

RBSPREV - RBSPREV PGA

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 | 725.549,64 | 100,00% | | | | 0,44% | 1,52% | 3,42% | 0,98% | 8,82% | 23,99% | 40,96% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,47% | 1,60% | 3,49% | 1,05% | 8,97% | 24,10% | 40,95% |
| RF CRÉDITO | 573.621,13 | 79,06% | | | | | | | | | | |
| VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV | 573.621,13 | 79,06% | VOTORANTIM | 0,09% | 0,00% | 0,45% | 1,59% | 3,55% | 1,04% | 9,20% | 24,77% | 42,31% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,47% | 1,60% | 3,49% | 1,05% | 8,97% | 24,10% | 40,95% |
| RF REFERENCIADO DI | 151.928,51 | 20,94% | | | | | | | | | | |
| BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA | 151.928,51 | 20,94% | 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% |
| Total | 725.549,64 | 100% | | | | 0,00% | 0,44% | 1,52% | 0,98% | 8,82% | 23,99% | 40,96% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,47% | 1,60% | 3,49% | 1,05% | 8,97% | 24,10% | 40,95% |

* 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.

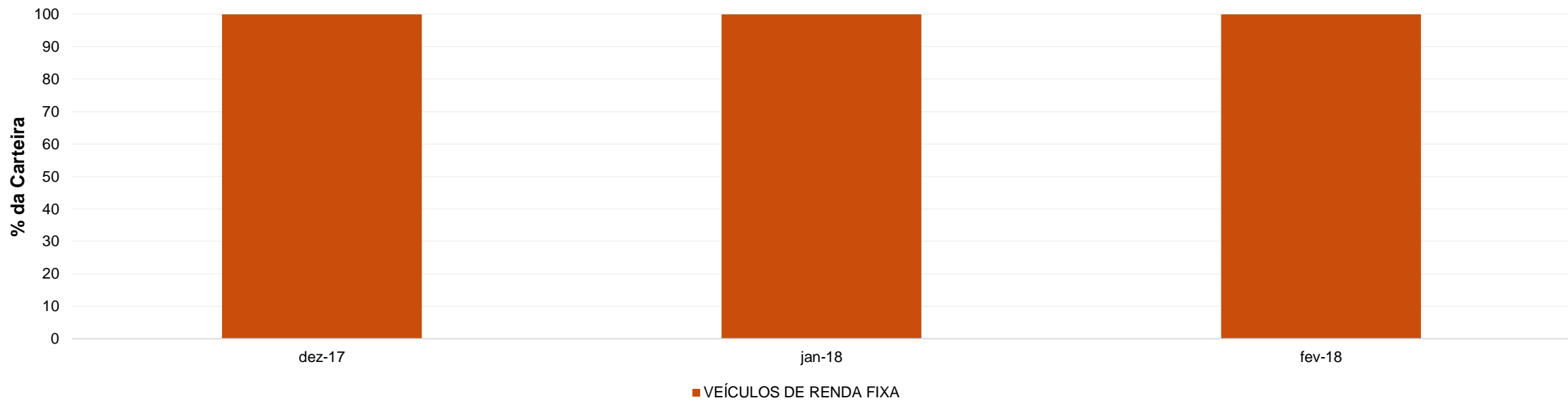


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.
A ADITUS não se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

