

## RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/05/2018

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>6.918.880,86</b>	<b>100,02%</b>				<b>0,73%</b>	<b>1,78%</b>	<b>4,10%</b>	<b>3,35%</b>	<b>9,14%</b>	<b>21,83%</b>	
Benchmark:	CDI					0,52%	1,58%	3,20%	2,64%	7,68%	21,96%	39,01%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA MM</b>	<b>6.454.099,75</b>	<b>93,30%</b>										
RBS PREV CONSERVADOR VITALICIO CARTEIRA PR	6.454.099,75	93,30%		100%		0,74%	2,19%	4,82%	4,04%	10,67%	23,16%	-
Benchmark:	CDI					0,52%	1,58%	3,20%	2,64%	7,68%	21,96%	39,01%
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>464.781,11</b>	<b>6,72%</b>										
BRAM FI RF REF DI FEDERAL II	464.781,11	6,72%	BRADESCO	0,01%	0,01%	0,50%	1,55%	3,16%	2,61%	7,71%	21,93%	38,88%
Benchmark:	CDI					0,52%	1,58%	3,20%	2,64%	7,68%	21,96%	39,01%
<b>Total</b>	<b>6.917.448,46</b>	<b>100%</b>				<b>0,00%</b>	<b>0,73%</b>	<b>1,94%</b>	<b>4,27%</b>	<b>3,51%</b>	<b>9,31%</b>	<b>22,02%</b>
Benchmark:	CDI					0,52%	1,58%	3,20%	2,64%	7,68%	21,96%	39,01%

\* 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.

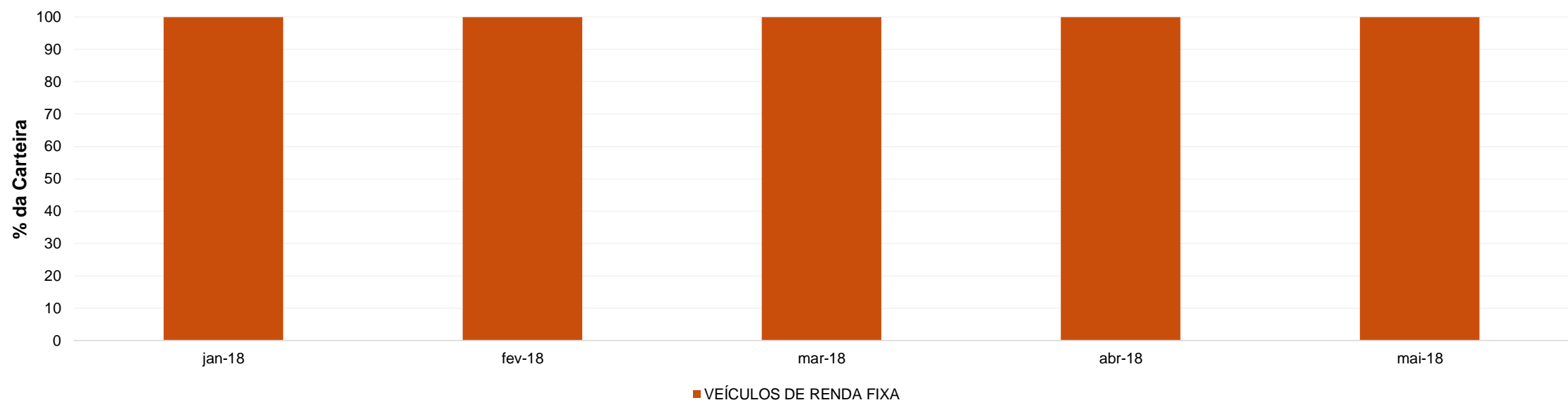


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.  
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.  
A ADITUS não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

