

RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/04/2018

Este relatório apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e rentabilidade. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o 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	732.197,48	100,01%				0,40%	1,36%	3,02%	1,91%	7,84%	22,39%	39,47%
Benchmark:	CDI					0,52%	1,52%	3,25%	2,12%	8,12%	22,67%	39,65%
RF CRÉDITO	579.610,87	79,17%										
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	579.610,87	79,17%	VOTORANTIM	0,10%	0,00%	0,52%	1,50%	3,24%	2,10%	8,30%	23,27%	40,85%
Benchmark:	CDI					0,52%	1,52%	3,25%	2,12%	8,12%	22,67%	39,65%
RF REFERENCIADO DI	152.586,61	20,84%										
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	152.586,61	20,84%	BRADESCO	0,00%	0,00%	0,50%	1,47%	3,15%	2,05%	8,04%	22,33%	38,96%
Benchmark:	CDI					0,52%	1,52%	3,25%	2,12%	8,12%	22,67%	39,65%
Total	732.136,60	100%				0,00%	0,40%	1,36%	1,91%	7,84%	22,39%	39,47%
Benchmark:	CDI					0,52%	1,52%	3,25%	2,12%	8,12%	22,67%	39,65%

* 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.

O valor total apresentado nesse relatório é o patrimônio líquido extraído através do arquivo XML do plano.

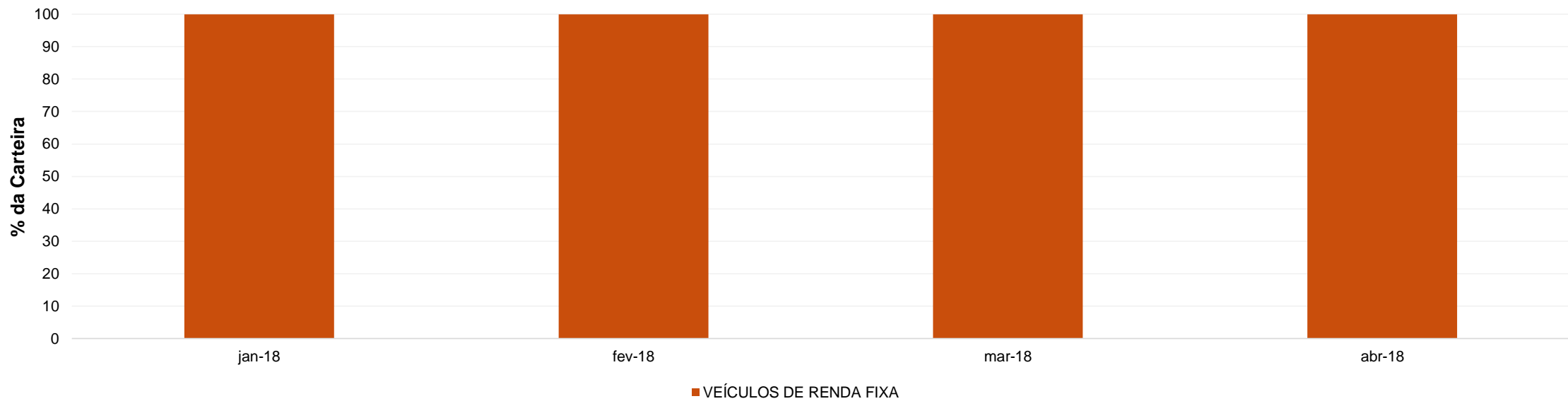


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.
A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

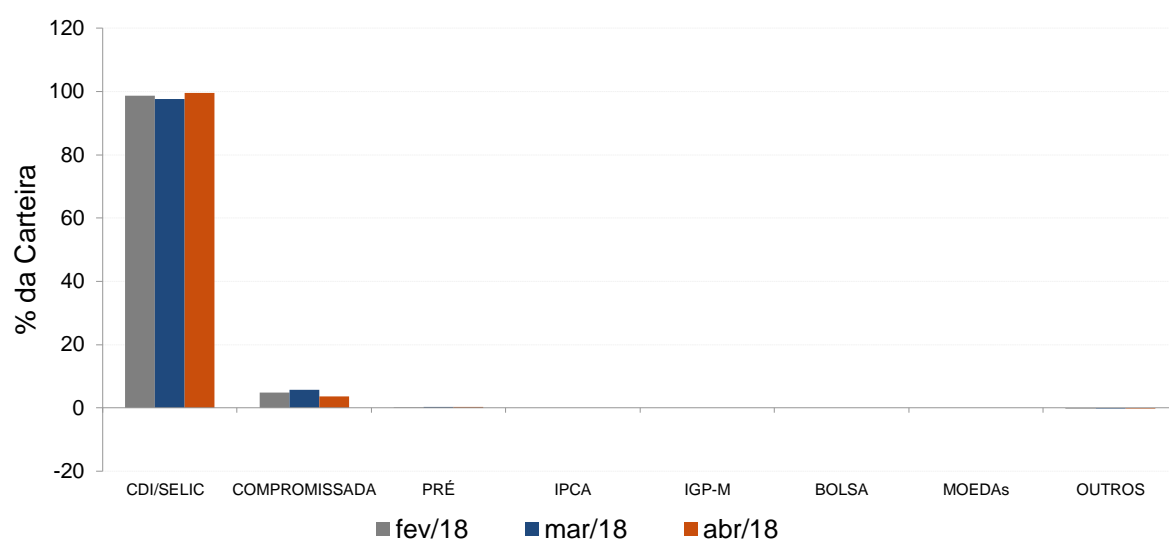
Distribuição da Carteira

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.

