

RBSPREV - RBSPREV PLANO CV

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	245.296.817,43	88,70%				0,86%	2,34%	4,02%	1,72%	9,66%		
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.					0,60%	2,00%	3,86%	1,24%	6,91%	16,48%	33,64%
Total Return	231.666.151,81	83,77%			0,55%	0,86%	2,36%	5,09%	1,75%	10,23%		
ITAPEMA FI MULT	82.388.362,66	29,79%	SUL AMERICA	100%	0,75%	0,81%	2,54%	4,43%	1,70%	11,36%	27,45%	44,80%
TORRES FI MULT	31.990.932,38	11,57%	ITAU	100%	0,32%	0,93%	2,25%	3,76%	1,58%	7,92%	23,91%	41,74%
ATLANTIDA FI MULT	63.804.863,92	23,07%	ITAU	100%	0,69%	0,93%	2,13%	3,77%	1,82%	8,88%	22,80%	41,36%
LAGOINHA FI MULT	53.481.992,85	19,34%	SUL AMERICA	100%	0,24%	0,81%	2,38%	3,92%	1,75%	9,71%	24,76%	41,99%
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.					0,60%	2,00%	3,86%	1,24%	6,91%	16,48%	33,64%
Renda Fixa CDI	730.245,94	0,26%			0,01%	0,45%	1,58%	4,46%	1,03%	9,29%		
BRAM FI REF DI FEDERAL II	578.317,43	0,21%	BRADESCO	0,01%	0,01%	0,46%	1,58%	3,49%	1,04%	9,04%	24,03%	40,86%
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	151.928,51	0,05%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,45%	1,55%	3,42%	1,02%	8,91%	23,70%	40,27%
Benchmark:	CDI					0,47%	1,60%	3,49%	1,05%	8,97%	24,10%	40,95%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	6.373.876,64	2,30%				1,12%	2,76%	5,32%	1,12%	11,26%		
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.373.876,64	2,30%		100%		1,12%	2,76%	5,32%	1,12%	11,26%	-	-
Benchmark:	CDI					0,47%	1,60%	3,49%	1,05%	8,97%	24,10%	40,95%
RF CRÉDITO	3.772.082,89	1,36%				0,45%	1,58%	3,51%	1,04%	9,30%		
FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV	3.772.082,89	1,36%	VOTORANTIM	0,23%	0,00%	0,45%	1,58%	3,51%	1,04%	9,30%	25,24%	42,27%
Benchmark:	CDI					0,47%	1,60%	3,49%	1,05%	8,97%	24,10%	40,95%
RF REFERENCIADO DI	2.754.460,16	1,00%				0,45%	1,56%	3,43%	1,03%	8,88%		
ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	2.754.460,16	1,00%	ITAU	0,21%	0,00%	0,45%	1,56%	3,43%	1,03%	8,88%	24,08%	41,06%
Benchmark:	CDI					0,47%	1,60%	3,49%	1,05%	8,97%	24,10%	40,95%
Renda Variável	10.610.580,53	3,84%				-4,19%	11,20%	11,63%	5,12%	20,36%		
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					0,73%	19,43%	22,22%	12,24%	31,83%	111,53%	80,71%
Renda Variável Ativa	10.610.580,53	3,84%			2,21%							
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	3.006.617,39	1,09%	BTG PACTUAL	0,60%	5,86%	0,24%	13,39%	13,84%	8,05%	30,34%	64,03%	57,77%
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FI	3.598.923,27	1,30%	ITAU	0,78%	2,71%	1,89%	16,04%	16,73%	9,77%	27,60%	102,13%	76,96%
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	1.978.023,31	0,72%	NEO GESTAO	0,34%	4,15%	-3,89%	5,58%	7,28%	0,29%	40,98%	95,07%	100,91%
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.027.016,56	0,73%	AZ QUEST	0,71%	8,05%	1,98%	23,30%	24,70%	16,04%	31,68%	84,73%	61,14%
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.					0,73%	19,43%	22,22%	12,24%	31,83%	111,53%	80,71%
Estruturados	20.655.340,30	7,47%				0,82%	3,02%	4,82%	2,09%	11,03%		
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,61%	2,08%	4,48%	1,37%	11,12%	29,08%	49,52%
Multimercado Estruturado	20.655.340,30	7,47%			0,83%							
GARDE D ARTAGNAN FICFI MULT	5.212.301,21	1,88%	GARDE	0,15%	1,84%	0,72%	3,41%	4,70%	2,06%	13,40%	33,11%	63,44%
FICFI MULT GARDE DUMAS	2.008.518,93	0,73%	GARDE	0,28%	1,85%	0,72%	3,46%	4,70%	2,07%	13,38%	32,96%	63,22%
KINEA CHRONOS FI MULT	6.765.960,42	2,45%	KINEA	0,32%	1,03%	0,96%	2,85%	5,18%	2,30%	12,25%	40,72%	-
AZ QUEST MULT FC FI MULT	3.532.215,90	1,28%	AZ QUEST	0,59%	2,54%	1,44%	5,05%	6,92%	3,84%	12,49%	43,26%	67,86%
SUL AMERICA ENDURANCE FI MULT	3.136.343,84	1,13%	SUL AMERICA	0,73%	0,18%	0,37%	1,37%	3,35%	1,06%	10,71%	27,73%	49,66%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,61%	2,08%	4,48%	1,37%	11,12%	29,08%	49,52%
Total	276.556.914,03	100%			0,80%	0,79%	2,47%	4,14%	1,78%	9,82%		
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.					0,63%	2,09%	4,05%	1,30%	7,30%	17,35%	35,14%