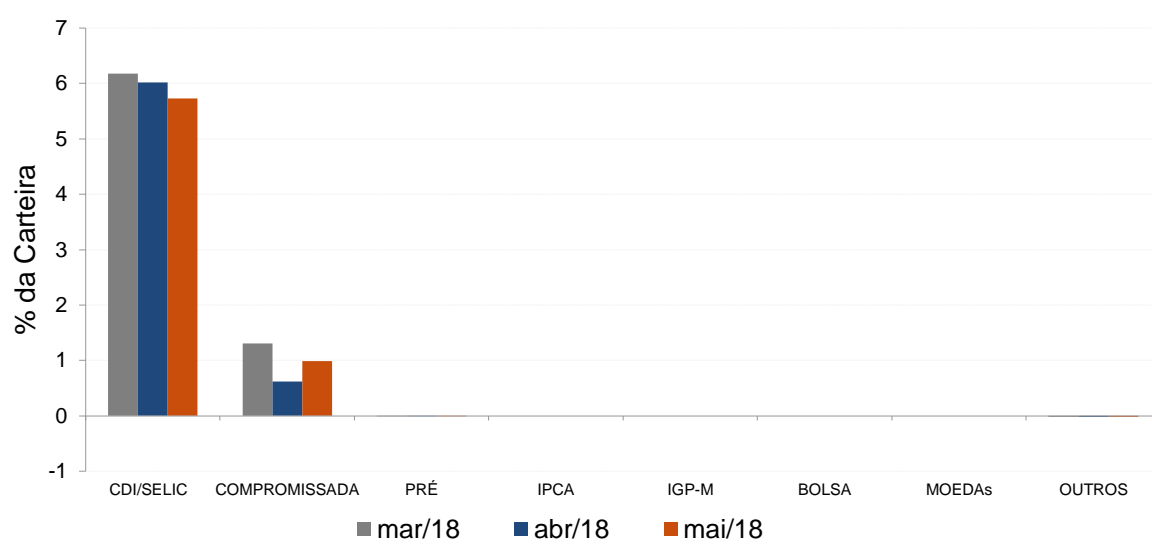
## Distribuição da Carteira

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.

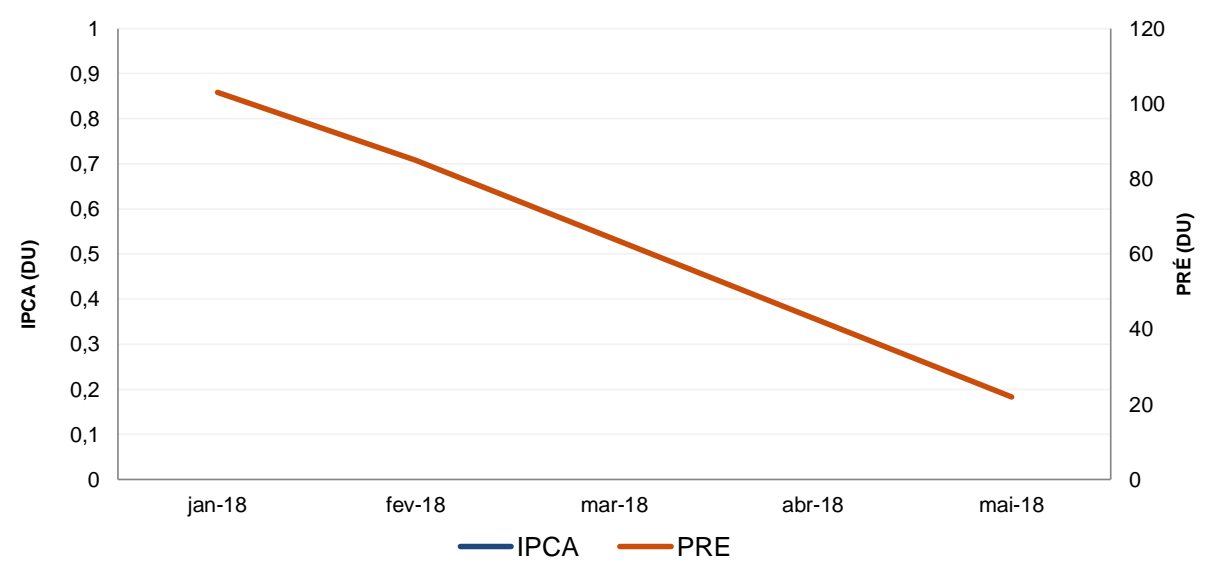
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 30/05/2018

## Análises de Contrapartes

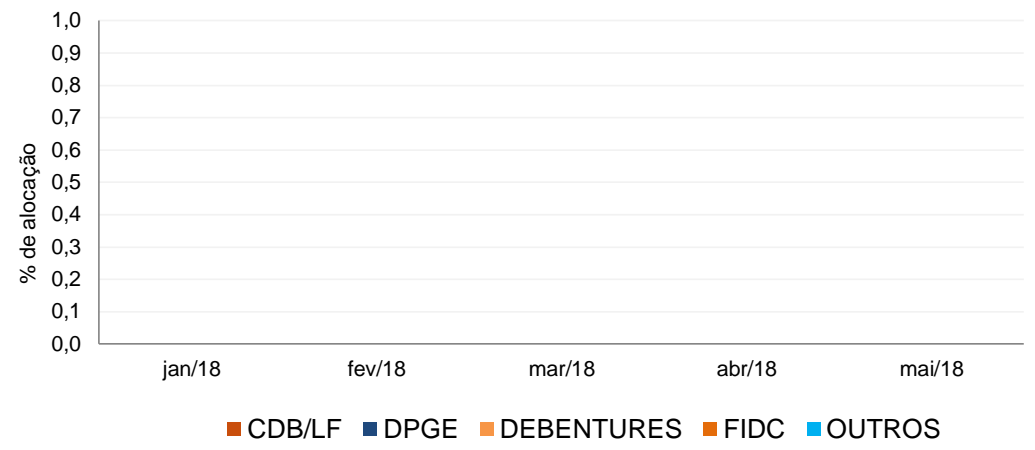
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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: 30/05/2018

**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.

Nenhuma operação feita no último mês.

