

RBSPREV - RBSPREV PGA

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	738.769,53	100,06%				0,40%	1,25%	2,77%	2,77%	6,90%	20,65%	37,79%	
Benchmark:	CDI					0,52%	1,56%	3,18%	3,18%	7,37%	21,18%	38,26%	
RF CRÉDITO	585.521,15	79,30%											
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	585.521,15	79,30%	VOTORANTIM	0,17%	0,00%	0,51%	1,54%	3,14%	3,14%	7,48%	21,69%	39,29%	
Benchmark:	CDI					0,52%	1,56%	3,18%	3,18%	7,37%	21,18%	38,26%	
RF REFERENCIADO DI	153.248,38	20,76%											
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	153.248,38	20,76%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,50%	1,50%	3,07%	3,07%	7,21%	20,84%	37,55%	
Benchmark:	CDI					0,52%	1,56%	3,18%	3,18%	7,37%	21,18%	38,26%	
Total	738.340,41	100%				0,00%	0,40%	1,25%	2,77%	2,77%	6,90%	20,65%	37,79%
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.

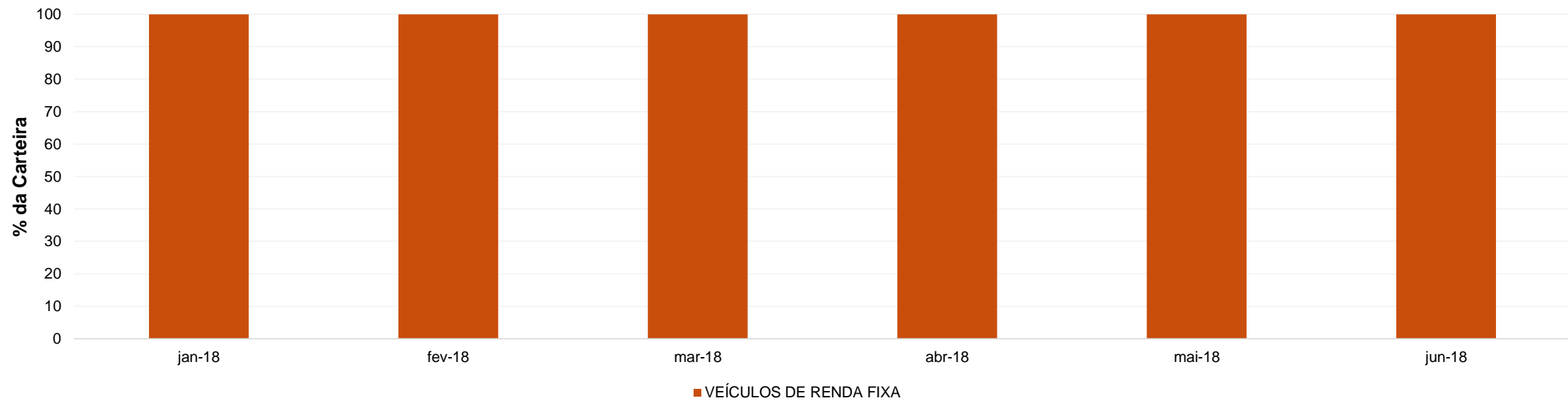


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma. Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se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

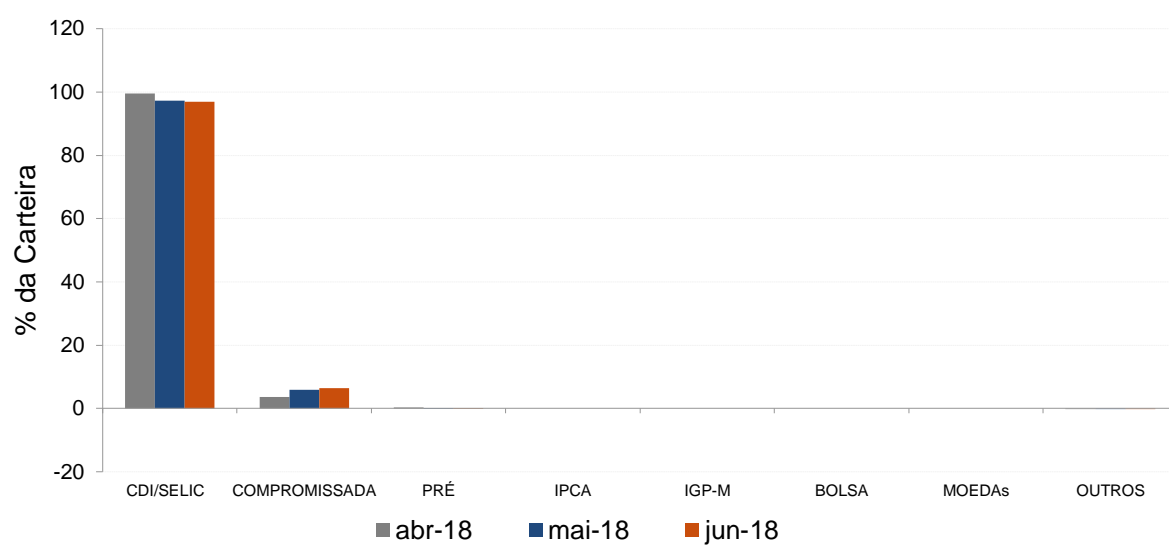
Distribuição da Carteira

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.

