

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 28/02/2018

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	6.952.193,99	100,02%			0,46%	2,86%	5,04%	1,54%	10,92%			
Benchmark:	CDI				0,47%	1,60%	3,49%	1,05%	8,97%	24,10%	40,95%	
RF REFERENCIADO DI	578.317,43	8,32%										
BRAM FI REF DI FEDERAL II	578.317,43	8,32%	BRADESCO	0,01%	0,01%	0,46%	1,58%	3,49%	1,04%	9,04%	24,03%	40,86%
Benchmark:	CDI					0,47%	1,60%	3,49%	1,05%	8,97%	24,10%	40,95%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	6.373.876,56	91,70%										
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.373.876,56	91,70%		100%		1,12%	2,76%	5,32%	1,12%	11,26%	-	-
Benchmark:	CDI					0,58%	1,70%	3,84%	0,58%	9,40%	24,76%	41,44%
Total	6.950.940,15	100%			0,00%							
Benchmark:	CDI					0,47%	1,60%	3,49%	1,05%	8,97%	24,10%	40,95%

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório 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.

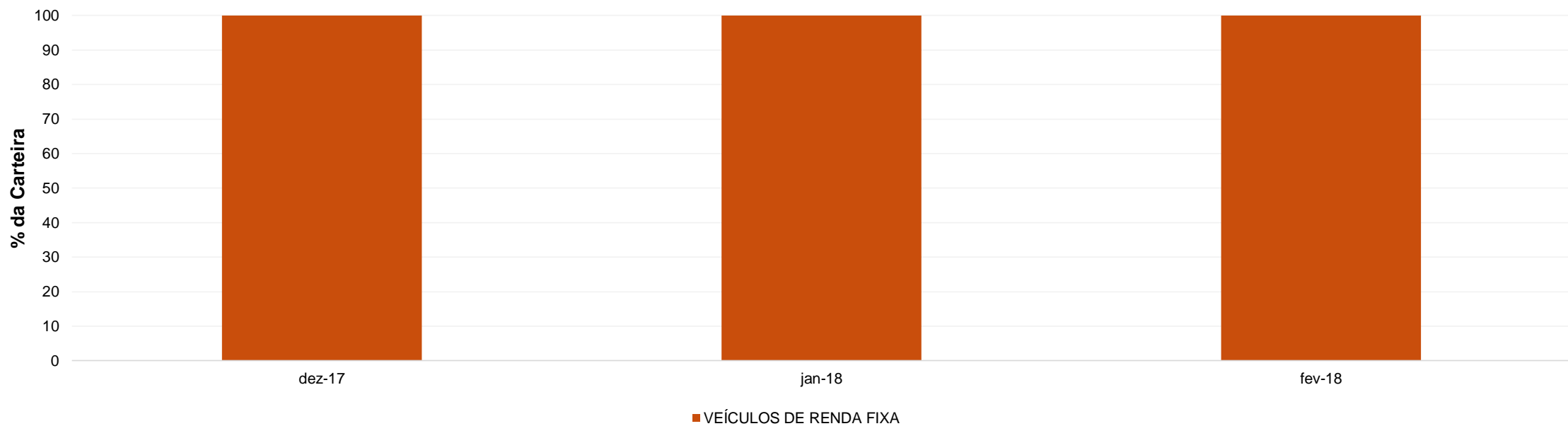
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

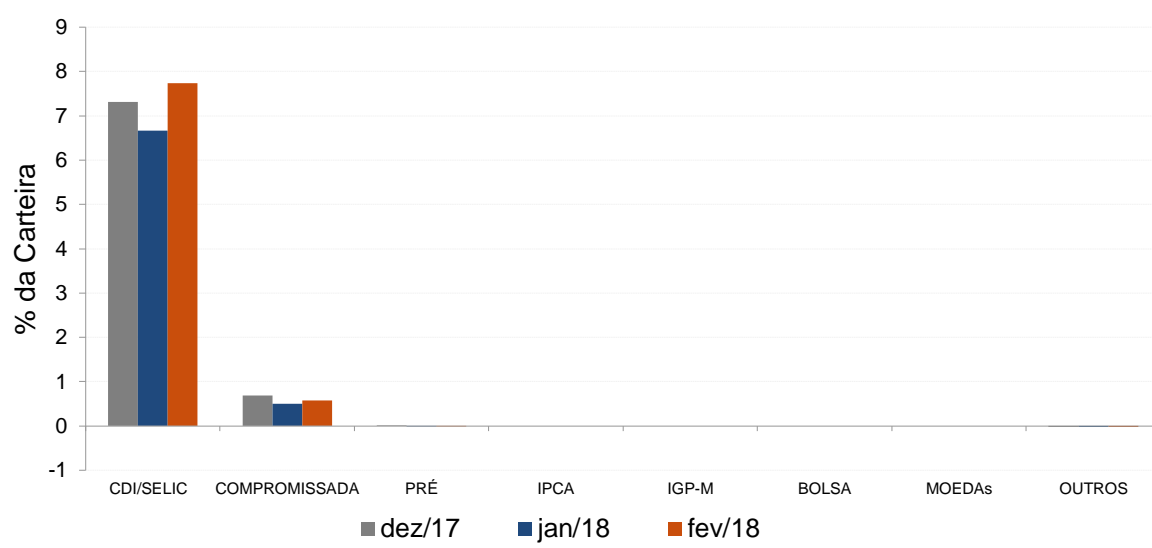
Distribuição da Carteira

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.

