

RBSPREV - RBSPREV PGA

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	722.365,58	100,00%				0,54%	1,64%	3,77%	0,54%	9,28%	24,68%	41,50%	
Benchmark:	CDI					0,58%	1,70%	3,84%	0,58%	9,40%	24,76%	41,44%	
RF CRÉDITO	571.050,78	79,05%											
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	571.050,78	79,05%	VOTORANTIM	0,09%	0,00%	0,59%	1,71%	3,97%	0,59%	9,66%	25,49%	42,88%	
Benchmark:	CDI					0,58%	1,70%	3,84%	0,58%	9,40%	24,76%	41,44%	
RF REFERENCIADO DI	151.314,80	20,95%											
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	151.314,80	20,95%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,57%	1,66%	3,77%	0,57%	9,35%	24,35%	40,78%	
Benchmark:	CDI					0,58%	1,70%	3,84%	0,58%	9,40%	24,76%	41,44%	
Total	722.365,58	100%				0,00%	0,54%	1,64%	3,77%	0,54%	9,28%	24,68%	41,50%
Benchmark:	CDI					0,58%	1,70%	3,84%	0,58%	9,40%	24,76%	41,44%	

* 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.

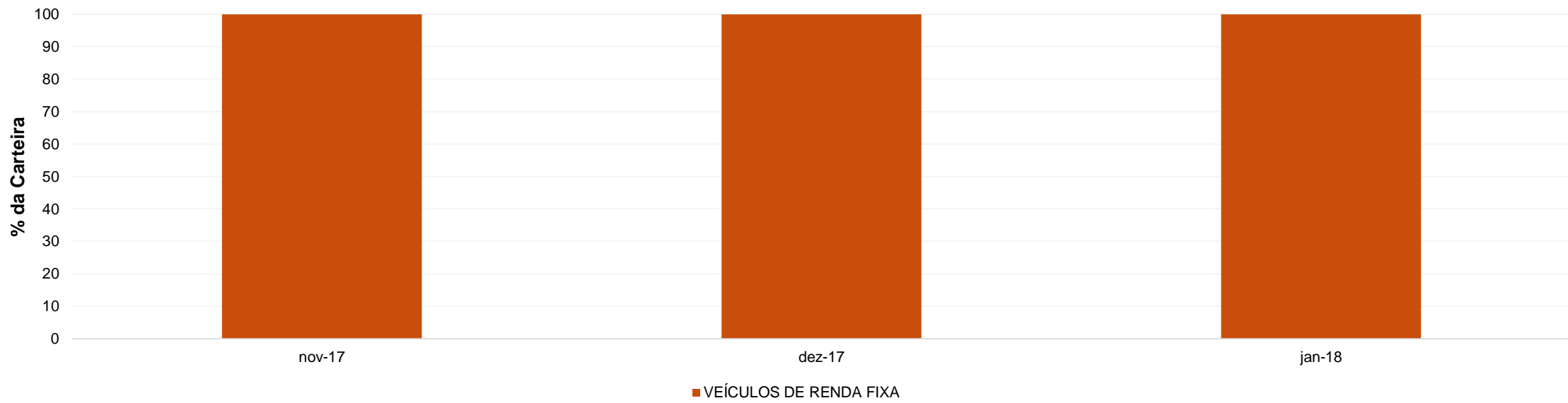


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma. Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se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

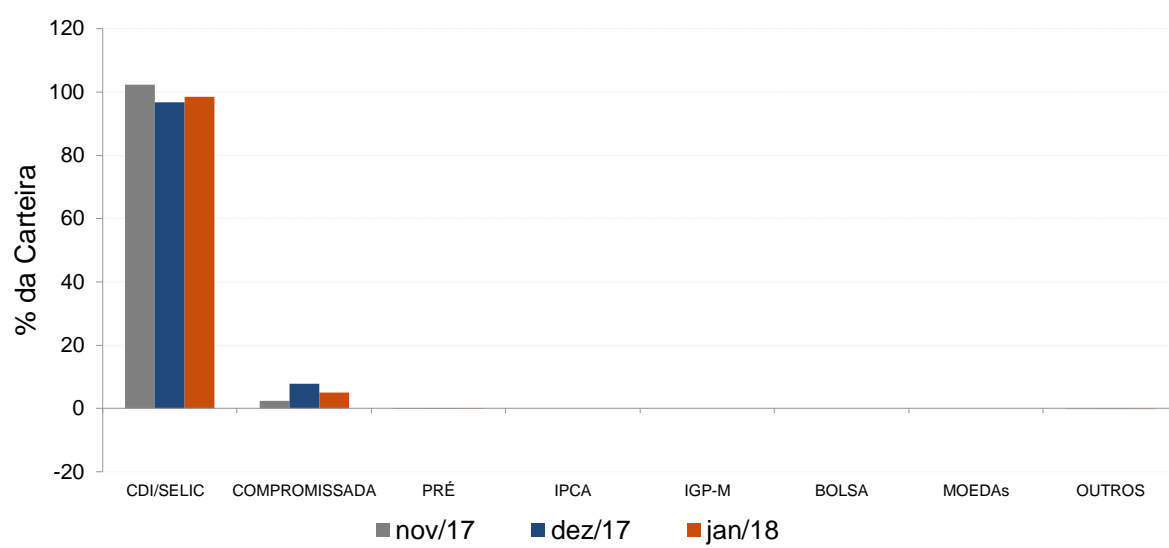
Distribuição da Carteira

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.

