

RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

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	
Renda Fixa	6.469.224,02	100,01%											
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					1,62%	2,97%	4,77%	4,77%	8,86%	16,96%	32,81%	
Renda Fixa CDI	6.469.224,02	#####			0,05%	0,56%	1,65%	3,24%	3,24%	7,58%	21,89%		
BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV	2.708.087,82	41,87%	BTG PACTUAL	0,10%	0,07%	0,62%	1,78%	3,66%	3,66%	8,43%	25,68%	44,04%	
ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	30.465,77	0,47%	ITAU	0,00%	0,00%	0,51%	1,53%	3,10%	3,10%	7,22%	21,07%	38,26%	
FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV	3.730.670,44	57,68%	VOTORANTIM	0,35%	0,03%	0,52%	1,56%	3,15%	3,15%	7,48%	22,05%	39,39%	
Benchmark:	CDI					0,52%	1,56%	3,18%	3,18%	7,37%	21,18%	38,26%	
Total	6.468.277,81	100%			0,05%	0,54%	1,60%	3,14%	3,14%	7,49%	21,78%		
Benchmark:	IPCA + 4.33% a.a.					1,62%	2,97%	4,77%	4,77%	8,86%	16,96%	32,81%	

* 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.

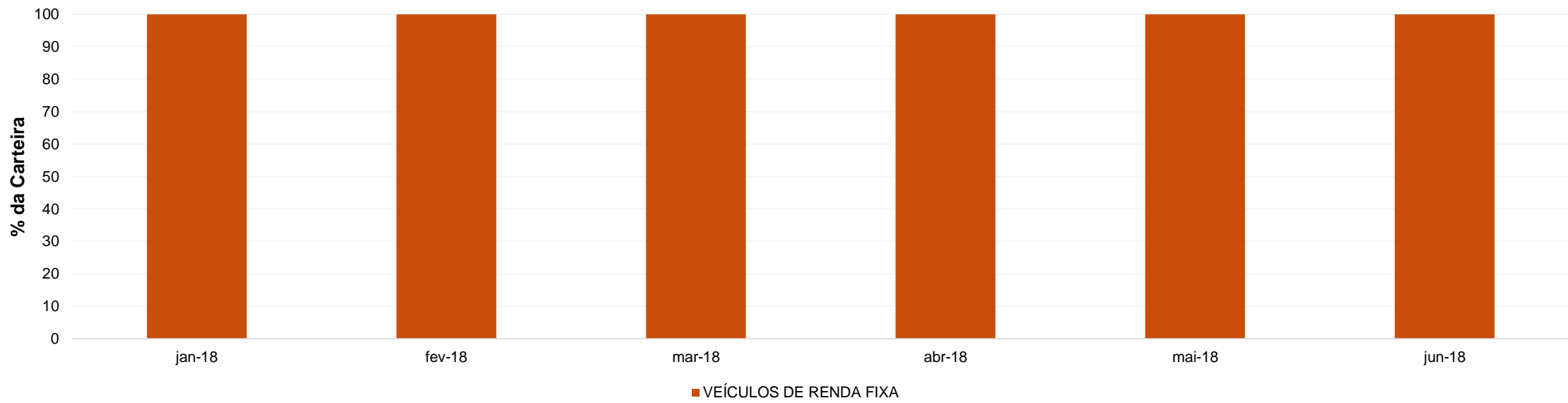


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.
A ADITUS não se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

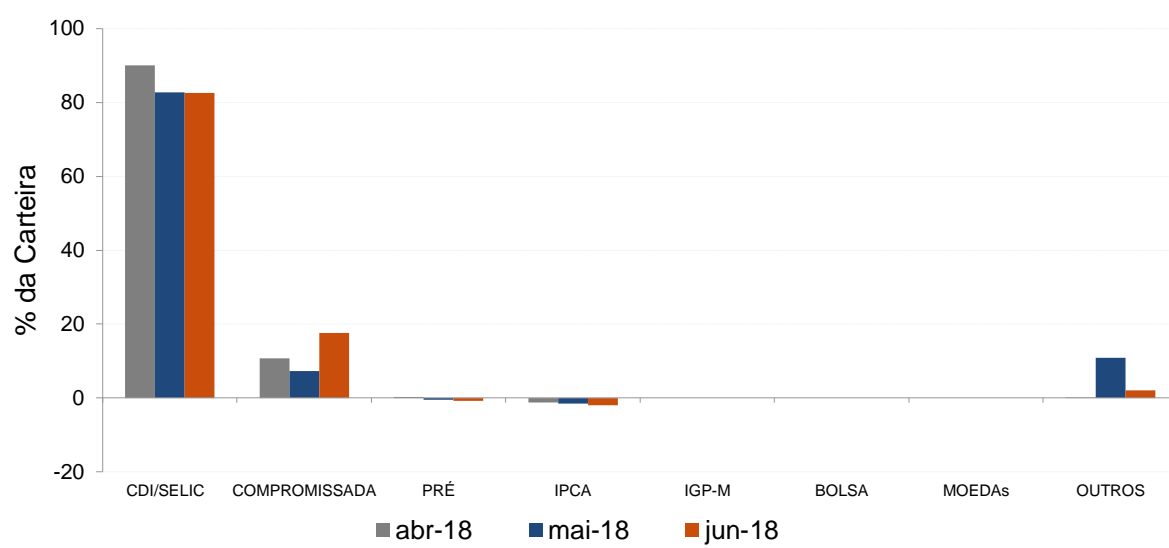
Distribuição da Carteira

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.