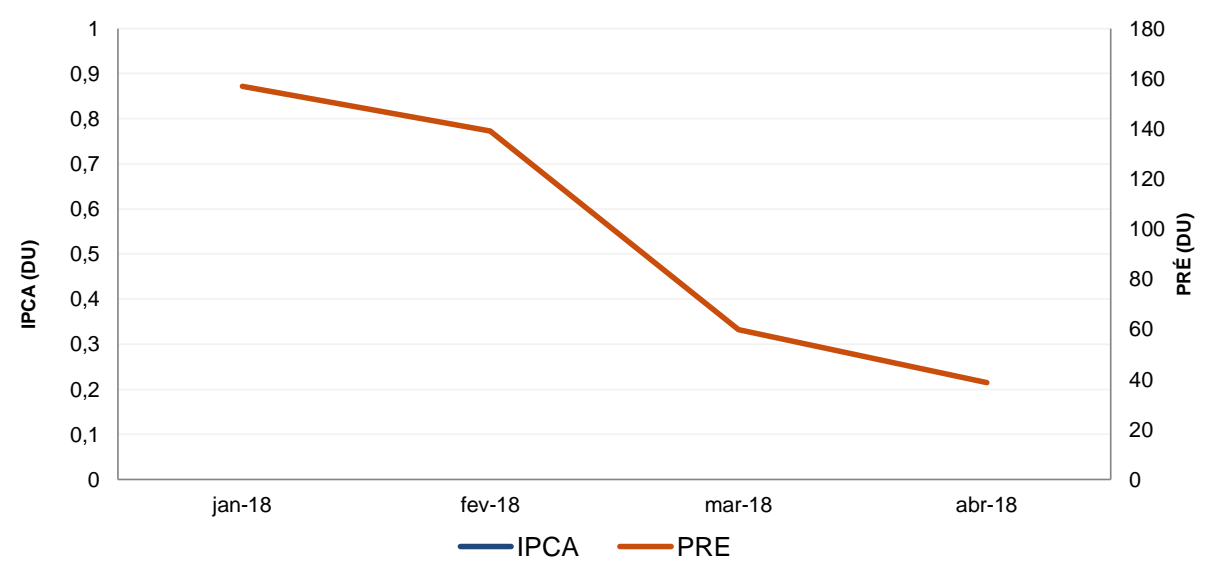
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

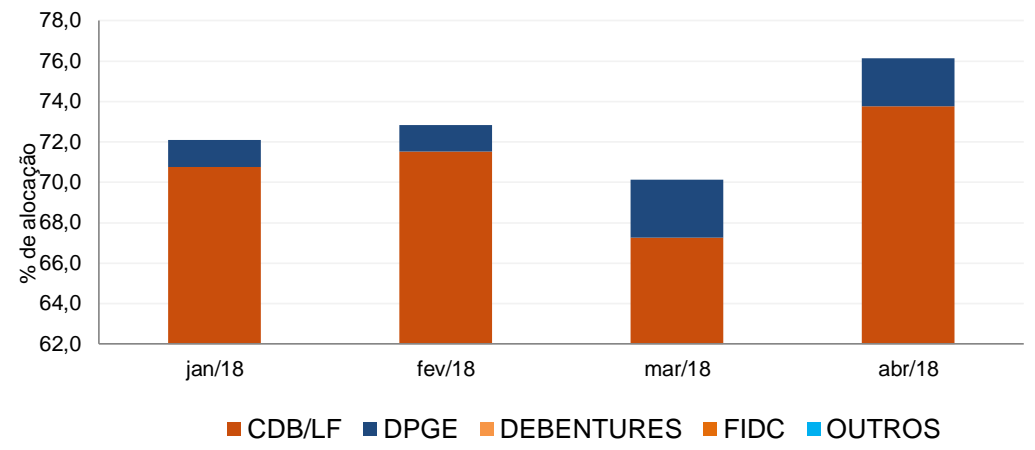
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	87,54	11,94			brAA-
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM	87,25	11,90	AA+ (bra)	Aa2.br	brAA-
BCO TOYOTA BRASIL SA	64,75	8,83			brAA-
BCO VOTORANTIM SA	64,03	8,73		Aa3.br	brAA-
BCO SAFRA SA	61,70	8,41		Aa1.br	brAA-
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL IN\	37,74	5,15	AA (bra)	Aa1.br	
BCO BRADESCO SA	34,72	4,73	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO GMAC SA	32,78	4,47	AAA (bra)	Aa2.br	
BCO VOLKSWAGEN SA	30,89	4,21			brAA-
BCO CITIBANK SA	21,74	2,96			brAA-

* 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.									



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/04/2018

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	147	0,02%	Selic	02-abr-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	81	0,01%	Selic	02-abr-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	4.271	0,58%	Selic	27-abr-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	4.271	0,58%	Selic	27-abr-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	48	0,01%	Selic	03-abr-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	51	0,01%	Selic	03-abr-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