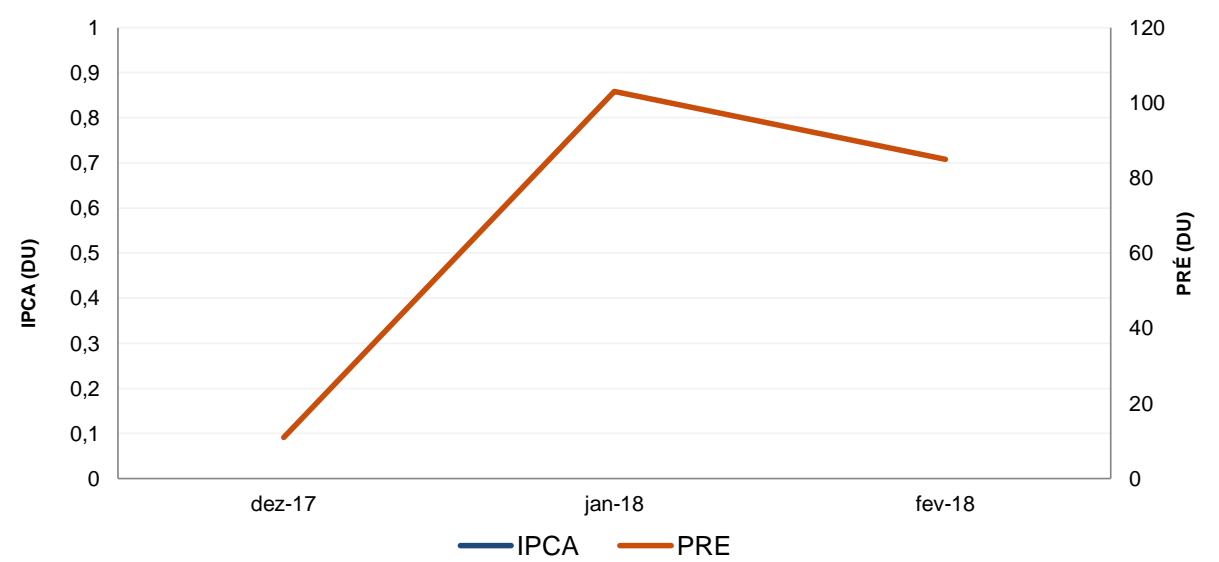
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 28/02/2018

Análises de Contrapartes

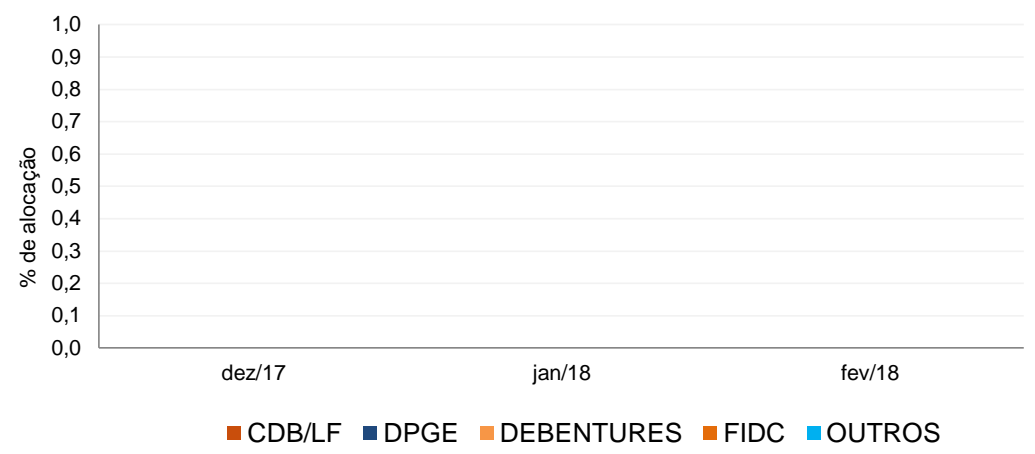
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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: 28/02/2018

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	954	0,01%	Selic	15-fev-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	3.406	0,05%	Selic	14-fev-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II