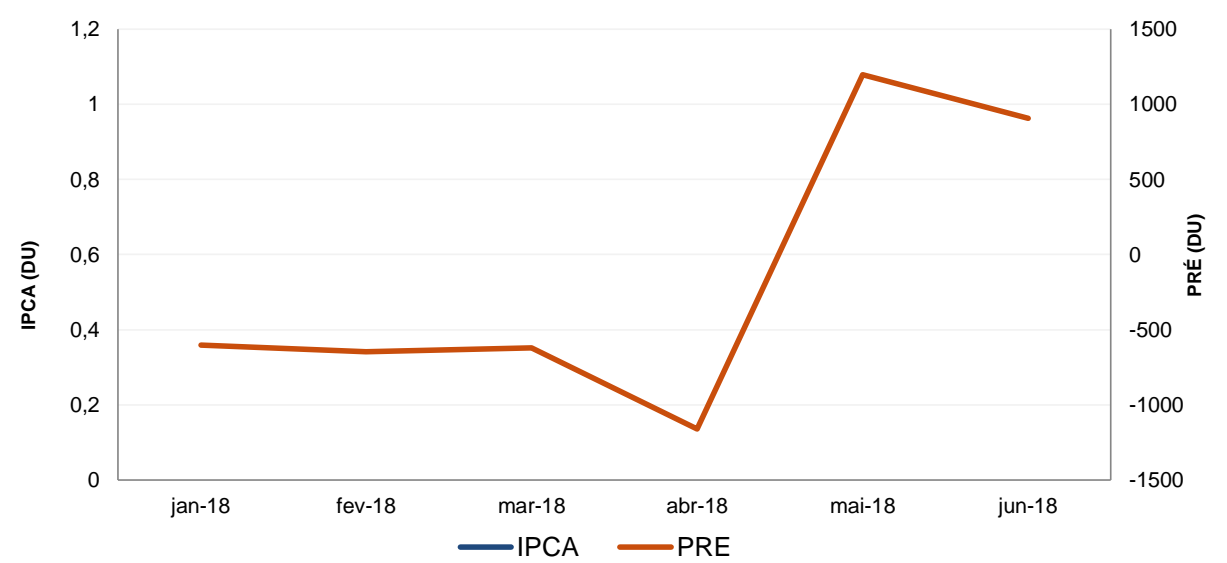
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

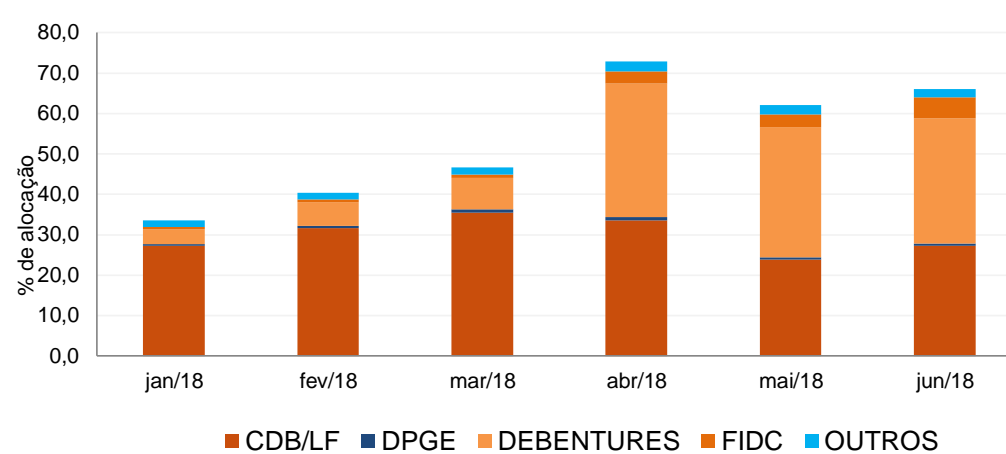
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO VOTORANTIM SA	443,15	6,81		Aa3.br	brAA-
BCO SAFRA SA	355,28	5,46		Aa1.br	brAA-
BCO BRASIL SA	197,40	3,03	AA (bra)	Aa1.br	
BCO ITAU SA	156,32	2,40	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO VOLKSWAGEN SA	130,35	2,00			brAA-
LOJAS AMERICANAS SA	106,26	1,63	AA (bra)		
RIOLOAN 2 COMPANHIA SECURITIZADO	98,69	1,52			
CENTRAIS ELETRICAS PARA SA CELPA	98,03	1,51	AA- (bra)		brAA-
LOCALIZA RENT A CAR SA	94,86	1,46	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ES1	84,49	1,30	AA (bra)	Aa2.br	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
LLIS18	0,38	RESTOQUE COMERCIO CONFECOES ROUPAS	Novo	A- (bra)	Fitch	20-jun-21	CDI	2,30%	BTG PAC CRED CORP INS FI RF CRED
LLIS18	8,18	RESTOQUE COMERCIO CONFECOES ROUPAS	Novo	A- (bra)	Fitch	20-jun-21	CDI	2,30%	BTG PACTUAL CRED CORP FI RF CREI



