

## RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

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	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*								
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M		
<b>Renda Fixa</b>	<b>6.964.808,91</b>	<b>100%</b>			<b>1,08%</b>	<b>2,40%</b>	<b>4,56%</b>	<b>1,08%</b>	<b>10,41%</b>				
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,63%	1,99%	3,81%	0,63%	6,92%	17,17%	34,84%		
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>499.029,74</b>	<b>7,17%</b>											
BRAM FI REF DI FEDERAL II	499.029,74	7,17%	BRADESCO	0%	0,01%	0,58%	1,69%	3,84%	0,58%	9,49%	24,69%	41,37%	
Benchmark:	CDI					0,58%	1,70%	3,84%	0,58%	9,40%	24,76%	41,44%	
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>6.465.779,17</b>	<b>92,86%</b>											
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.465.779,17	92,86%		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%	
<b>Total</b>	<b>6.963.129,28</b>	<b>100%</b>			<b>0,00%</b>	<b>1,08%</b>	<b>2,40%</b>	<b>4,56%</b>	<b>1,08%</b>	<b>10,41%</b>			
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.

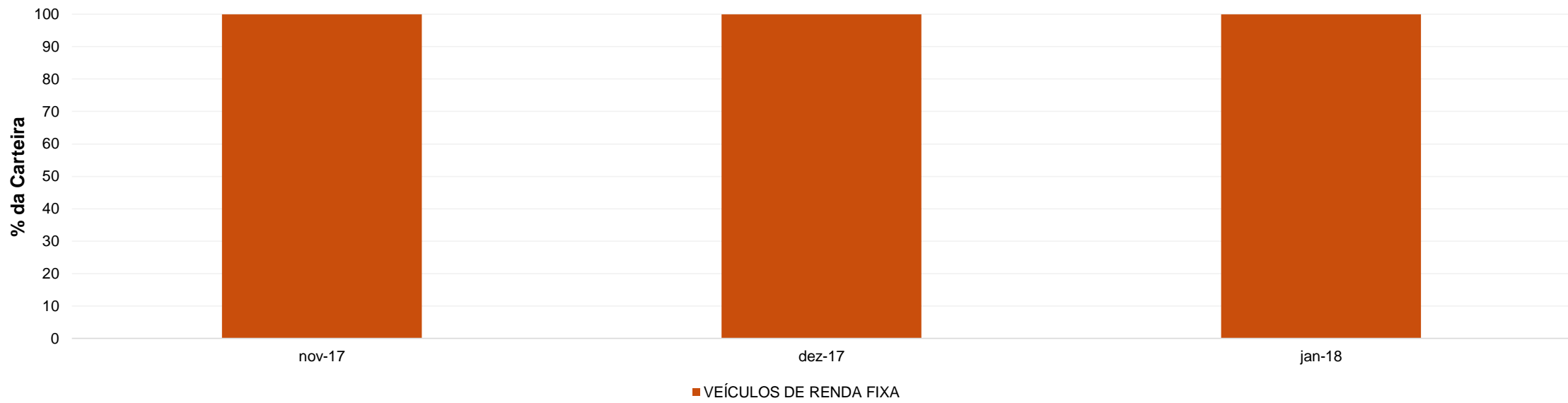
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

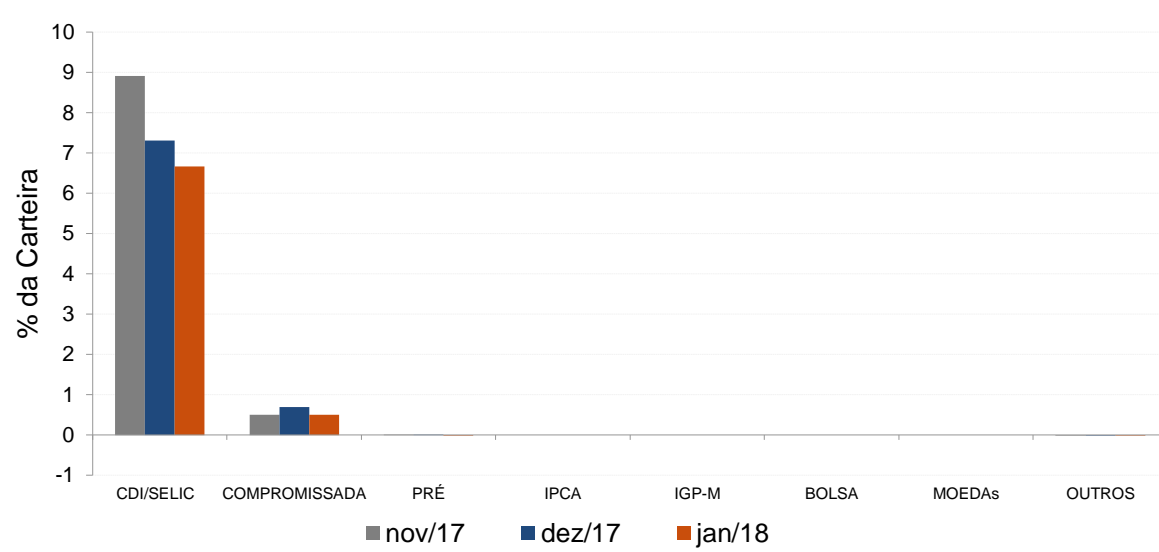
## Distribuição da Carteira

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.

