

RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

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 | |
| Renda Fixa | 6.475.181,42 | 100,01% | | | | | | | | | | | |
| Benchmark: | IPCA + 4.33% a.a. | | | | | 0,76% | 1,78% | 3,90% | 3,10% | 7,25% | 15,92% | 32,19% | |
| Renda Fixa CDI | 6.475.181,42 | 100,01% | | | 0,03% | 0,53% | 1,62% | 3,21% | 2,66% | 7,88% | 22,65% | | |
| BTG PACT CRE COR I FICFI RF CRED PRIV | 2.691.523,99 | 41,57% | BTG PACTUAL | 0,12% | 0,04% | 0,56% | 1,78% | 3,66% | 3,03% | 8,88% | 26,59% | 44,79% | |
| ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI | 49.319,67 | 0,76% | ITAU | 0,00% | 0,00% | 0,51% | 1,54% | 3,12% | 2,58% | 7,54% | 21,87% | 39,05% | |
| FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV | 3.734.337,77 | 57,68% | VOTORANTIM | 0,28% | 0,03% | 0,51% | 1,57% | 3,17% | 2,62% | 7,88% | 22,90% | 40,19% | |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,52% | 1,58% | 3,20% | 2,64% | 7,68% | 21,96% | 39,01% | |
| Total | 6.474.638,80 | 100% | | | 0,03% | 0,53% | 1,56% | 3,14% | 2,59% | 7,80% | 22,56% | | |
| Benchmark: | IPCA + 4.33% a.a. | | | | | 0,76% | 1,78% | 3,90% | 3,10% | 7,25% | 15,92% | 32,19% | |

* 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.

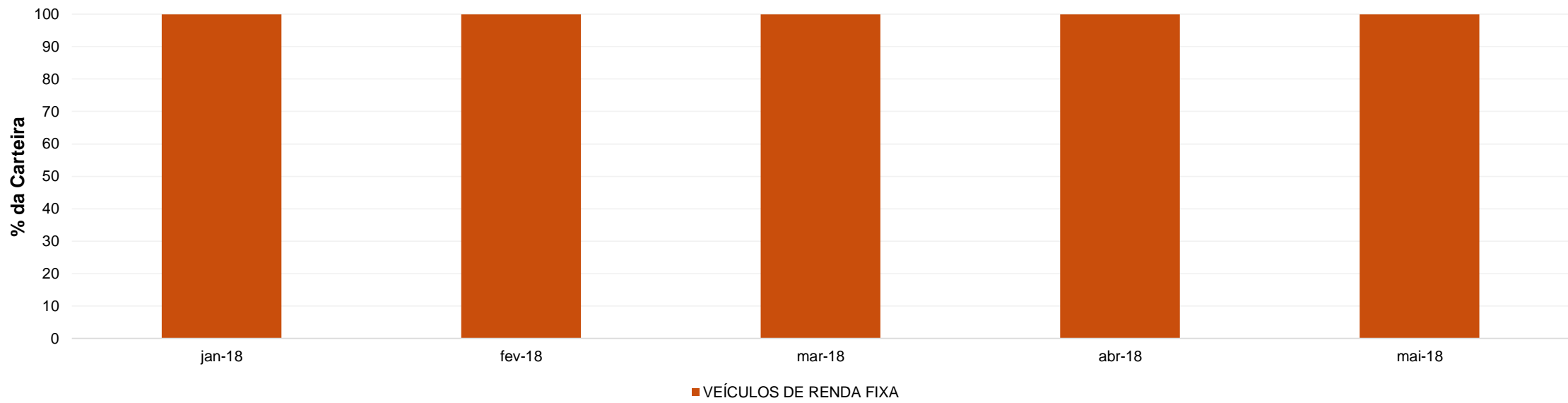


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.
A ADITUS não se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

