

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

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	131.083.840,62	90,26%											
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,55%	1,58%	3,60%	2,22%	6,84%	15,63%	31,37%		
Total Return	131.083.840,62	90,26%		0,46%	0,46%	2,54%	4,55%	3,44%	10,17%	24,53%			
ATLANTIDA FI MULT	59.487.913,40	40,96%	ITAU	67,20%	0,32%	0,43%	2,52%	4,15%	3,43%	8,68%	22,33%	40,78%	
ITAPEMA FI MULT	71.595.927,22	49,30%	SUL AMERICA	54,63%	0,58%	0,50%	2,57%	4,92%	3,47%	11,49%	26,47%	44,29%	
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,55%	1,58%	3,60%	2,22%	6,84%	15,63%	31,37%		
Estruturados	14.142.327,17	9,74%											
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,68%	2,00%	4,24%	2,78%	10,26%	27,60%	48,14%		
Multimercado Estruturado	14.142.327,17	9,74%		1,62%	0,30%	2,90%	4,61%	4,02%	8,25%	28,73%			
AZ QUEST MULT FC FI MULT	2.138.938,54	1,47%	AZ QUEST	0,38%	0,90%	0,14%	2,38%	5,95%	4,80%	11,35%	34,60%	65,50%	
BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	2.446.672,39	1,68%	BTG PACTUAL	0,18%	1,98%	0,78%	2,92%	7,44%	5,09%	17,94%	34,56%	59,37%	
FICFI MULT GARDE DUMAS	4.492.597,64	3,09%	GARDE	0,55%	4,29%	-0,84%	0,63%	3,50%	1,98%	11,02%	28,94%	57,87%	
KINEA CHRONOS FI MULT	4.166.965,73	2,87%	KINEA	0,13%	0,83%	1,26%	3,63%	5,79%	5,01%	12,80%	33,91%	-	
SUL AMERICA ENDURANCE FI MULT	897.152,87	0,62%	SUL AMERICA	0,20%	0,07%	0,58%	1,39%	2,49%	2,09%	9,28%	25,91%	47,22%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,68%	2,00%	4,24%	2,78%	10,26%	27,60%	48,14%		
Total	145.222.648,06	100%		0,54%	0,45%	2,50%	4,38%	3,38%	9,90%	24,39%	42,09%		
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,58%	1,67%	3,79%	2,34%	7,24%	16,50%	32,85%		

* 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.

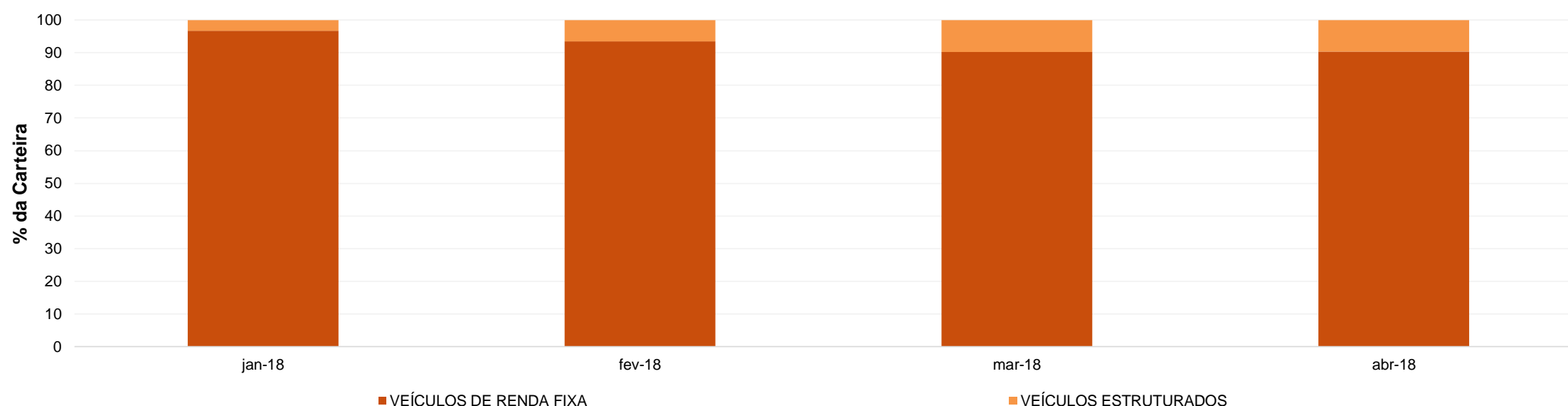
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

