

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

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 | 6.929.961,65 | 100,02% | | | | 0,51% | 1,50% | 3,94% | 2,60% | 9,36% | 21,99% | |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,52% | 1,52% | 3,25% | 2,12% | 8,12% | 22,67% | 39,65% |
| CARTEIRA PRÓPRIA MM | 6.469.813,13 | 93,38% | | | | 0,68% | 2,13% | 4,95% | 3,27% | 10,87% | 23,86% | |
| RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR | 6.469.813,13 | 93,38% | | 100% | | 0,68% | 2,13% | 4,95% | 3,27% | 10,87% | 23,86% | - |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,52% | 1,52% | 3,25% | 2,12% | 8,12% | 22,67% | 39,65% |
| RF REFERENCIADO DI | 460.148,52 | 6,64% | | | | | | | | | | |
| BRAM FI REF DI FEDERAL II | 460.148,52 | 6,64% | BRADESCO | 0,01% | 0,00% | 0,51% | 1,50% | 3,22% | 2,09% | 8,18% | 22,66% | 39,54% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,52% | 1,52% | 3,25% | 2,12% | 8,12% | 22,67% | 39,65% |
| Total | 6.928.518,24 | 100% | | | | 0,00% | 0,67% | 1,67% | 4,10% | 2,76% | 9,53% | 22,19% |
| 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.

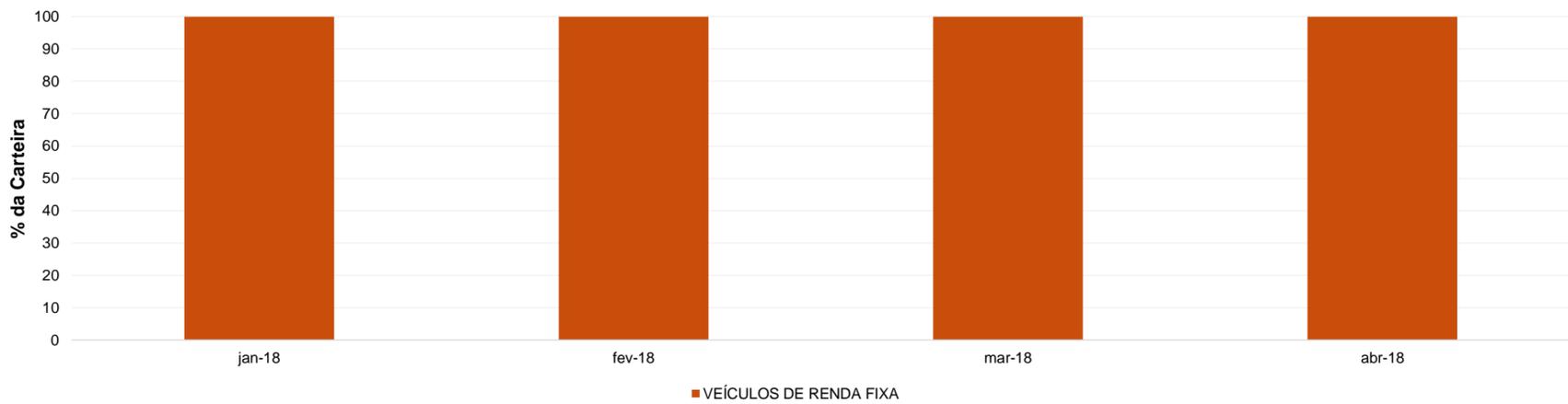


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma. Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se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