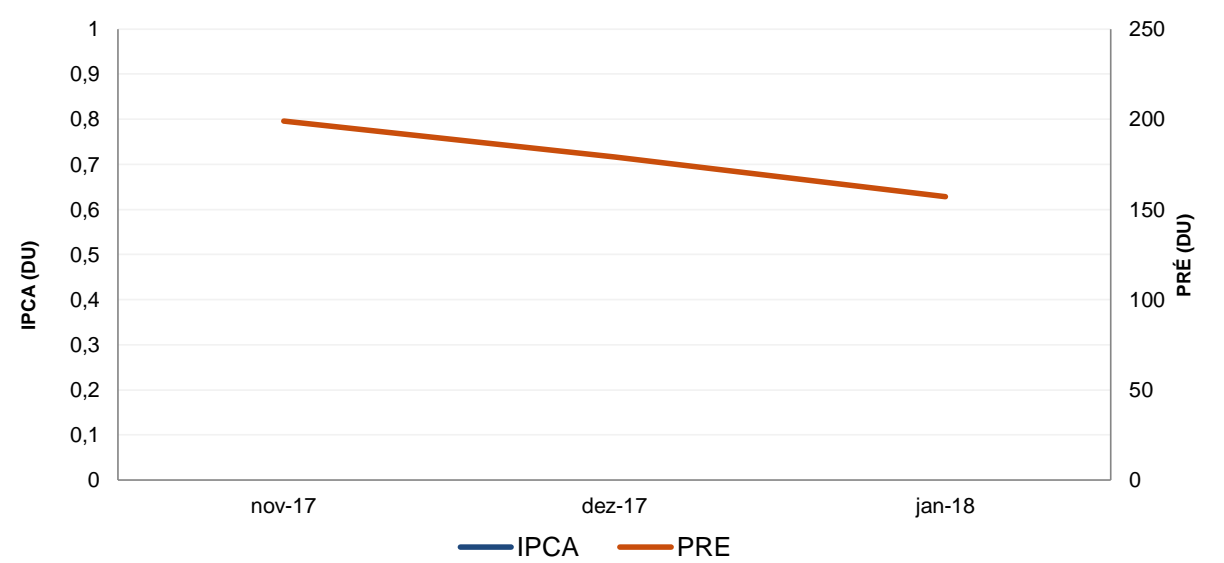
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 31/01/2018

Análises de Contrapartes

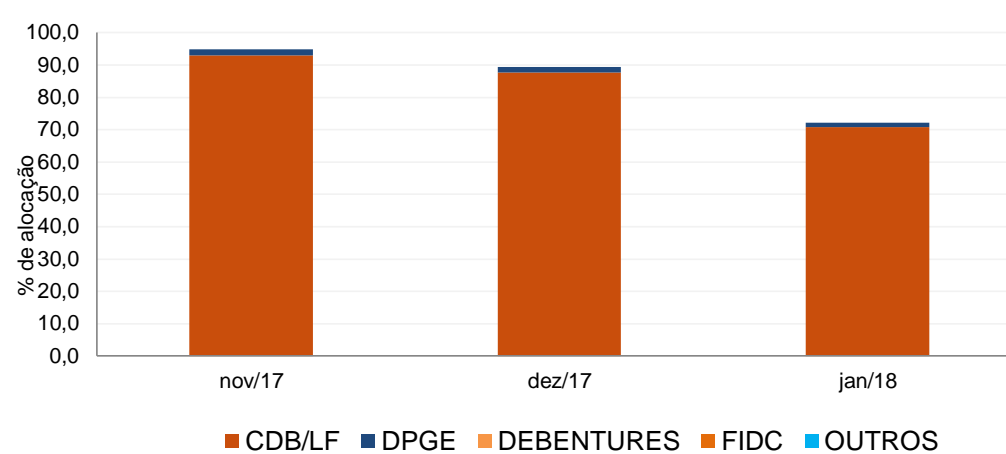
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	108,27	15,10			brAA-
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM	72,21	10,07	AA+ (bra)	Aa2.br	brAA-
BCO VOTORANTIM SA	68,42	9,54		Aa3.br	brAA-
BCO SAFRA SA	48,83	6,81		Aa1.br	brAA-
BCO TOYOTA BRASIL SA	48,33	6,74			brAA-
BCO BRADESCO SA	34,02	4,74	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL IN\	31,25	4,36	AA (bra)	Aa1.br	
BCO GMAC SA	27,11	3,78	AAA (bra)	Aa2.br	
BCO VOLKSWAGEN SA	25,58	3,57			brAA-
BCO CITIBANK SA	18,00	2,51			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: 31/01/2018

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. Ambima	Veículo
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4.920	0,69%	Selic	05-jan-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-03-01	01-mar-18	4.262	0,59%	Selic	16-jan-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	5.358	0,75%	Selic	09-jan-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2018-09-01	01-set-18	1.878	0,26%	Selic	02-jan-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	190	0,03%	Selic	12-jan-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-03-01	01-mar-22	509	0,07%	Selic	12-jan-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	648	0,09%	Selic	12-jan-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-03-01	01-mar-23	273	0,04%	Selic	12-jan-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	265	0,04%	Selic	12-jan-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	878	0,12%	Selic	19-jan-18	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	718	0,10%	Selic	19-jan-18	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2024-03-01	01-mar-24	718	0,10%	Selic	19-jan-18	0,01%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

