

## RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER 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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
<b>Renda Fixa</b>	<b>6.533.819,83</b>	<b>100%</b>											
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,57%	1,65%	3,76%	2,32%	7,18%	16,36%	32,62%	
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>6.533.819,83</b>	<b>100%</b>			<b>0,00%</b>								
BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV	2.676.433,40	40,97%	BTG PACTUAL	0,13%	0,01%	0,59%	1,74%	3,74%	2,45%	9,40%	27,49%	45,50%	
ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	80.442,68	1,23%	ITAU	0,01%	0,00%	0,50%	1,48%	3,18%	2,06%	7,99%	22,61%	39,72%	
FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV	3.776.943,75	57,81%	VOTORANTIM	0,31%	0,01%	0,52%	1,50%	3,25%	2,10%	8,36%	23,70%	40,89%	
Benchmark:	CDI					0,52%	1,52%	3,25%	2,12%	8,12%	22,67%	39,65%	
<b>Total</b>	<b>6.532.902,35</b>	<b>100%</b>			<b>0,00%</b>	<b>0,53%</b>	<b>1,47%</b>	<b>3,19%</b>	<b>2,05%</b>	<b>8,24%</b>	<b>23,28%</b>		
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					0,57%	1,65%	3,76%	2,32%	7,18%	16,36%	32,62%	

\* 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.

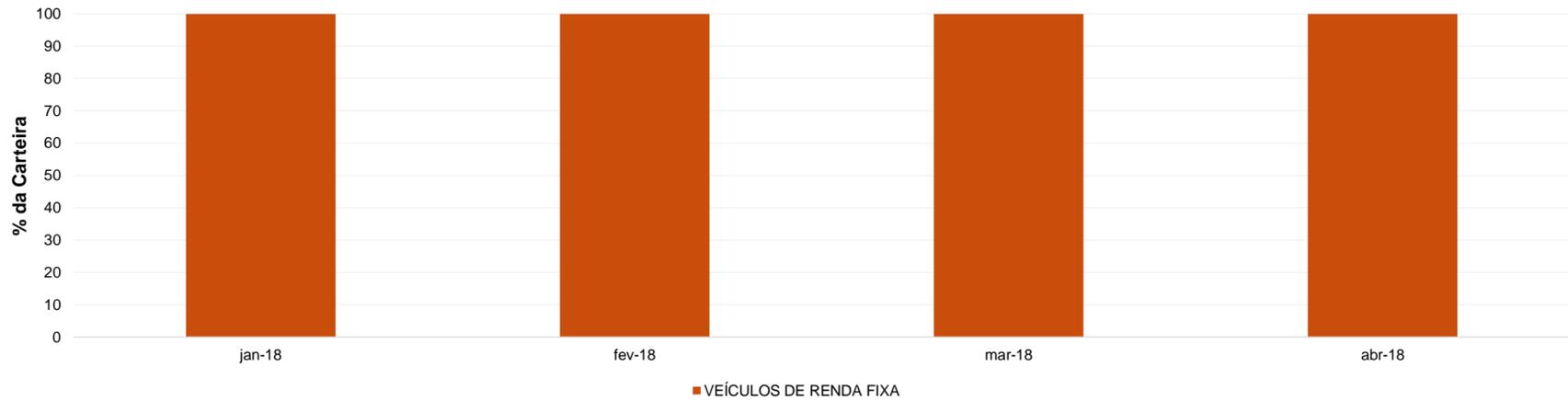


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.  
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.  
A ADITUS não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

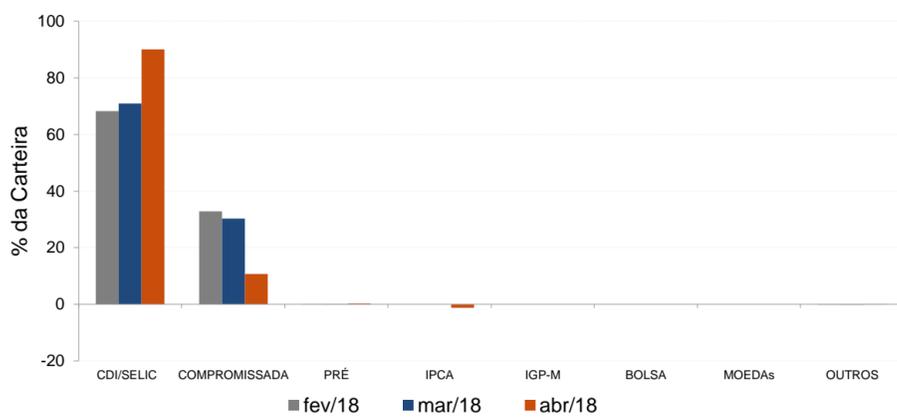
## Distribuição da Carteira

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.