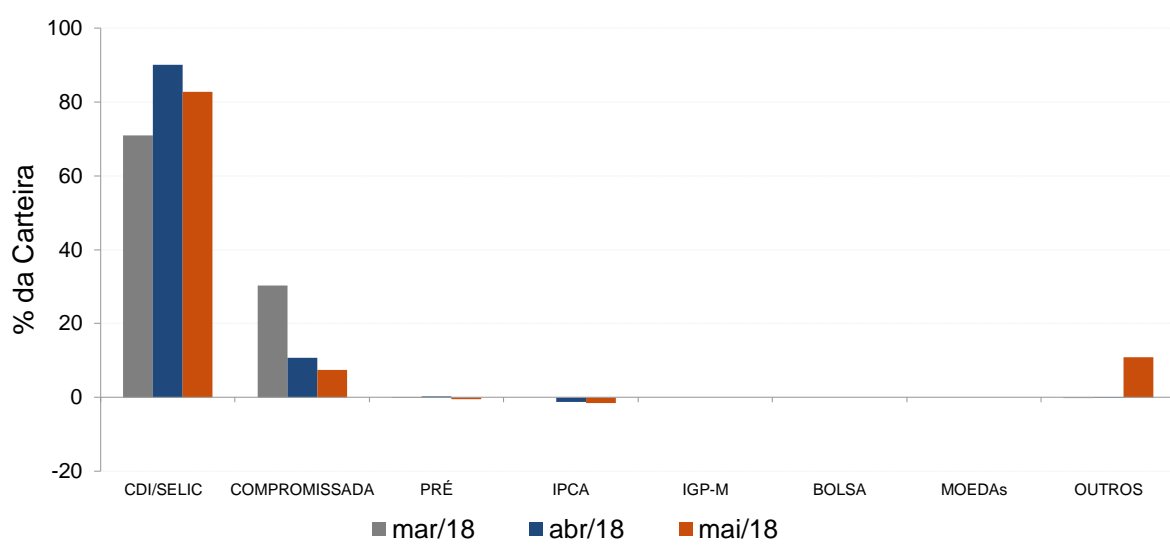
Distribuição da Carteira

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.

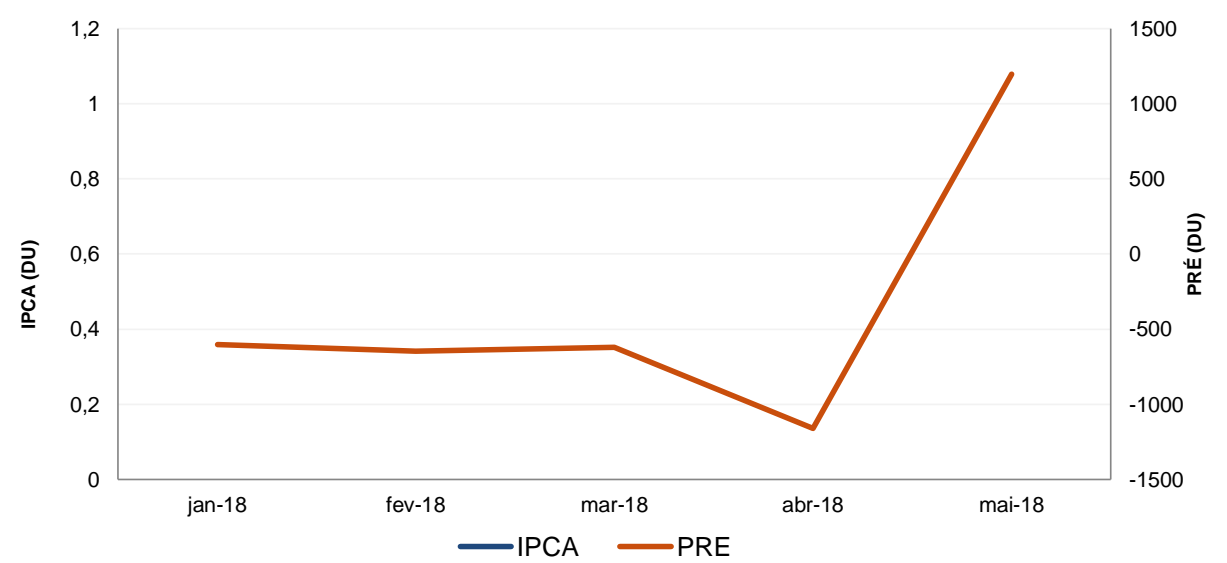
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

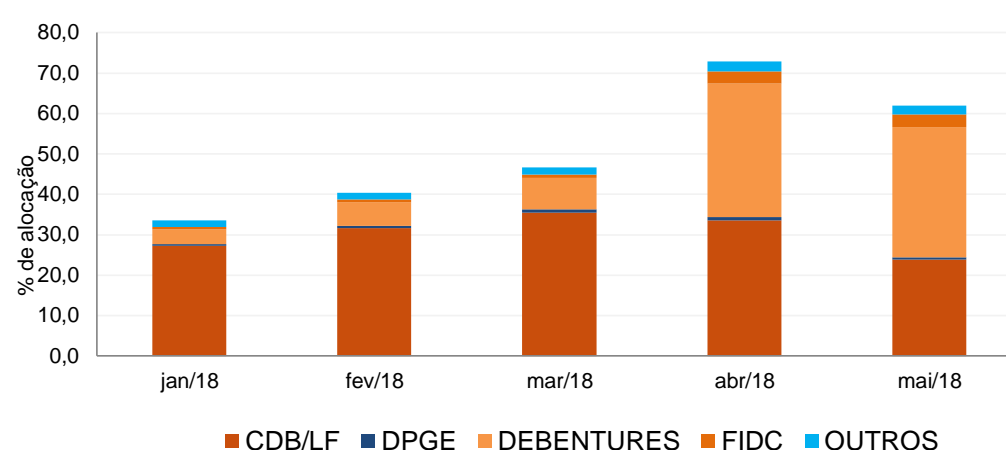
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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 | 455,33 | 6,99 | | Aa3.br | brAA- |
| BCO SAFRA SA | 328,19 | 5,04 | | Aa1.br | brAA- |
| BCO BRASIL SA | 157,44 | 2,42 | AA (bra) | Aa1.br | |
| LOJAS AMERICANAS SA | 130,44 | 2,00 | AA (bra) | | |
| BCO ITAU SA | 125,56 | 1,93 | AAA (bra) | Aa1.br | brAA- |
| CENTRAIS ELETRICAS PARA SA CELPA | 104,47 | 1,60 | AA- (bra) | | brAA- |
| BCO VOLKSWAGEN SA | 103,84 | 1,60 | | | brAA- |
| LOCALIZA RENT A CAR SA | 97,61 | 1,50 | AAA (bra) | Aa1.br | brAAA |
| COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ES1 | 94,07 | 1,44 | AA (bra) | Aa2.br | brAA- |
| AES TIETE ENERGIA SA | 92,68 | 1,42 | | Aa1.br | |

