

## RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/06/2018

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>6.964.766,39</b>	<b>100,03%</b>			<b>1,37%</b>	<b>2,63%</b>	<b>4,76%</b>	<b>4,76%</b>	<b>8,89%</b>	<b>21,89%</b>		
Benchmark:	CDI				0,52%	1,56%	3,18%	3,18%	7,37%	21,18%	38,26%	
<b>CARTEIRA PRÓPRIA MM</b>	<b>6.546.252,34</b>	<b>94,02%</b>										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	6.546.252,34	94,02%		100%	1,43%	2,88%	5,52%	5,52%	10,40%	23,40%	-	
Benchmark:	CDI				0,52%	1,56%	3,18%	3,18%	7,37%	21,18%	38,26%	
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>418.514,05</b>	<b>6,01%</b>										
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	418.514,05	6,01%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,51%	1,54%	3,13%	3,13%	7,34%	21,15%	38,13%
Benchmark:	CDI				0,52%	1,56%	3,18%	3,18%	7,37%	21,18%	38,26%	
<b>Total</b>	<b>6.962.973,77</b>	<b>100%</b>			<b>0,00%</b>	<b>1,37%</b>	<b>2,80%</b>	<b>4,93%</b>	<b>4,93%</b>	<b>9,07%</b>	<b>22,08%</b>	
Benchmark:	CDI				0,52%	1,56%	3,18%	3,18%	7,37%	21,18%	38,26%	

\* 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.

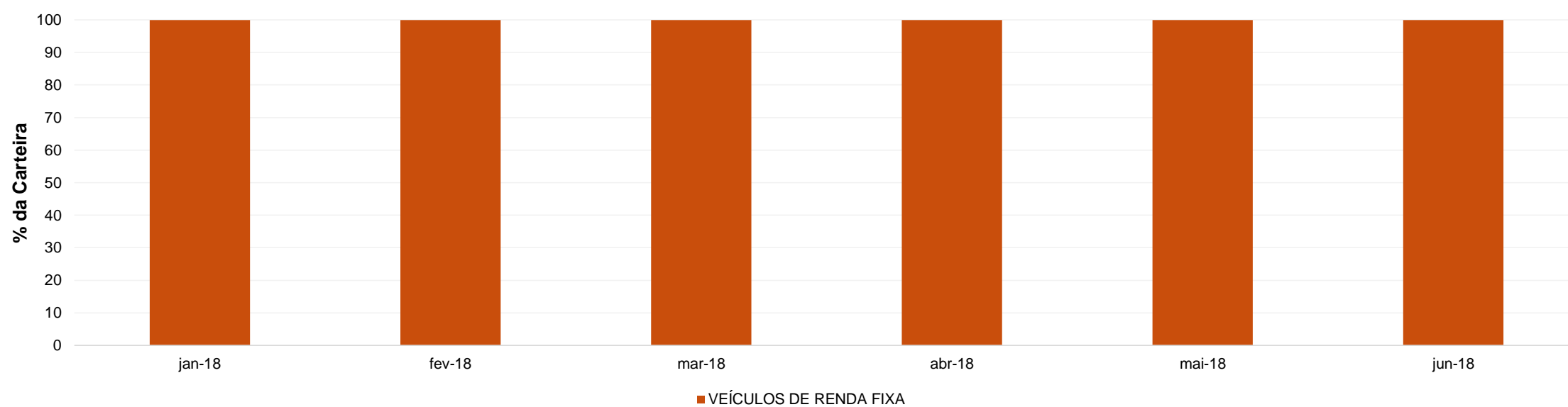
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