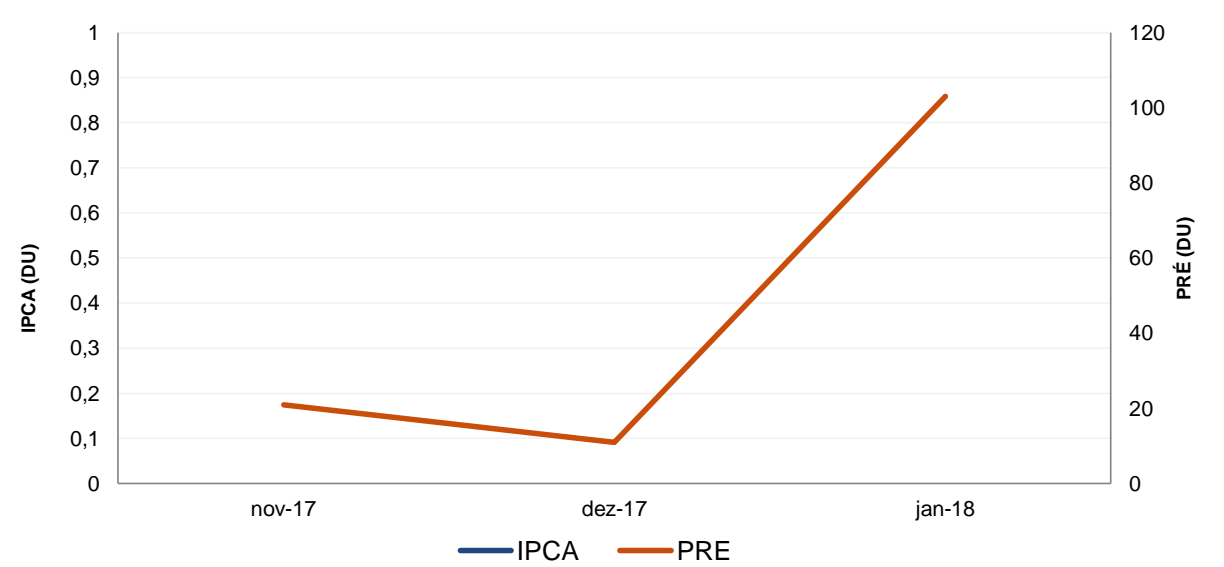
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 31/01/2018

## Análises de Contrapartes

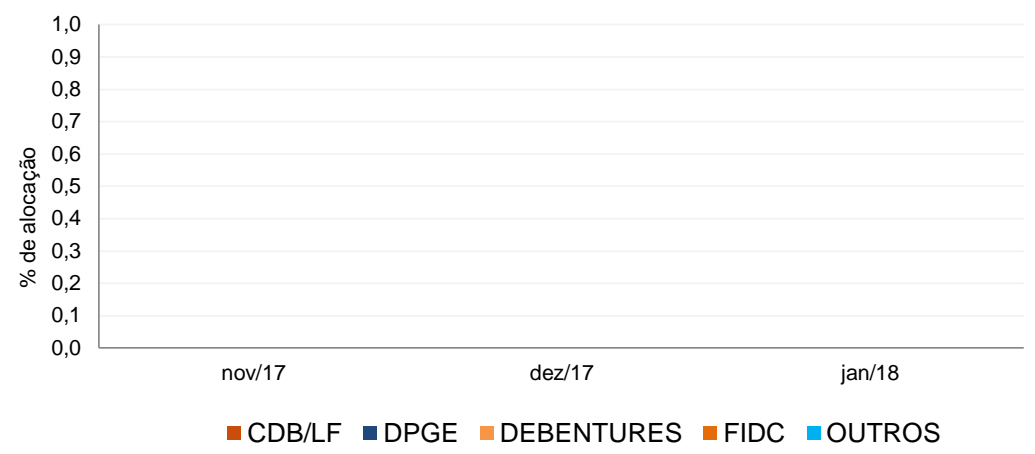
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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



**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. Ambima	Veículo
LFT 2018-03-01	01-mar-18	376	0,01%	Selic	17-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	4.656	0,07%	Selic	11-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	5.542	0,08%	Selic	22-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-03-01	01-mar-20	2	0,00%	Selic	04-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2020-09-01	01-set-20	554	0,01%	Selic	10-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	4.323	0,06%	Selic	11-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	6.650	0,10%	Selic	11-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	2.771	0,04%	Selic	26-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	831	0,01%	Selic	25-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	11	0,00%	Selic	02-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2.771	0,04%	Selic	11-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	2.771	0,04%	Selic	11-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.191	0,02%	Selic	29-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-03-01	01-mar-23	2.771	0,04%	Selic	11-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2023-09-01	01-set-23	89	0,00%	Selic	23-jan-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2.856	0,04%	Selic	19-jan-18	0,01%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2.337	0,03%	Selic	19-jan-18	0,01%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2.337	0,03%	Selic	19-jan-18	0,01%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II