* 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.

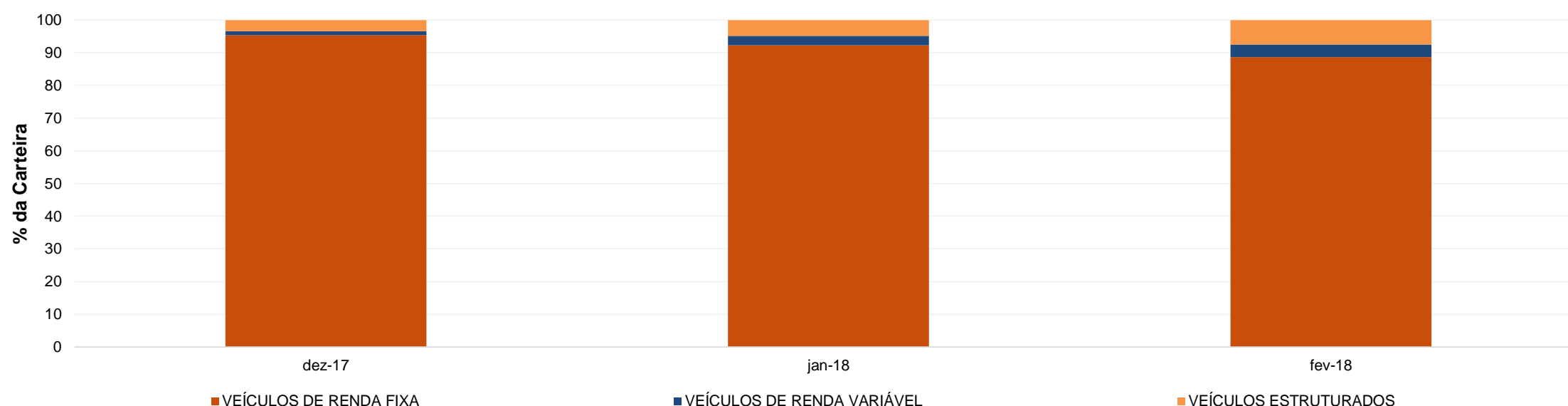
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

