

RBSPREV - RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

Data-base: 31/01/2018

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		
Renda Fixa	148.562.620,13	96,74%											
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,63%	1,99%	3,81%	0,63%	6,92%	17,17%	34,84%		
Total Return	101.920.669,80	66,37%			0,88%	1,97%	4,16%	0,88%	10,57%				
ITAPEMA FI MULT	53.732.596,22	34,99%	SUL AMERICA	66%	0,70%	0,88%	2,30%	4,73%	0,88%	12,01%	27,89%	44,88%	
TORRES FI MULT	22.256.056,82	14,49%	ITAU	54%	0,77%	0,64%	1,44%	3,82%	0,64%	9,81%	24,56%	41,51%	
LAGOINHA FI MULT	25.932.016,75	16,89%	SUL AMERICA	49%	0,63%	0,93%	1,73%	4,15%	0,93%	11,72%	25,64%	41,89%	
ATLANTIDA FI MULT	46.641.950,33	30,37%	ITAU	74%	0,77%	0,89%	1,59%	3,53%	0,89%	8,93%	22,68%	41,73%	
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,63%	1,99%	3,81%	0,63%	6,92%	17,17%	34,84%		
Estruturados	5.001.563,44	3,26%											
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,76%	2,20%	4,87%	0,76%	11,57%	29,78%	50,04%		
Multimercado Estruturado	5.001.563,44	3,26%			1,09%	1,66%	4,85%	1,09%	8,55%				
KINEA CHRONOS FI MULT	3.126.737,56	2,04%	KINEA	0%	1,30%	1,33%	2,08%	5,29%	1,33%	13,16%	42,38%	-	
SUL AMERICA ENDURANCE FI MULT	1.874.825,89	1,22%	SUL AMERICA	0%	0,20%	0,69%	1,08%	4,50%	0,69%	11,41%	29,24%	48,08%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,76%	2,20%	4,87%	0,76%	11,57%	29,78%	50,04%		
Total	153.564.332,09	100%			0,70%	0,86%	1,84%	4,09%	0,86%	10,72%	25,38%	42,40%	
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,67%	2,09%	4,00%	0,67%	7,32%	18,04%	36,35%		

* 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.

Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

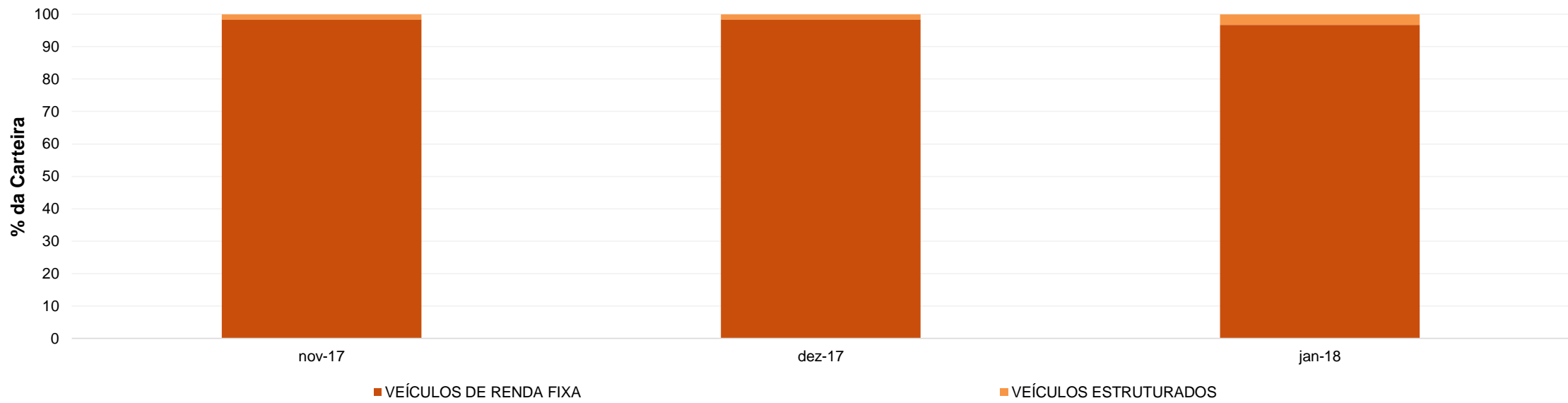
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