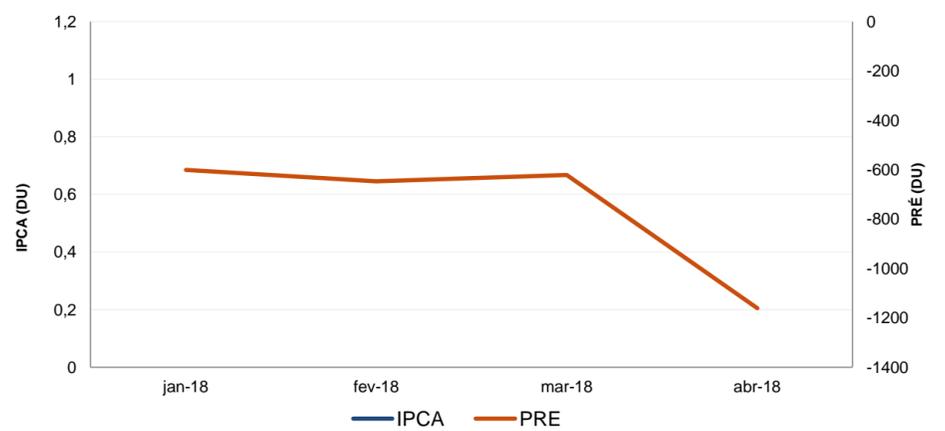
### Evolução do Patrimônio Líquido



### Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



### Evolução da Duration



## Análises de Contrapartes

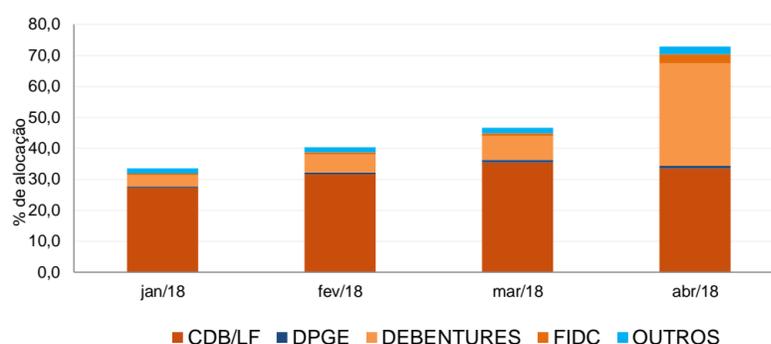
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

### Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO VOTORANTIM SA	597,74	9,11		Aa3.br	brAA-
BCO SAFRA SA	361,33	5,51		Aa1.br	brAA-
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	253,44	3,86			brAA-
BCO BRASIL SA	173,51	2,64	AA+ (bra)	Aa1.br	
BCO ITAU SA	139,28	2,12	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO VOLKSWAGEN SA	114,32	1,74			brAA-
LOCALIZA RENT A CAR SA	108,23	1,65	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ES1	105,77	1,61	AA (bra)	Aa2.br	brAA-
AES TIETE ENERGIA SA	104,96	1,60		Aa1.br	
CENTRAIS ELETRICAS PARA SA CELPA	103,42	1,58	AA- (bra)		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
EBEN17	49,35	EDP SAO PAULO DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A.	Aa2.br	Aa1.br	Moody's	07-abr-22	CDI	108,75%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
ENGI25	26,90	ENERGISA SA	A2.br	A1.br	Moody's	15-jul-19	IPCA	3,29%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI
GEPA16	0,21	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	Aa1.br	Aaa.br	Moody's	08-set-18	CDI	0,38%	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
RDCO14	3,81	RODOVIAS COLINAS SA	BBB (bra)	A (bra)	Fitch	15-out-20	CDI	1,45%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI
RDCO34	4,20	RODOVIAS COLINAS SA	BBB (bra)	A (bra)	Fitch	15-abr-23	IPCA	6,47%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI
TSAE12	13,16	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	BBB (bra)	A (bra)	Fitch	15-abr-20	CDI	1,45%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI
TSAE22	19,61	TRIANGULO SOL AUTO ESTRADAS SA	BBB (bra)	A (bra)	Fitch	15-abr-20	IPCA	4,49%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI



**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
CDB CDI	27-jul-18	49.179	0,75%	CDI	PARANA BCO SA	04-abr-18	108,00%	brA+	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
CDB CDI	06-mai-19	15.338	0,23%	CDI	BCO MERRILL LYNCH INVESTS SA	20-abr-18	104,50%	AAA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
CEEBB0	03-out-22	31.547	0,48%	CDI	CIA ELETRICIDADE ESTADO BAHIA COEL	03-abr-18	116,00%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
CRFB11	25-abr-21	785	0,01%	CDI	ATACADAO SA	27-abr-18	104,40%	Rating	Agência	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
FLRY14	27-abr-21	155	0,00%	CDI	FLEURY SA	27-abr-18	0,35%	Aa2.br	Moody's	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
GEPA18	15-mar-23	31.865	0,49%	CDI	RIO PARANAPANEMA ENERGIA SA	20-abr-18	106,75%	brAA+	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	27-ago-18	47.868	0,73%	CDI	BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	16-abr-18	105,50%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	01-out-18	21.785	0,33%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	16-abr-18	106,00%	Aa3.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	17-abr-20	37.367	0,57%	CDI	BCO SOFISA SA	10-abr-18	111,80%	A (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	03-set-21	49	0,00%	CDI	BCO BRADESCO SA	03-abr-18	103,10%	brAA-	S&P	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
LF CDI	17-ago-23	22.262	0,34%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	27-abr-18	1,21%	Aa3.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
RADL12	02-abr-19	37	0,00%	CDI	RAIA DROGASIL SA	13-abr-18	102,25%	AAA (bra)	Fitch	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
RADL22	02-out-19	36	0,00%	CDI	RAIA DROGASIL SA	13-abr-18	102,25%	AAA (bra)	Fitch	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
RADL32	02-abr-20	37	0,00%	CDI	RAIA DROGASIL SA	13-abr-18	102,75%	AAA (bra)	Fitch	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
RADL42	02-out-20	36	0,00%	CDI	RAIA DROGASIL SA	13-abr-18	103,00%	AAA (bra)	Fitch	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI