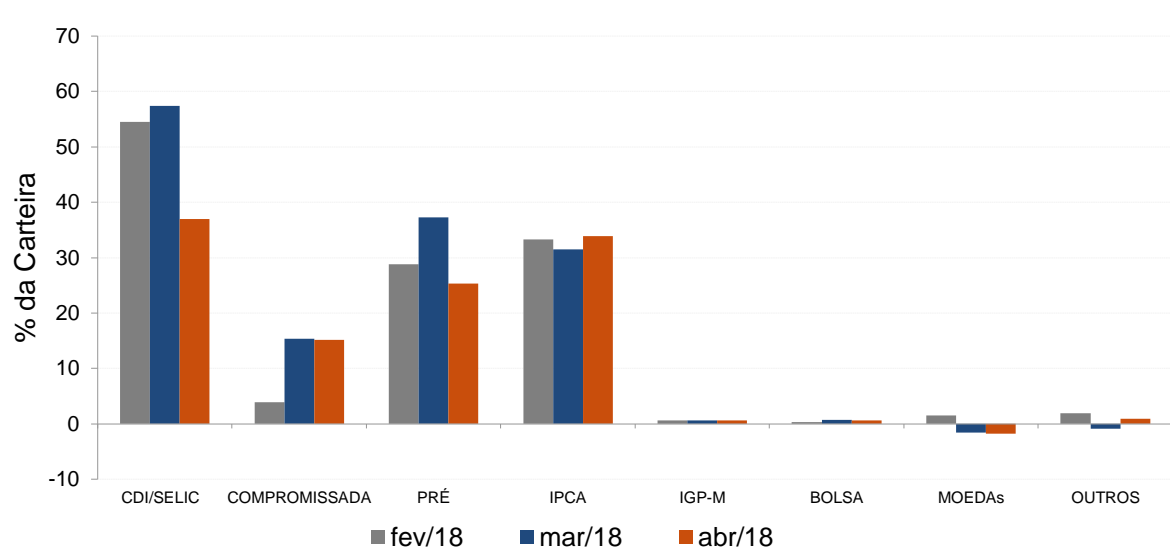
Distribuição da Carteira

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.

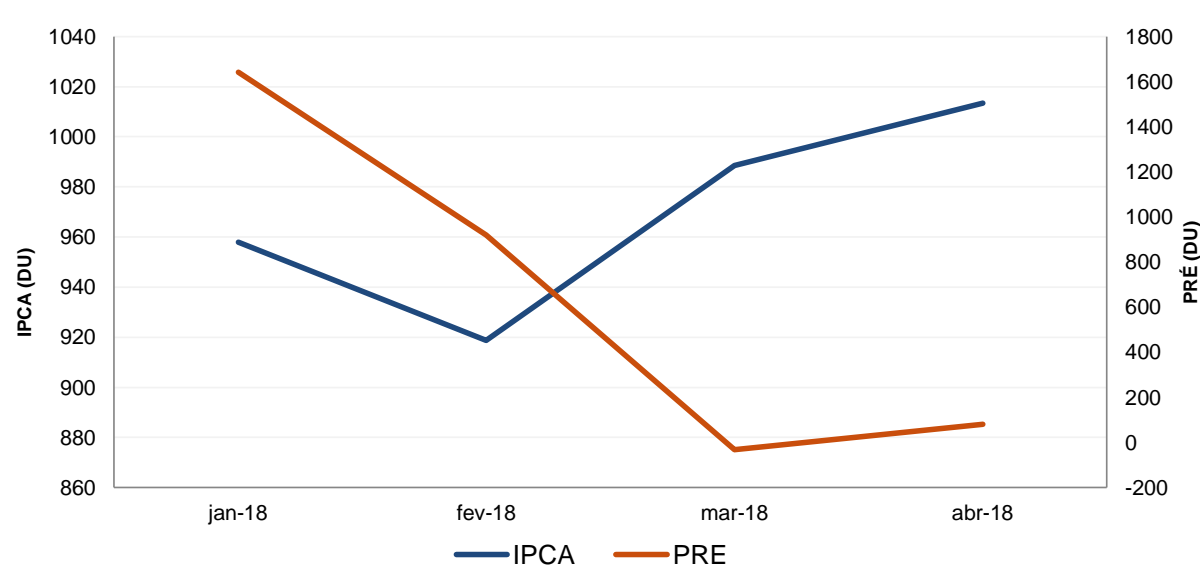
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Renda Variável

Essa seção abrange análises sobre a carteira de Renda Variável. Todas as informações sobre concentração são relativas ao total da carteira de Renda Variável do plano.

Maiores Exposições

A análise de maiores exposições apresenta as ações com maior participação na carteira, o setor ao qual pertencem e a evolução da posição em relação ao mês anterior.

Nome	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
T10M18Serie		349,21	15,93	613,60	25,99
ITUB4	Intermediários Financeiros	144,47	6,59	104,16	4,41
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	140,39	6,40	106,11	4,49
FIBR3	Madeira e Papel	115,27	5,26	80,62	3,41
ABEV3	Bebidas	107,96	4,92	137,35	5,82
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	89,07	4,06	117,15	4,96
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	80,79	3,68	77,57	3,29
LREN3	Comércio	79,14	3,61	158,88	6,73
VALE3	Mineração	78,91	3,60	60,22	2,55
ITSA4	Intermediários Financeiros	69,47	3,17	67,02	2,84

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

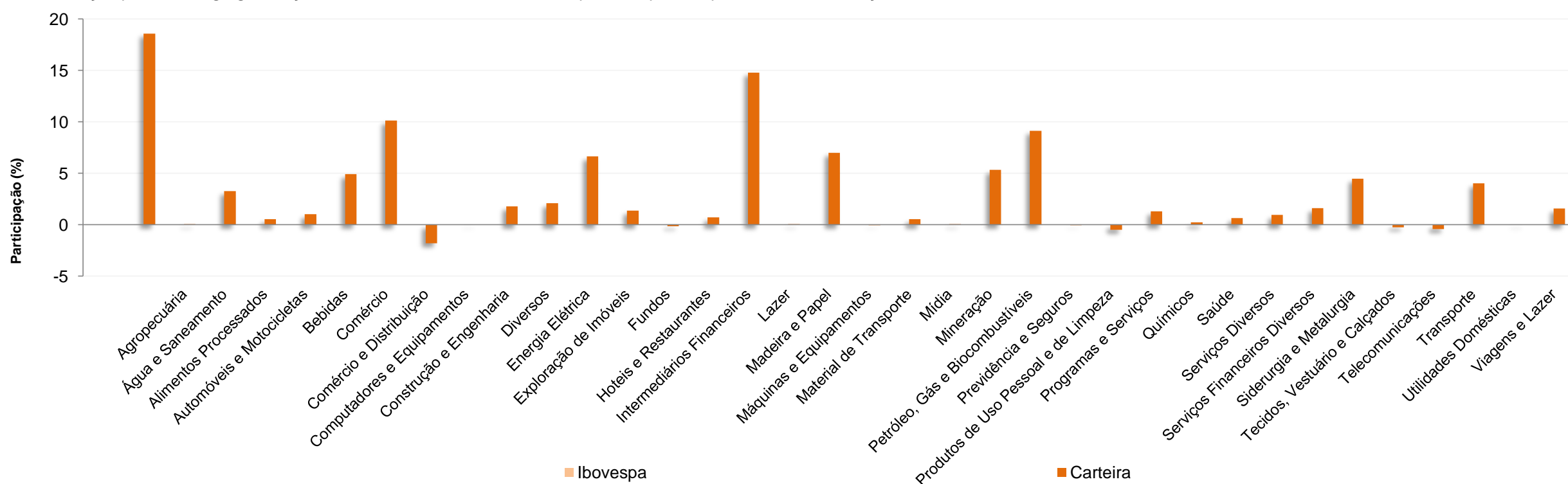
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
ITUB4	144,47	6,59	0,00	1
PETR4	140,39	6,40	0,00	1
FIBR3	115,27	5,26	0,00	1
ABEV3	107,96	4,92	0,00	1
B3SA3	89,07	4,06	0,00	1
GGBR4	80,79	3,68	0,00	1
LREN3	79,14	3,61	0,00	1
VALE3	78,91	3,60	0,00	1
ITSA4	69,47	3,17	0,00	1
SUZB3	65,29	2,98	0,00	1

