

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO
Data-base: 29/09/2017

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	6.999.205,18	100,00%			-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,50%	1,68%	2,95%	5,05%	6,94%	21,03%	38,26%
RF REFERENCIADO DI	702.631,50	10,04%			-	0,64%	2,27%	4,95%	8,12%	11,60%	-	-
BRAM FI REF DI FEDERAL II	702.631,50	10,04%	BRADESCO	0,01%	0,03%	0,64%	2,27%	4,95%	8,12%	11,60%	27,24%	43,27%
Benchmark:	CDI					0,64%	2,26%	4,87%	8,05%	11,55%	27,32%	43,32%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	6.296.573,68	89,96%			-	0,54%	2,01%	5,44%	8,38%	10,54%	-	-
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.296.573,68	89,96%		100,00%	-	0,54%	2,01%	5,44%	8,38%	10,54%	-	-
Benchmark:	CDI					0,64%	2,26%	4,87%	8,05%	11,55%	27,32%	43,32%
Total	6.999.205,18	100,00%			0,00%	0,64%	1,94%	5,28%	8,04%	10,28%	-	-
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,50%	1,68%	2,95%	5,05%	6,94%	21,03%	38,26%

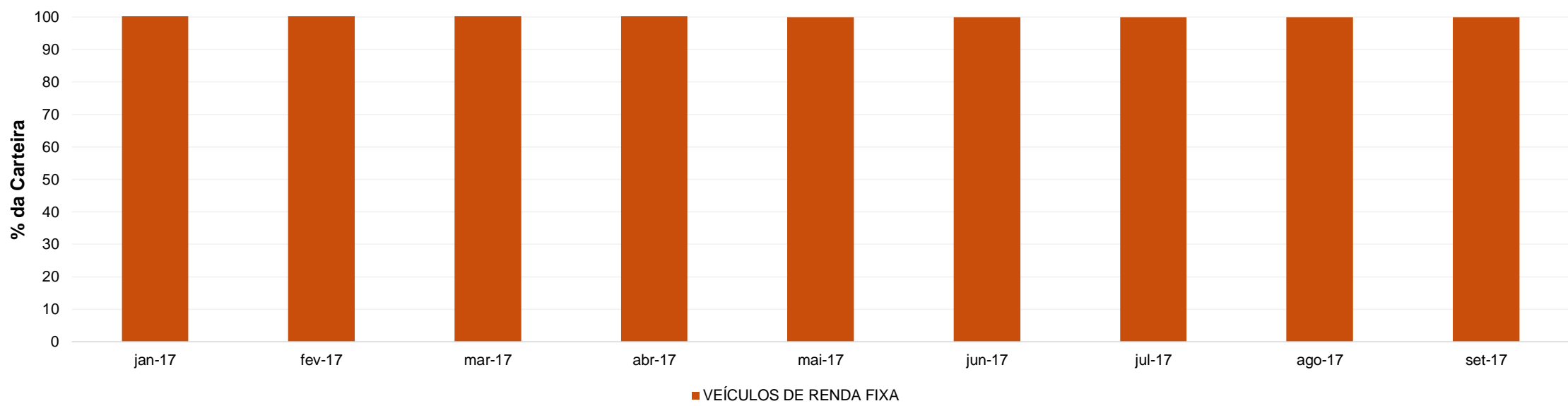
* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatórios foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.



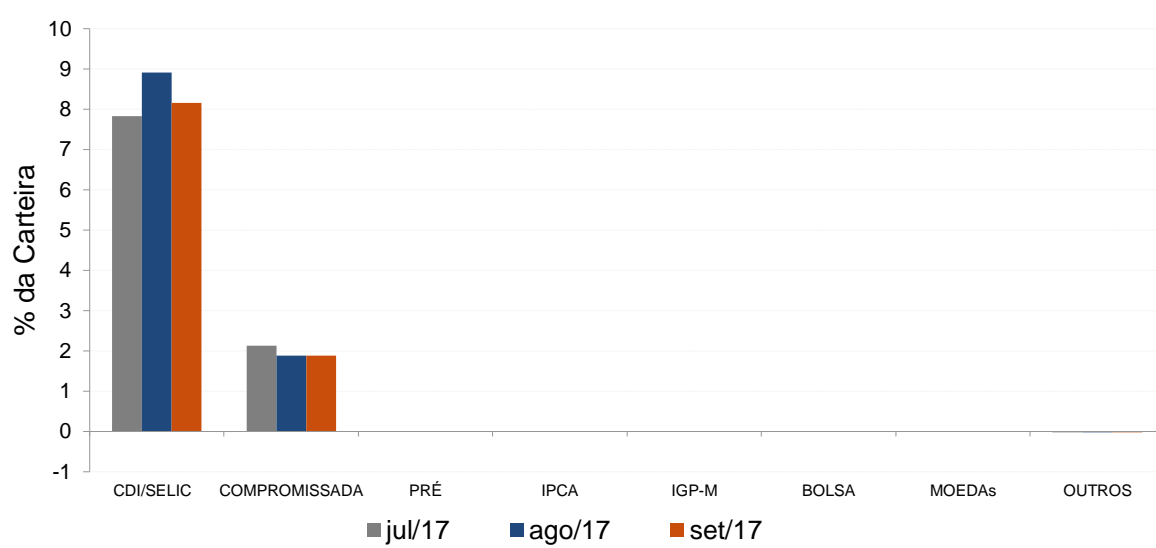
Distribuição da Carteira

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.