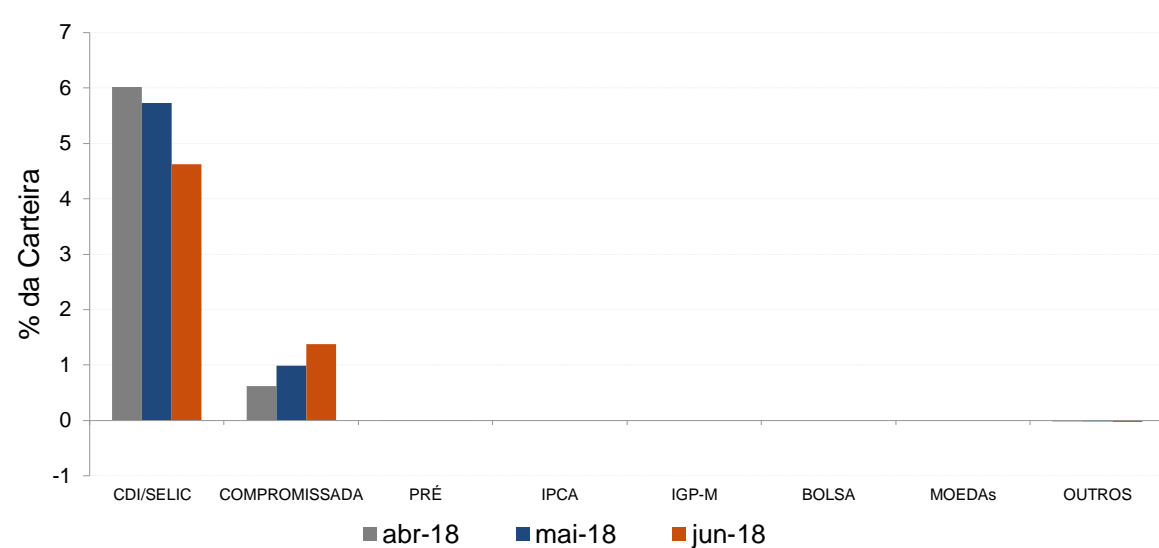
## Distribuição da Carteira

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.

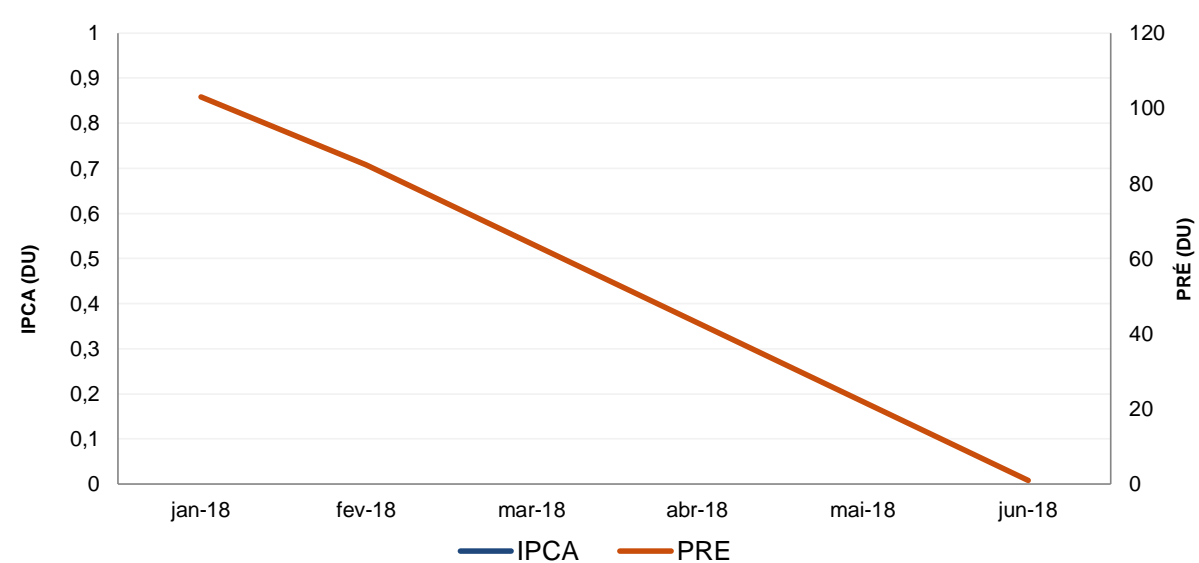
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/06/2018

## Análises de Contrapartes

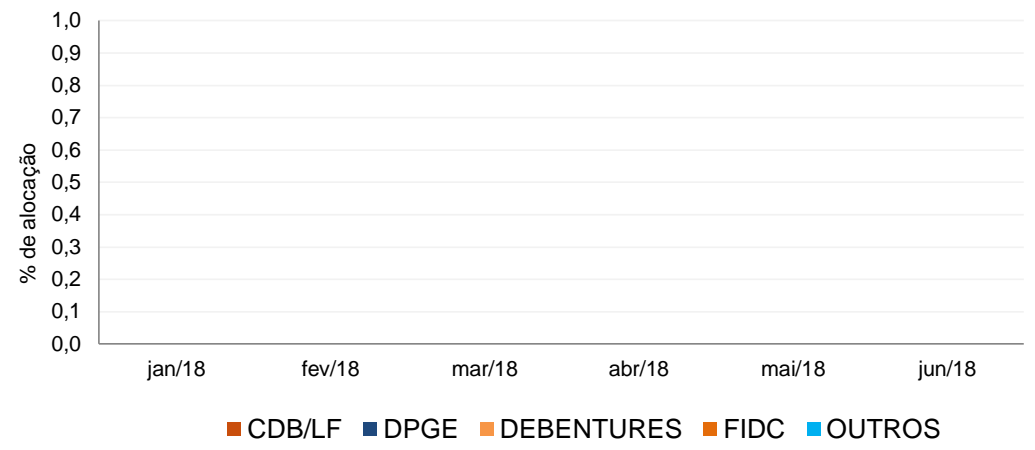
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/06/2018

## 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. Anbima	Veículo
LFT 2021-03-01	01-mar-21	1.372	0,02%	Selic	29-jun-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II
LFT 2022-03-01	01-mar-22	457	0,01%	Selic	18-jun-18	0,01%	0,01%	BRAM FI RF REF DI FEDERAL II