* em mil R\$

Concentração por setor

A concentração por setor segrega as ações da carteira em setores da Bovespa e compara os percentuais de alocação da carteira com os do benchmark de renda variável.



RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/04/2018

Análises de Contrapartes

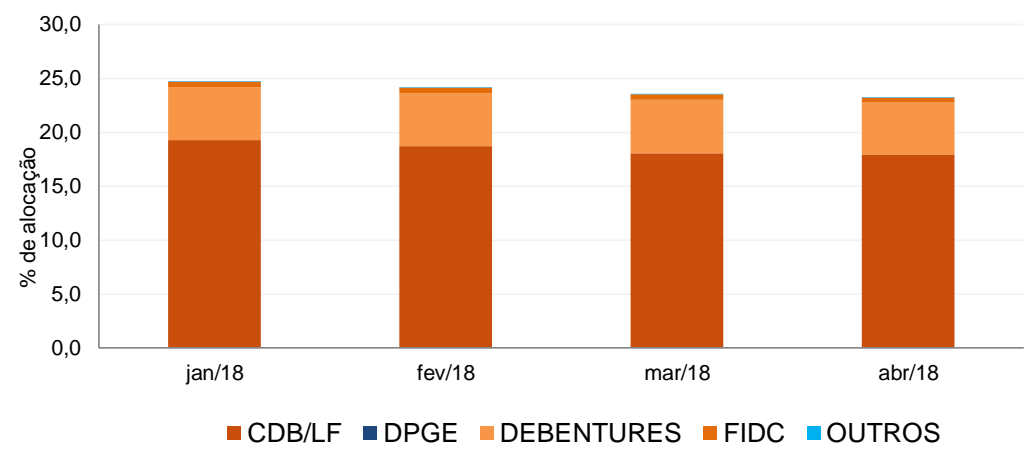
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO BRASIL SA	6.135,99	4,23	AA+ (bra)	Aa1.br	
BCO ITAU SA	5.572,65	3,85	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO BRADESCO SA	5.381,62	3,71	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	2.762,08	1,91	AA+ (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	2.266,84	1,56		Aaa.br	brAA-
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.873,31	1,29	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO SAFRA SA	1.778,69	1,23		Aa1.br	brAA-
BCO VOTORANTIM SA	1.103,14	0,76		Aa3.br	brAA-
CCR SA	1.059,63	0,73	AA (bra)	A2.br	brAA-
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	943,77	0,65	AA+ (bra)	Aaa.br	brA+