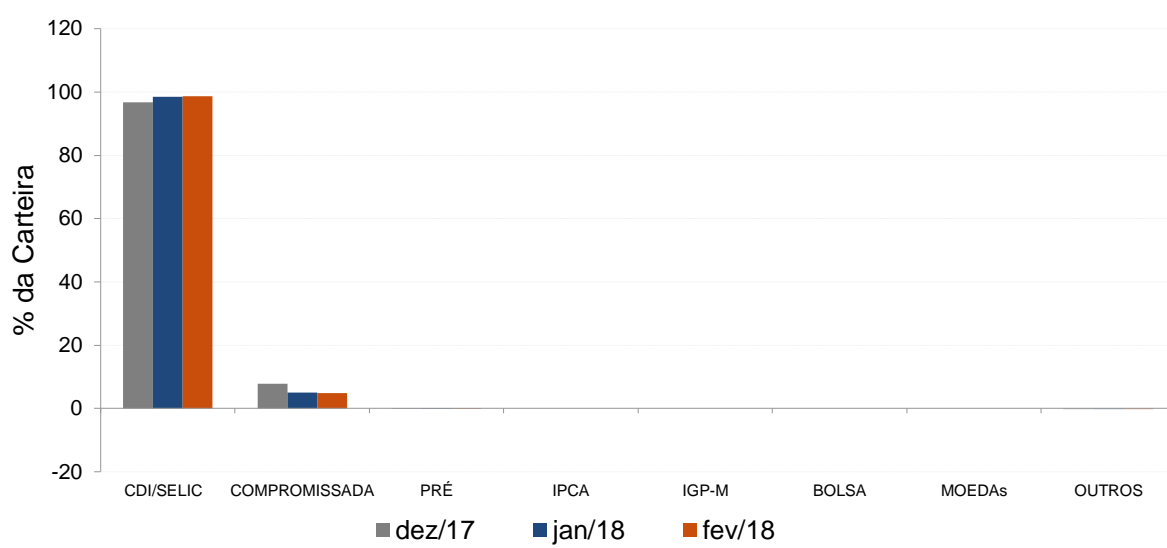
Distribuição da Carteira

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.

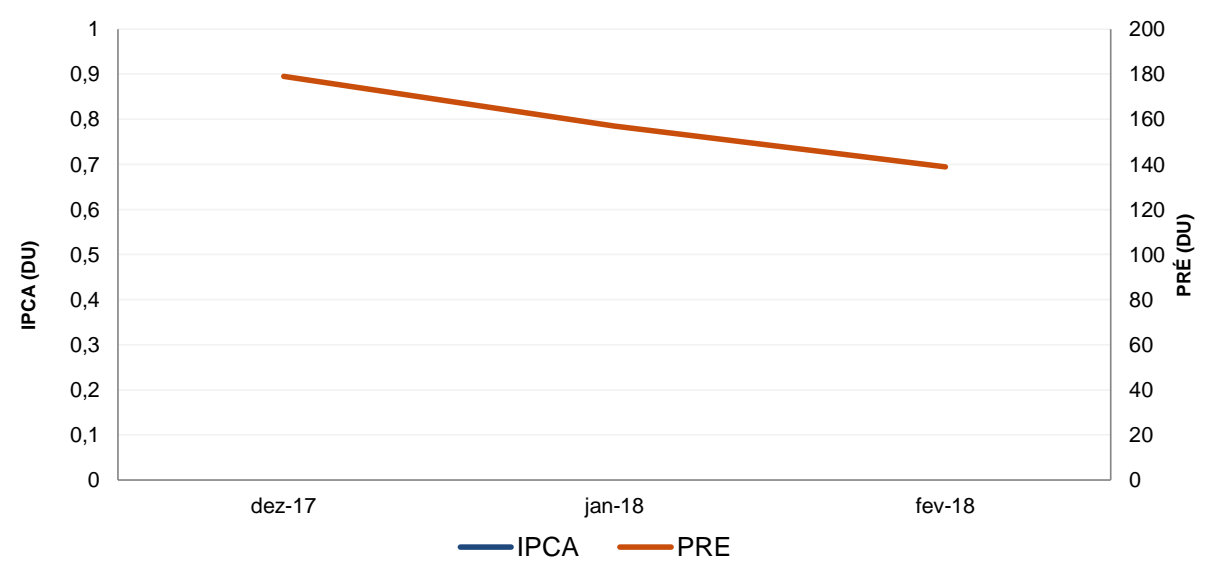
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 28/02/2018

Análises de Contrapartes

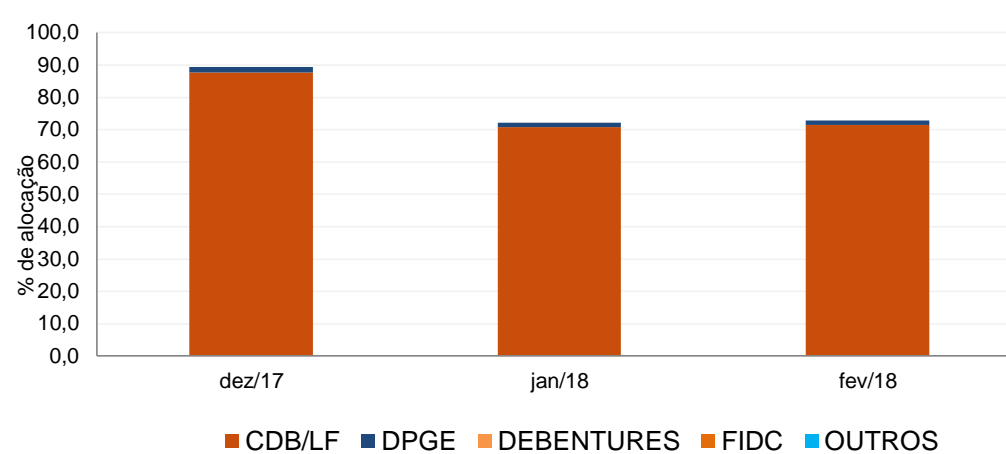
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

| Nome | MtM* | % | Fitch | Moody's | S&P |
|-------------------------------------|--------|-------|-----------|---------|-------|
| BCO BNP PARIBAS BRASIL SA | 112,82 | 15,39 | | | brAA- |
| BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM | 78,45 | 10,70 | AA+ (bra) | Aa2.br | brAA- |
| BCO VOTORANTIM SA | 68,65 | 9,36 | | Aa3.br | brAA- |
| BCO SAFRA SA | 51,60 | 7,04 | | Aa1.br | brAA- |
| BCO TOYOTA BRASIL SA | 48,52 | 6,62 | | | brAA- |
| BCO BRADESCO SA | 34,46 | 4,70 | AAA (bra) | Aa1.br | brAA- |
| BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL IN\ | 31,37 | 4,28 | AA (bra) | Aa1.br | |
| BCO GMAC SA | 28,93 | 3,95 | AAA (bra) | Aa2.br | |
| BCO VOLKSWAGEN SA | 25,68 | 3,50 | | | brAA- |
| BCO CITIBANK SA | 18,07 | 2,46 | | | 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. | | | | | | | | | |



RBSPREV - RBSPREV PGA

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 Privados | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | Emissor | Data Compra | Tx de Compra | Rating | Agência | Veículo |
|------------------|------------|-------|-----------------|-----------|--------------|-------------|--------------|--------|---------|-----------------------------------|
| LF CDI | 11-out-18 | 1.490 | 0,20% | CDI | BCO SAFRA SA | 08-fev-18 | 104,50% | brAA- | S&P | VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV |
| LF CDI | 21-dez-18 | 1.090 | 0,15% | CDI | BCO SAFRA SA | 23-fev-18 | 102,00% | brAA- | S&P | VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV |

| Títulos Públicos | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | | Data Compra | Tx de Compra | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|-------|-----------------|-----------|--|-------------|--------------|----------------|-----------------------------------|
| LFT 2018-09-01 | 01-set-18 | 3.616 | 0,49% | Selic | | 22-fev-18 | 0,00% | 0,00% | BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2018-09-01 | 01-set-18 | 362 | 0,05% | Selic | | 21-fev-18 | 0,00% | 0,00% | BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 2.410 | 0,33% | Selic | | 15-fev-18 | 0,00% | 0,00% | BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 1.205 | 0,16% | Selic | | 16-fev-18 | 0,01% | 0,01% | BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT |