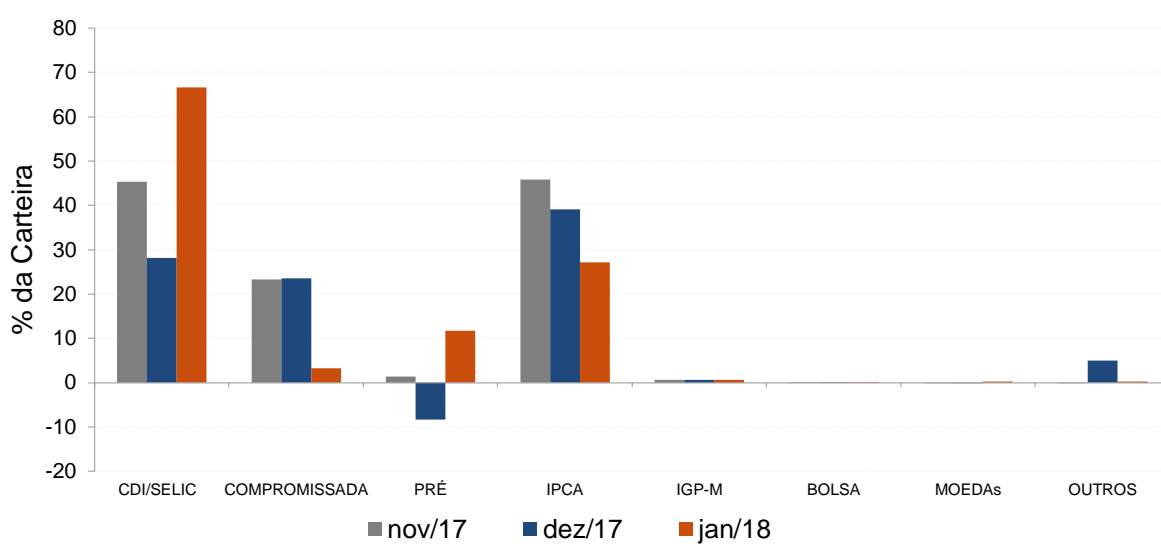
Distribuição da Carteira

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.