* 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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Rating	Agência	Veículo
CCRAA0	15-jun-20	311.348	0,21%	CDI	CCR SA	20-abr-18	107,50%	AA (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
CCRDB1	15-nov-22	268.326	0,19%	CDI	CCR SA	20-abr-18	1,17%	AA (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
CDB CDI	10-mai-19	56.579	0,04%	CDI	BCO MERRILL LYNCH INVESTS SA	20-abr-18	104,50%	AAA (bra)	Fitch	ATLANTIDA FI MULT
CDB CDI	24-jul-19	509.200	0,35%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	20-abr-18	104,00%	brAA-	S&P	ITAPEMA FI MULT
DASA18	25-ago-22	152.108	0,10%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	20-abr-18	108,00%	AA+ (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
DASA19	26-mar-23	152.570	0,11%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	20-abr-18	108,60%	AA+ (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
LF CDI	15-jan-19	764.659	0,53%	CDI	BCO BRASIL SA	20-abr-18	111,00%	AA+ (bra)	Fitch	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	19-mar-20	207.693	0,14%	CDI	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	20-abr-18	102,00%	brAA-	S&P	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	23-mar-20	414.906	0,29%	CDI	BCO BRADESCO SA	20-abr-18	102,00%	brAA-	S&P	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	27-mar-20	511.982	0,35%	CDI	BCO SAFRA SA	20-abr-18	103,50%	brAA-	S&P	ITAPEMA FI MULT
LF CDI	13-abr-20	137.234	0,09%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	04-abr-18	107,00%	brA+	S&P	ITAPEMA FI MULT
LF CDI	20-abr-20	623.080	0,43%	CDI	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	20-abr-18	102,00%	brAA-	S&P	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	09-jun-20	206.693	0,14%	CDI	BCO SAFRA SA	20-abr-18	103,50%	brAA-	S&P	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	22-jun-20	414.953	0,29%	CDI	BCO BRADESCO SA	20-abr-18	102,25%	brAA-	S&P	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	11-dez-20	206.710	0,14%	CDI	BCO SAFRA SA	20-abr-18	104,00%	brAA-	S&P	ATLANTIDA FI MULT
LF CDI	11-dez-20	168.171	0,12%	CDI	PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	20-abr-18	105,00%	AA+ (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
LF CDI	18-nov-22	1.582.485	1,09%	CDI	BCO BRADESCO SA	20-abr-18	115,00%	brAA-	S&P	ITAPEMA FI MULT
LF CDI	18-nov-22	226.069	0,16%	CDI	BCO BRADESCO SA	09-abr-18	115,00%	brAA-	S&P	ITAPEMA FI MULT
LF CDI Semestral	10-abr-20	246.769	0,17%	CDI	BANCO RCI BRASIL SA	20-abr-18	105,60%	Aaa.br	Moody's	ITAPEMA FI MULT
LORTA2	15-mai-24	75.670	0,05%	CDI	LOCALIZA RENT A CAR SA	20-abr-18	107,25%	AAA (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
LORTA3	15-fev-23	674.670	0,47%	CDI	LOCALIZA RENT A CAR SA	20-abr-18	109,35%	AAA (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
NCFP13	23-dez-20	102.211	0,07%	CDI	NCF PARTICIPACOES SA	20-abr-18	112,00%	AA+ (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
NCFP13	23-dez-20	56.784	0,04%	CDI	NCF PARTICIPACOES SA	20-abr-18	112,00%	AA+ (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
NCFP13	23-dez-20	34.070	0,02%	CDI	NCF PARTICIPACOES SA	20-abr-18	112,00%	AA+ (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
NCFP13	23-dez-20	28.392	0,02%	CDI	NCF PARTICIPACOES SA	20-abr-18	112,00%	AA+ (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
NCFP13	23-dez-20	17.035	0,01%	CDI	NCF PARTICIPACOES SA	20-abr-18	112,00%	AA+ (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
NCFP13	23-dez-20	17.035	0,01%	CDI	NCF PARTICIPACOES SA	20-abr-18	112,00%	AA+ (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
NCFP13	23-dez-20	17.035	0,01%	CDI	NCF PARTICIPACOES SA	20-abr-18	112,00%	AA+ (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
PETR35	15-ago-22	304.570	0,21%	CDI	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	20-abr-18	106,75%	brA+	S&P	ITAPEMA FI MULT
SBSF1B	15-jun-20	138.939	0,10%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	20-abr-18	0,48%	AA (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
SBSFA2	15-fev-21	25.862	0,02%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	20-abr-18	0,49%	AA (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
SBSFB2	15-fev-23	36.652	0,03%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	20-abr-18	0,87%	AA (bra)	Fitch	ITAPEMA FI MULT