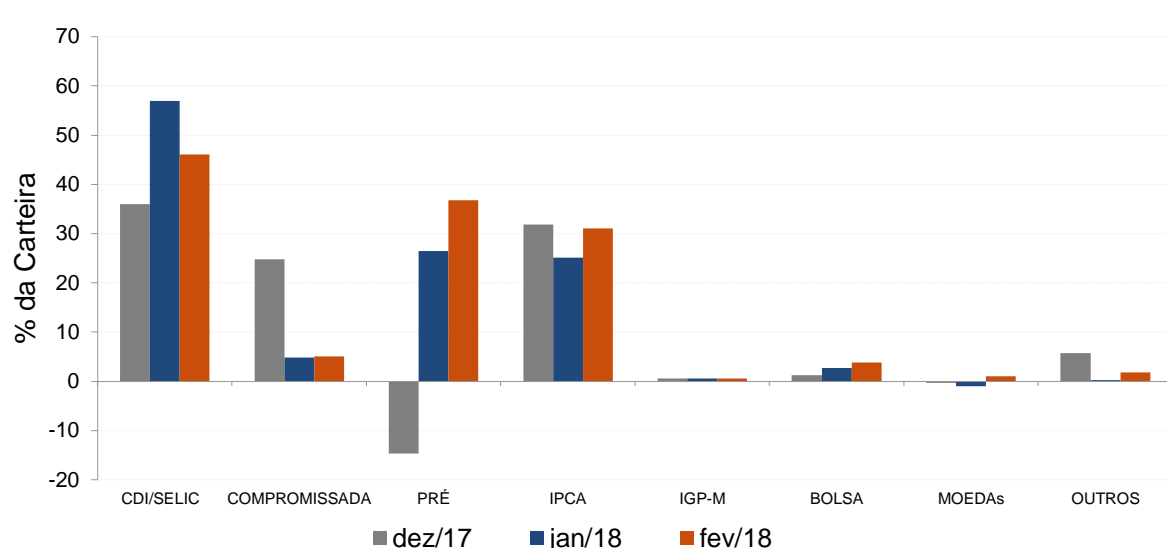
Distribuição da Carteira

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.

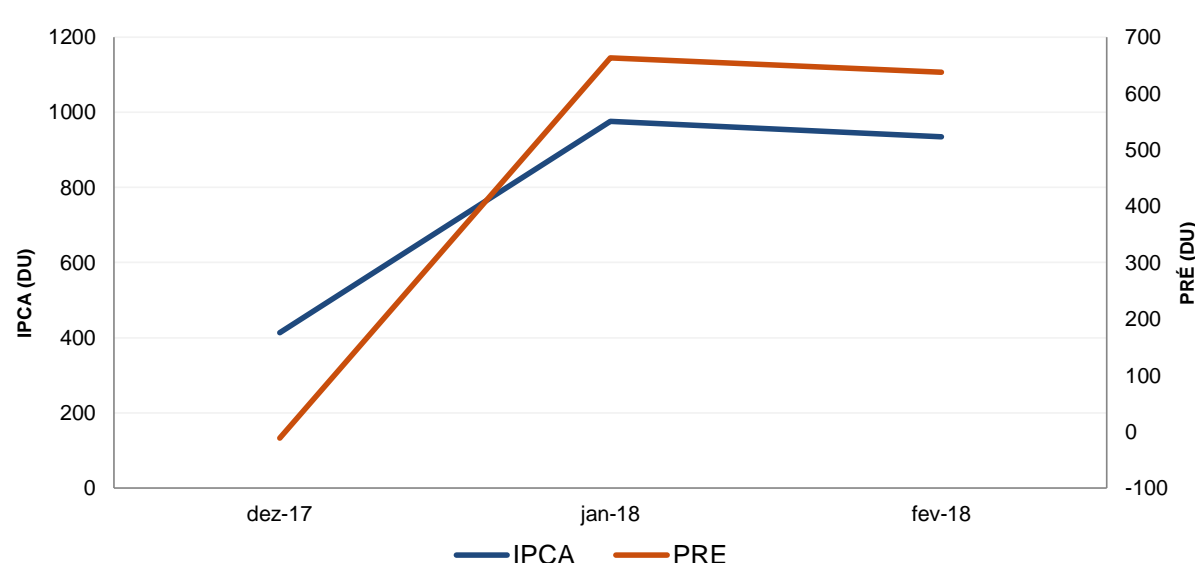
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



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		3.074,52	19,72	0,00	
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	684,08	4,39	370,11	5,22
ITUB4	Intermediários Financeiros	653,82	4,19	285,50	4,03
EQTL3	Energia Elétrica	595,25	3,82	297,10	4,19
ESH8		580,04	3,72	0,00	
RENT3	Diversos	513,63	3,30	157,51	2,22
BBAS3	Intermediários Financeiros	464,55	2,98	287,67	4,06
CVCB3	Viagens e Lazer	447,55	2,87	128,94	1,82
BBDC4	Intermediários Financeiros	444,04	2,85	334,56	4,72
BVMF3	Serviços Financeiros Diversos	436,37	2,80	340,59	4,81