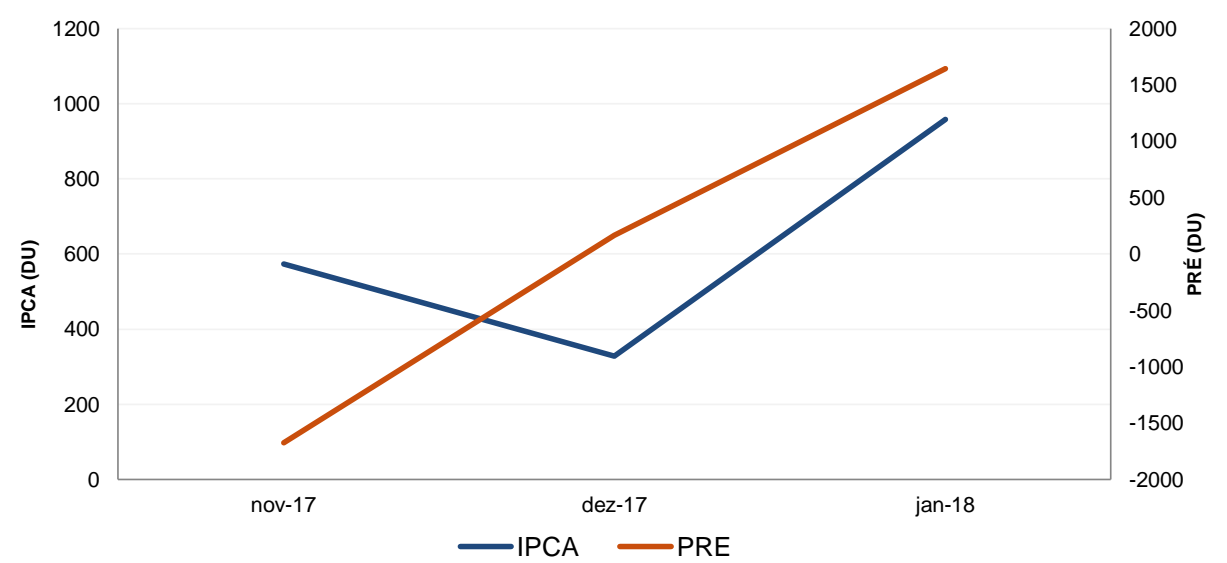
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
RAIL3	Transporte	41,52	16,54	12,68	12,97
PCAR4	Comércio e Distribuição	33,31	13,27	11,29	11,55
ALUP11	Energia Elétrica	30,81	12,27	6,57	6,72
ABEV3	Bebidas	30,27	12,05	6,52	6,67
FLRY3	Saúde	25,93	10,33	5,89	6,03
CVCB3	Viagens e Lazer	24,97	9,95	5,59	5,71
VLID3	Serviços Diversos	22,74	9,06	5,83	5,97
TIMP3	Telefonia Móvel	21,87	8,71	2,53	2,59
CPFE3	Energia Elétrica	21,31	8,49	3,90	3,99
IRBR3	Previdência e Seguros	20,94	8,34	0,00	

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

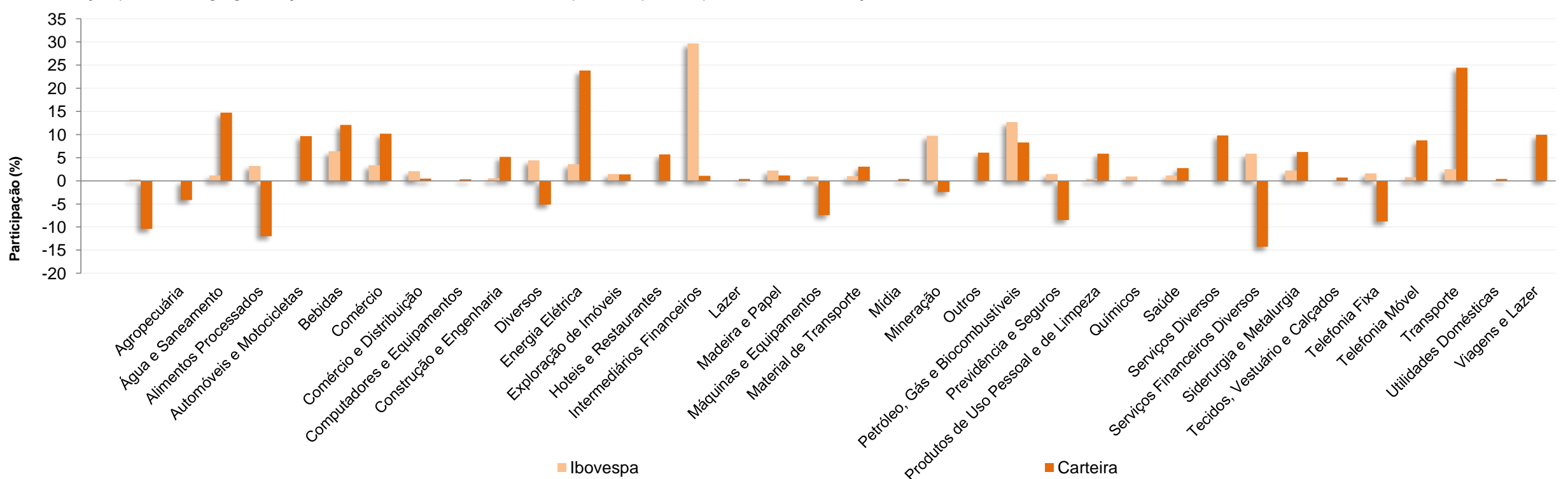
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
RAIL3	41,52	16,54	0,00	1
PCAR4	33,31	13,27	0,00	1
ALUP11	30,81	12,27	0,00	1
ABEV3	30,27	12,05	0,00	1
FLRY3	25,93	10,33	0,00	1
CVCB3	24,97	9,95	0,00	1
VLID3	22,74	9,06	0,00	1
TIMP3	21,87	8,71	0,00	1
CPFE3	21,31	8,49	0,00	1
IRBR3	20,94	8,34	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