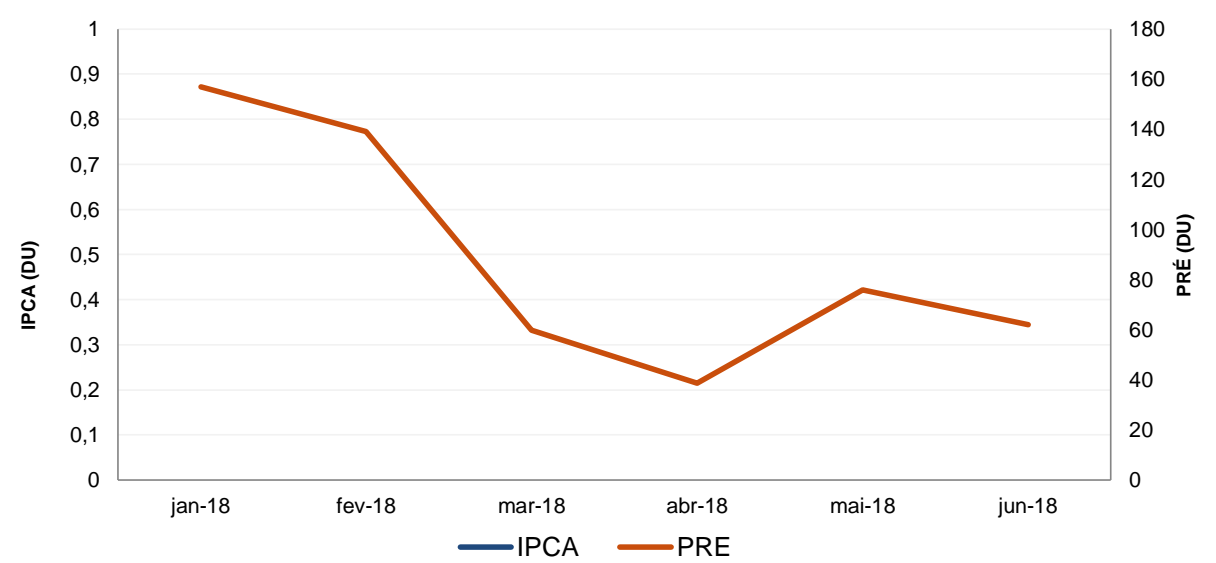
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

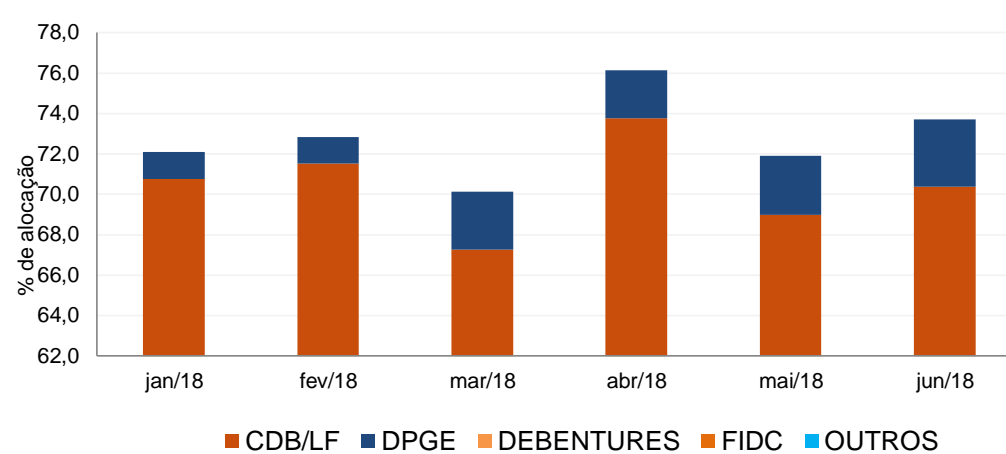
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM	101,29	13,16	AAA (bra)	Aa2.br	brAA-
BCO SAFRA SA	95,66	12,43		Aa1.br	brAA-
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	82,57	10,73			brAA-
BCO VOTORANTIM SA	70,40	9,15		Aa3.br	brAA-
BCO BRADESCO SA	56,16	7,30	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL IN\	50,37	6,54	AA (bra)	Aa1.br	
BCO VOLKSWAGEN SA	25,83	3,36			brAA-
BCO BBM SA	20,13	2,62	AAA (bra)	Aaa.br	
BCO TOYOTA BRASIL SA	18,98	2,47			brAA-
BCO GMAC SA	15,99	2,08	AAA (bra)		

* 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: 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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Rating	Agência	Veículo
CDB PRE	01-nov-18	362	0,05%	PRE	BCO ITAU SA	05-jun-18	6,39%	brAA-	S&P	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2024-03-01	01-mar-24	20.405	2,65%	Selic		20-jun-18	32,47%	0,00%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV