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

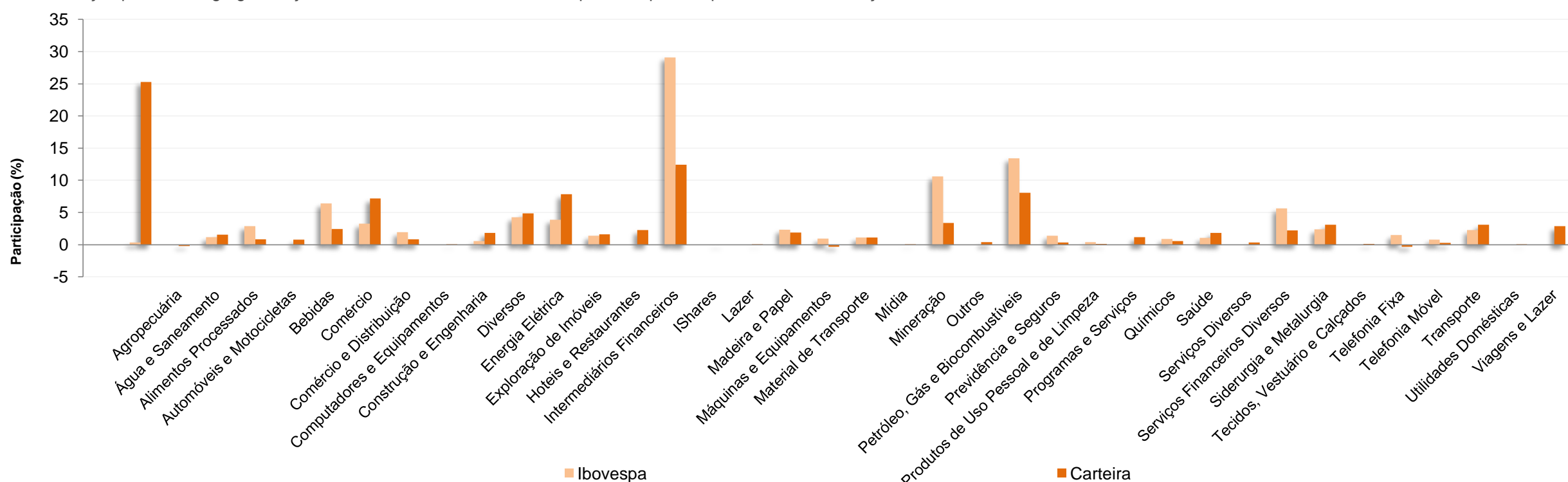
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PETR4	684,08	4,39	0,00	1
ITUB4	653,82	4,19	0,00	1
EQTL3	595,25	3,82	0,00	1
RENT3	513,63	3,30	0,00	1
BBAS3	464,55	2,98	0,00	1
CVCB3	447,55	2,87	0,00	1
BBDC4	444,04	2,85	0,00	1
BVMF3	436,37	2,80	0,00	1
ABEV3	380,24	2,44	0,00	1
UGPA3	375,89	2,41	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.



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.

Análises de Contrapartes

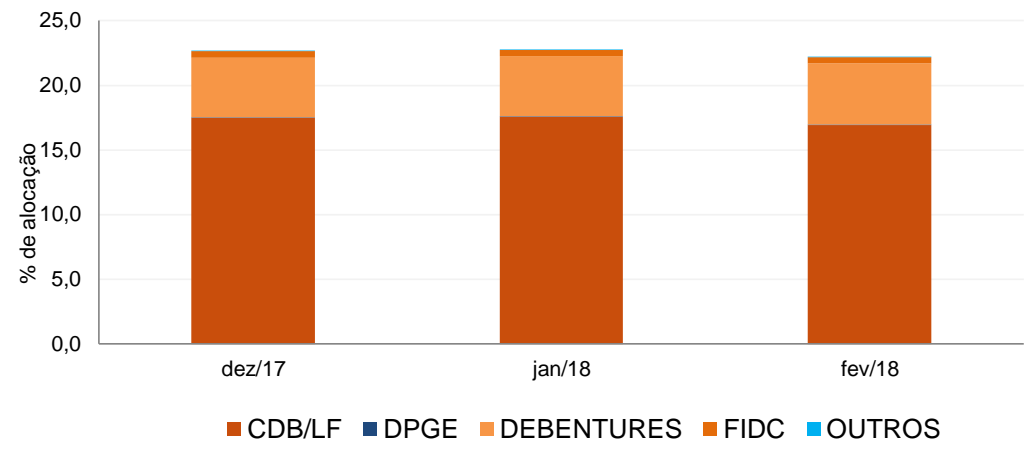
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	11.646,55	4,22	AA+ (bra)	Aa1.br	
BCO BRADESCO SA	9.852,17	3,57	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
ITAU UNIBANCO SA	9.349,16	3,38	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	4.399,55	1,59		Aaa.br	brAA-
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	4.188,09	1,52	AA+ (bra)	Aa1.br	brAA-
LOCALIZA RENT A CAR SA	3.886,60	1,41	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO SAFRA SA	3.371,73	1,22		Aa1.br	brAA-
BCO VOTORANTIM SA	2.334,39	0,85		Aa3.br	brAA-
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	2.239,12	0,81	AA+ (bra)	Aaa.br	brA+
CCR SA	1.938,42	0,70	AA (bra)	A2.br	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.									



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-mar-18	11.483	0,00%	CDI	BCO GMAC SA	16-fev-18	101,80%	Aa2.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
JSML18	15-jun-19	2.355	0,00%	CDI	JSL SA	21-fev-18	0,24%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	29-ago-18	9.757	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	23-fev-18	101,85%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	29-ago-18	8.781	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	23-fev-18	101,85%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	29-ago-18	1.951	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	23-fev-18	101,85%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	29-ago-18	976	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	23-fev-18	101,85%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	11-out-18	6.398	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	08-fev-18	104,50%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	21-dez-18	2.924	0,00%	CDI	BCO SAFRA SA	23-fev-18	102,00%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	06-fev-20	13.018	0,00%	CDI	ITAU UNIBANCO SA	06-fev-18	101,75%	brAA-	S&P	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
LF CDI	06-mar-20	9.659	0,00%	CDI	ITAU UNIBANCO SA	06-fev-18	101,80%	brAA-	S&P	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
SBSP2B	15-jun-22	6.584	0,00%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	07-fev-18	0,60%	AA (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
SBSPA2	15-fev-21	46.839	0,02%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	19-fev-18	0,58%	AA (bra)	Fitch	LAGOINHA FI MULT
SBSPB2	15-fev-23	66.369	0,02%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	19-fev-18	0,90%	brAA-	S&P	LAGOINHA FI MULT
SBSPC2	15-fev-25	187.768	0,07%	IPCA	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	19-fev-18	6,00%	brAA-	S&P	ITAPEMA FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1.172.657	0,42%	Selic		20-fev-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	384.632	0,14%	Selic		19-fev-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	253.294	0,09%	Selic		15-fev-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	197.006	0,07%	Selic		22-fev-18	0,01%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	178.244	0,06%	Selic		19-fev-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	28.144	0,01%	Selic		08-fev-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	18.763	0,01%	Selic		02-fev-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2018-09-01	01-set-18	18.762	0,01%	Selic		26-fev-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2018-09-01	01-set-18	18.762	0,01%	Selic		27-fev-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2018-09-01	01-set-18	3.616	0,00%	Selic		22-fev-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	954	0,00%	Selic		15-fev-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	362	0,00%	Selic		21-fev-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	3.406	0,00%	Selic		14-fev-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.410	0,00%	Selic		15-fev-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.205	0,00%	Selic		16-fev-18	0,01%	0,01%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	3.890.169	1,41%	IPCA		08-fev-18	4,14%	4,25%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	2.593.446	0,94%	IPCA		08-fev-18	4,16%	4,25%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	2.540.787	0,92%	IPCA		08-fev-18	4,14%	4,25%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	1.691.664	0,61%	IPCA		08-fev-18	4,16%	4,25%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	1.296.723	0,47%	IPCA		08-fev-18	4,16%	4,25%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	845.832	0,31%	IPCA		08-fev-18	4,16%	4,25%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	344.122	0,12%	IPCA		16-fev-18	4,70%	4,64%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	181.988	0,07%	IPCA		16-fev-18	4,70%	4,64%	TORRES FI MULT