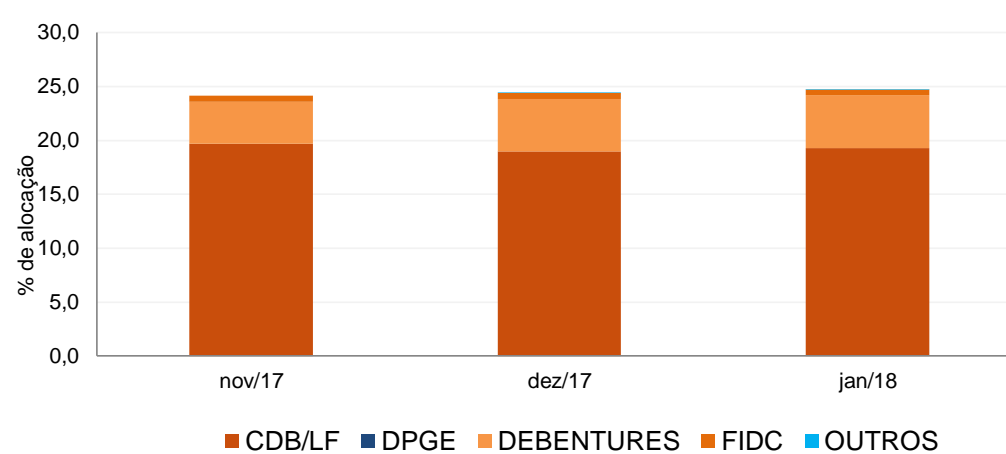
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	7.853,21	5,12	AA+ (bra)	Aa1.br	
ITAU UNIBANCO SA	6.268,69	4,09	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO BRADESCO SA	5.382,75	3,51	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	3.028,86	1,97		Aaa.br	brAA-
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	2.985,35	1,95	AA+ (bra)	Aa1.br	brAA-
LOCALIZA RENT A CAR SA	1.949,26	1,27	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO SAFRA SA	1.789,72	1,17		Aa1.br	brAA-
BCO VOTORANTIM SA	1.303,54	0,85		Aa3.br	brAA-
CCR SA	1.081,17	0,70	AA (bra)	A2.br	brAA-
B3 S.A.- BRASIL, BOLSA, BALCAO	948,60	0,62		Aaa.br	