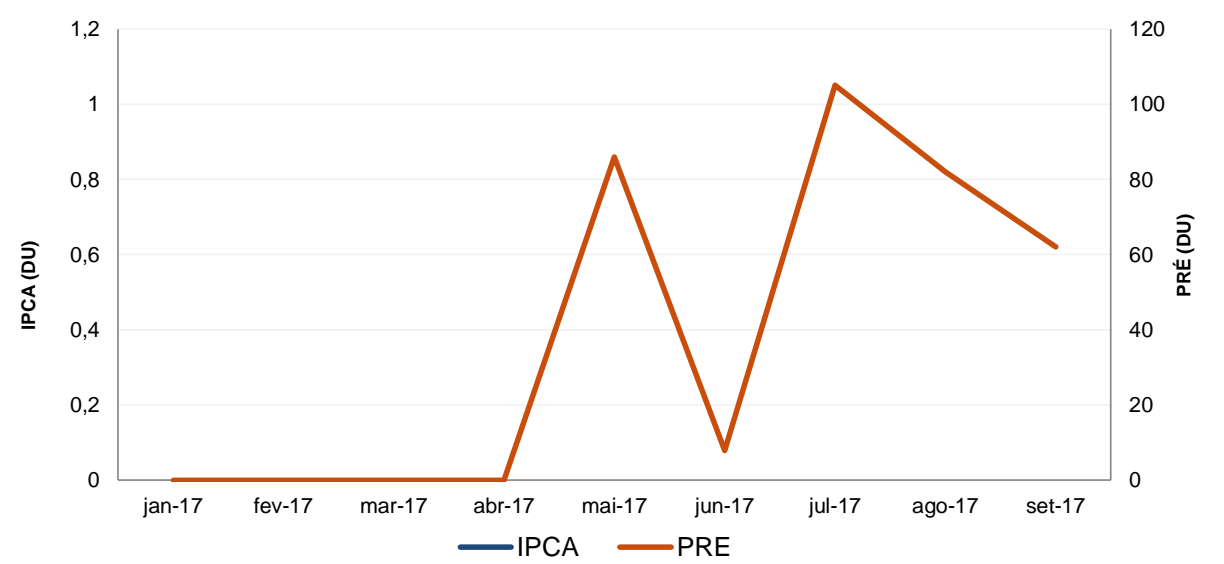
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/09/2017

Análises de Contrapartes

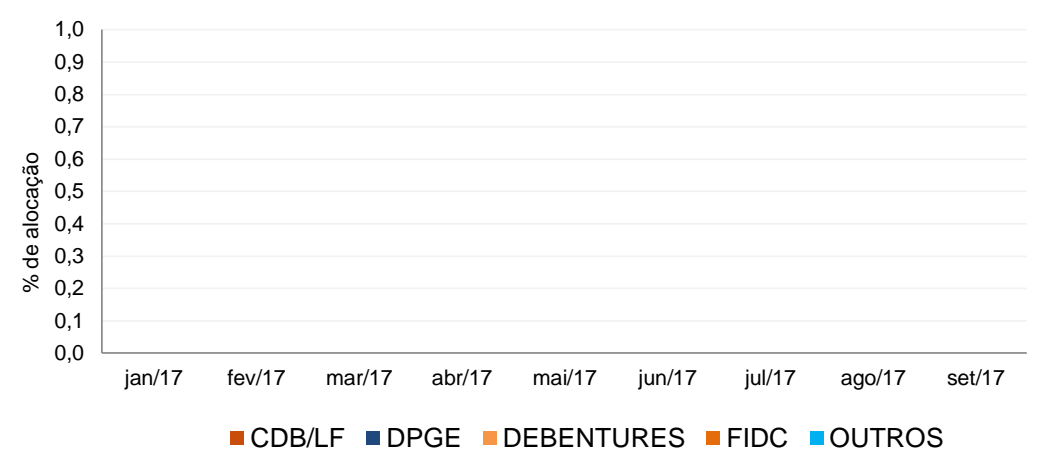
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	21.638	0,31%	Selic	14-set-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	18.309	0,26%	Selic	06-set-17	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	778	0,01%	Selic	25-set-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	672	0,01%	Selic	18-set-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	457	0,01%	Selic	20-set-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	15.342	0,22%	Selic	27-set-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	23.292	0,33%	Selic	08-set-17	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LTN 2019-01-01	01-jan-19	2.091	0,03%	PRE	20-set-17	7,34%	7,35%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LTN 2019-01-01	01-jan-19	2.091	0,03%	PRE	20-set-17	7,34%	7,35%	BRAM FI REF DI FEDERAL II