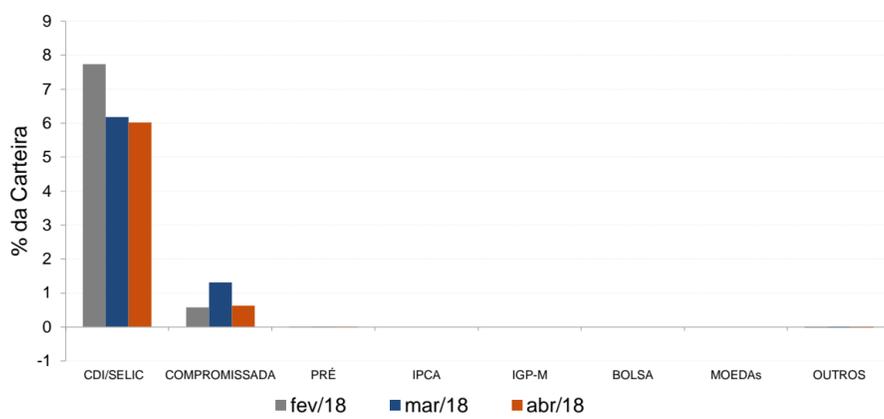
Distribuição da Carteira

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.

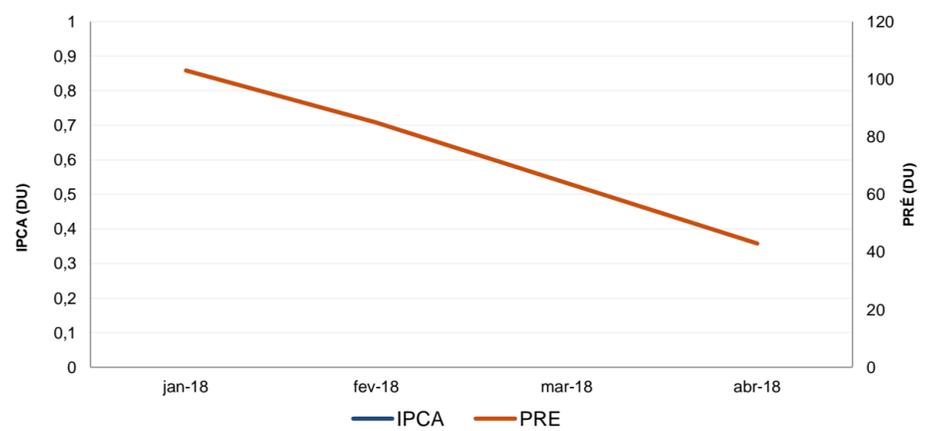
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/04/2018

Análises de Contrapartes

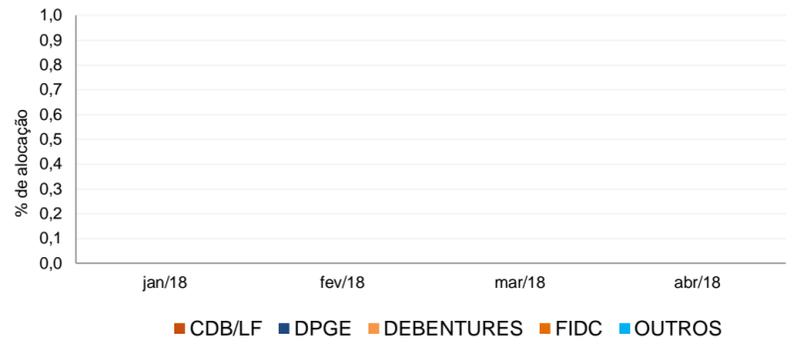
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

| Nome | MtM* | % | Fitch | Moody's | S&P |
|------|------|---|-------|---------|-----|
|------|------|---|-------|---------|-----|

* 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 CONSERVADOR VITALÍCIO

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 | 13.903 | 0,20% | Selic | 05-abr-18 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI REF DI FEDERAL II |
| LFT 2018-09-01 | 01-set-18 | 1.724 | 0,02% | Selic | 05-abr-18 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI REF DI FEDERAL II |
| LFT 2018-09-01 | 01-set-18 | 181 | 0,00% | Selic | 05-abr-18 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI REF DI FEDERAL II |
| LFT 2019-03-01 | 01-mar-19 | 128 | 0,00% | Selic | 05-abr-18 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI REF DI FEDERAL II |
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 9.454 | 0,14% | Selic | 05-abr-18 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI REF DI FEDERAL II |
| LFT 2021-03-01 | 01-mar-21 | 37.088 | 0,54% | Selic | 10-abr-18 | 0,00% | 0,00% | BRAM FI REF DI FEDERAL II |