* 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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2018-03-01	01-mar-18	192.902	0,13%	Selic	02-jan-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	62.004	0,04%	Selic	26-jan-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	50.301	0,03%	Selic	29-jan-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	20.668	0,01%	Selic	16-jan-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	13.779	0,01%	Selic	03-jan-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2018-09-01	01-set-18	6.237.290	4,07%	Selic	02-jan-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2018-09-01	01-set-18	1.453.653	0,95%	Selic	12-jan-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2018-09-01	01-set-18	27.557	0,02%	Selic	04-jan-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2018-09-01	01-set-18	13.779	0,01%	Selic	09-jan-18	0,00%	0,00%	ATLANTIDA FI MULT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	7.811.618	5,09%	Selic	02-jan-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	80.480	0,05%	Selic	12-jan-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	30.180	0,02%	Selic	15-jan-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	15.090	0,01%	Selic	16-jan-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	9.272.935	6,05%	Selic	03-jan-18	0,00%	0,00%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2018-08-15	15-ago-18	1.017.901	0,66%	IPCA	05-jan-18	3,36%	3,07%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2018-08-15	15-ago-18	501.183	0,33%	IPCA	05-jan-18	3,36%	3,07%	TORRES FI MULT
NTN-B 2018-08-15	15-ago-18	39.964	0,03%	IPCA	29-jan-18	2,66%	2,70%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2019-05-15	15-mai-19	1.198.613	0,78%	IPCA	05-jan-18	2,63%	2,54%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2019-05-15	15-mai-19	590.932	0,39%	IPCA	05-jan-18	2,63%	2,54%	TORRES FI MULT
NTN-B 2019-05-15	15-mai-19	47.470	0,03%	IPCA	29-jan-18	2,56%	2,60%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2020-08-15	15-ago-20	1.017.422	0,66%	IPCA	05-jan-18	3,76%	3,75%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2020-08-15	15-ago-20	499.956	0,33%	IPCA	05-jan-18	3,76%	3,75%	TORRES FI MULT
NTN-B 2020-08-15	15-ago-20	38.851	0,03%	IPCA	29-jan-18	3,74%	3,77%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	1.578.843	1,03%	IPCA	18-jan-18	4,12%	4,13%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	1.331.468	0,87%	IPCA	18-jan-18	4,12%	4,13%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	1.179.506	0,77%	IPCA	05-jan-18	4,14%	4,10%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	1.098.326	0,72%	IPCA	18-jan-18	4,12%	4,13%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	894.535	0,58%	IPCA	29-jan-18	4,07%	4,11%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	894.535	0,58%	IPCA	29-jan-18	4,08%	4,11%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	894.535	0,58%	IPCA	29-jan-18	4,07%	4,11%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	578.224	0,38%	IPCA	05-jan-18	4,14%	4,10%	TORRES FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	406.482	0,27%	IPCA	29-jan-18	4,07%	4,11%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	406.482	0,27%	IPCA	29-jan-18	4,07%	4,11%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	406.482	0,27%	IPCA	29-jan-18	4,08%	4,11%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	43.329	0,03%	IPCA	29-jan-18	4,08%	4,11%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	24.072	0,02%	IPCA	17-jan-18	4,11%	4,12%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	12.303	0,01%	IPCA	17-jan-18	4,11%	4,12%	TORRES FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.180.822	0,77%	IPCA	05-jan-18	4,53%	4,48%	TORRES FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	937.490	0,61%	IPCA	05-jan-18	4,53%	4,48%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	76.079	0,05%	IPCA	29-jan-18	4,42%	4,44%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	66.262	0,04%	IPCA	17-jan-18	4,51%	4,51%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	12.271	0,01%	IPCA	19-jan-18	4,52%	4,51%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	7.167	0,00%	IPCA	17-jan-18	4,51%	4,51%	TORRES FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	2.744.624	1,79%	IPCA	05-jan-18	4,73%	4,71%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	2.452.192	1,60%	IPCA	17-jan-18	4,62%	4,66%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.372.312	0,89%	IPCA	10-jan-18	4,71%	4,69%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.372.312	0,89%	IPCA	10-jan-18	4,71%	4,69%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.342.056	0,87%	IPCA	12-jan-18	4,67%	4,66%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	672.109	0,44%	IPCA	12-jan-18	4,68%	4,66%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	377.260	0,25%	IPCA	05-jan-18	4,73%	4,71%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	198.304	0,13%	IPCA	12-jan-18	4,67%	4,66%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	188.630	0,12%	IPCA	10-jan-18	4,71%	4,69%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	188.630	0,12%	IPCA	10-jan-18	4,71%	4,69%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	98.346	0,06%	IPCA	12-jan-18	4,68%	4,66%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	162.998	0,11%	IPCA	29-jan-18	5,06%	5,08%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	78.699	0,05%	IPCA	29-jan-18	5,06%	5,08%	TORRES FI MULT