TAES24	15-set-20	161.023	0,11%	CDI	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELET	20-abr-18	105,00%	brAA-	S&P	ITAPEMA FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2018-09-01	01-set-18	656.151	0,45%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2018-09-01	01-set-18	6.370	0,00%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	5.656.844	3,90%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	407.700	0,28%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	101.925	0,07%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	95.555	0,07%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	38.222	0,03%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	38.222	0,03%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	19.111	0,01%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	207.169	0,14%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ITAPEMA FI MULT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.063.783	0,73%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2020-09-01	01-set-20	210.209	0,15%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.834.423	1,27%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	517.871	0,36%	Selic		20-abr-18	0,00%	0,00%	ITAPEMA FI MULT
LFT 2021-09-01	01-set-21	880.335	0,61%	Selic		20-abr-18	0,01%	0,01%	ITAPEMA FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.040.532	0,72%	Selic		20-abr-18	0,01%	0,01%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2018-08-15	15-ago-18	126.508	0,09%	IPCA		20-abr-18	2,50%	2,52%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2019-05-15	15-mai-19	151.932	0,10%	IPCA		20-abr-18	2,05%	2,06%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2020-08-15	15-ago-20	382.455	0,26%	IPCA		02-abr-18	3,24%	3,23%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2020-08-15	15-ago-20	100.061	0,07%	IPCA		20-abr-18	3,00%	3,00%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2020-08-15	15-ago-20	26.683	0,02%	IPCA		20-abr-18	3,00%	3,00%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	468.525	0,32%	IPCA		20-abr-18	3,44%	3,44%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	468.525	0,32%	IPCA		20-abr-18	3,44%	3,44%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	367.073	0,25%	IPCA		20-abr-18	3,44%	3,44%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	328.336	0,23%	IPCA		20-abr-18	3,44%	3,44%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	152.006	0,10%	IPCA		20-abr-18	3,44%	3,44%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	55.338	0,04%	IPCA		20-abr-18	3,44%	3,44%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	4.537	0,00%	IPCA		20-abr-18	3,44%	3,44%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.845.556	1,27%	IPCA		09-abr-18	4,14%	4,13%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.343.215	0,93%	IPCA		20-abr-18	4,11%	4,11%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.190.329	0,82%	IPCA		20-abr-18	4,11%	4,11%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	982.840	0,68%	IPCA		20-abr-18	4,11%	4,11%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	895.477	0,62%	IPCA		20-abr-18	4,11%	4,11%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	522.361	0,36%	IPCA		20-abr-18	4,11%	4,11%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	491.420	0,34%	IPCA		20-abr-18	4,11%	4,11%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	297.733	0,21%	IPCA		20-abr-18	4,11%	4,11%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	245.710	0,17%	IPCA		20-abr-18	4,11%	4,11%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	8.954	0,01%	IPCA		20-abr-18	4,11%	4,11%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	2.000.294	1,38%	IPCA		20-abr-18	4,36%	4,36%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	72.560	0,05%	IPCA		20-abr-18	4,36%	4,36%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	27.530	0,02%	IPCA		20-abr-18	4,44%	4,44%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	243.694	0,17%	IPCA		19-abr-18	5,18%	5,19%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	239.053	0,16%	IPCA		23-abr-18	5,20%	5,25%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	102.120	0,07%	IPCA		12-abr-18	5,24%	5,19%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	95.157	0,07%	IPCA		20-abr-18	5,20%	5,20%	ATLANTIDA FI MULT

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 30/04/2018

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	71.948	0,05%	IPCA	23-abr-18	5,20%	5,25%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	64.985	0,04%	IPCA	20-abr-18	5,20%	5,20%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-C 2021-04-01	01-abr-21	430.763	0,30%	IGP-M	20-abr-18	3,28%	3,26%	ITAPEMA FI MULT

