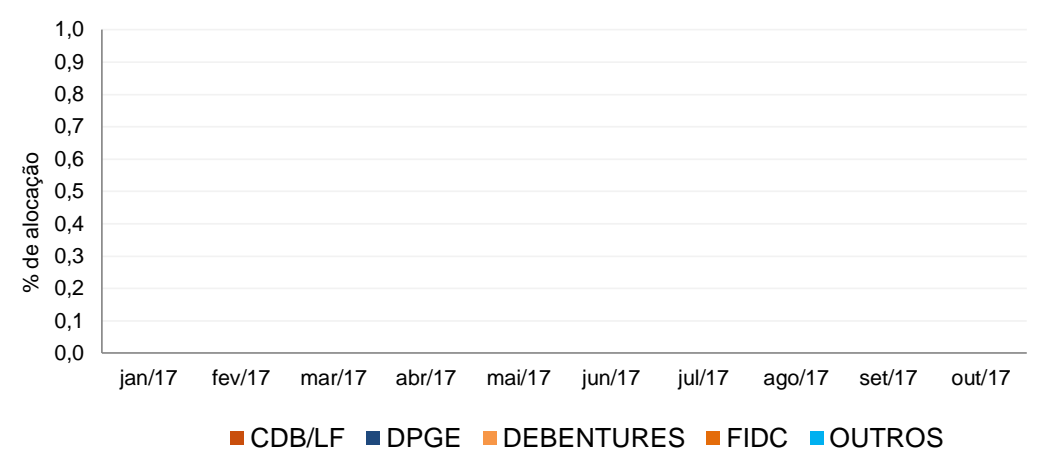
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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 2020-03-01	01-mar-20	12.934	0,18%	Selic	20-out-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2.908	0,04%	Selic	10-out-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	1.148	0,02%	Selic	03-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	45.841	0,65%	Selic	09-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	10.324	0,15%	Selic	10-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	4.982	0,07%	Selic	10-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.610	0,04%	Selic	10-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	121	0,00%	Selic	16-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2.786	0,04%	Selic	10-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	704	0,01%	Selic	10-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	337	0,00%	Selic	10-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	4.209	0,06%	Selic	09-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	115	0,00%	Selic	16-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.531	0,02%	Selic	09-out-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LTN 2018-01-01	01-jan-18	3.844	0,05%	PRE	02-out-17	7,35%	7,32%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LTN 2018-01-01	01-jan-18	159	0,00%	PRE	02-out-17	7,35%	7,32%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LTN 2018-01-01	01-jan-18	118	0,00%	PRE	02-out-17	7,35%	7,32%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LTN 2018-07-01	01-jul-18	2.792	0,04%	PRE	02-out-17	7,06%	7,06%	BRAM FI REF DI FEDERAL II