* 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 |
|------------------|-----------------|---|-----------|-----------|---------|-----------|--------|---------|-----------------------------------|
| ELSP19 | 12,32 | ELETROPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE | AA- (bra) | AA (bra) | Fitch | 20-ago-18 | CDI | 1,51% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| JSML36 | 0,01 | JSL SA | AA- (bra) | AA (bra) | Fitch | 15-jul-20 | IPCA | | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| JSML36 | 1,09 | JSL SA | AA- (bra) | AA (bra) | Fitch | 15-jul-20 | IPCA | 5,24% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| LAMEA2 | 0,46 | LOJAS AMERICANAS SA | Novo | AA (bra) | Fitch | 20-abr-23 | CDI | 116,00% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| LAMEA2 | 58,35 | LOJAS AMERICANAS SA | Novo | AA (bra) | Fitch | 20-abr-23 | CDI | 116,00% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| PETR35 | 43,25 | PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | AA+ (bra) | AA (bra) | Fitch | 15-ago-22 | CDI | 106,75% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| PETR35 | 5,82 | PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | AA+ (bra) | AA (bra) | Fitch | 15-ago-22 | CDI | 106,60% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| PETR35 | 14,56 | PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | AA+ (bra) | AA (bra) | Fitch | 15-ago-22 | CDI | 106,60% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| PETR35 | 0,35 | PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | AA+ (bra) | AA (bra) | Fitch | 15-ago-22 | CDI | 106,75% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| RADL12 | 0,02 | RAIA DROGASIL SA | Novo | AAA (bra) | Fitch | 02-abr-19 | CDI | 102,25% | ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI |
| RADL22 | 0,02 | RAIA DROGASIL SA | Novo | AAA (bra) | Fitch | 02-out-19 | CDI | 102,25% | ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI |
| RADL32 | 0,02 | RAIA DROGASIL SA | Novo | AAA (bra) | Fitch | 02-abr-20 | CDI | 102,75% | ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI |
| RADL42 | 0,02 | RAIA DROGASIL SA | Novo | AAA (bra) | Fitch | 02-out-20 | CDI | 103,00% | ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI |
| RILA11 | 0,15 | RIOLOAN 2 COMPANHIA SECURITIZADORA CREE | AA+ (bra) | AA (bra) | Fitch | 20-dez-20 | CDI | 130,00% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| RILA11 | 18,82 | RIOLOAN 2 COMPANHIA SECURITIZADORA CREE | AA+ (bra) | AA (bra) | Fitch | 20-dez-20 | CDI | 130,00% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| SSBR12 | 0,06 | SONAE SIERRA BRASIL SA | AA (bra) | AA+ (bra) | Fitch | 15-jul-22 | CDI | | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| SSBR12 | 0,19 | SONAE SIERRA BRASIL SA | AA (bra) | AA+ (bra) | Fitch | 15-jul-22 | CDI | 0,77% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| SSBR12 | 7,13 | SONAE SIERRA BRASIL SA | AA (bra) | AA+ (bra) | Fitch | 15-jul-22 | CDI | 0,75% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| SSBR22 | 0,13 | SONAE SIERRA BRASIL SA | AA (bra) | AA+ (bra) | Fitch | 15-jul-24 | IPCA | | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| SSBR22 | 14,53 | SONAE SIERRA BRASIL SA | AA (bra) | AA+ (bra) | Fitch | 15-jul-24 | IPCA | 5,79% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| SULM24 | 0,08 | SUL AMERICA SA | A+ (bra) | A (bra) | Fitch | 13-dez-21 | CDI | 114,00% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |
| SULM24 | 10,33 | SUL AMERICA SA | A+ (bra) | A (bra) | Fitch | 13-dez-21 | CDI | 114,00% | BTG PACTUAL CRED CORP INST FI RF |



RBSPREV - RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

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.

| Títulos Privados | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | Emissor | Data Compra | Tx de Compra | Rating | Agência | Veículo |
|------------------|------------|--------|-----------------|-----------|-----------------------------------|-------------|--------------|-----------|---------|-----------------------------------|
| CELP15 | 25-abr-23 | 5.465 | 0,08% | CDI | CENTRAIS ELETRICAS PARA SA CELPA | 17-mai-18 | 1,19% | AA- (bra) | Fitch | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| CELP25 | 25-abr-23 | 28.418 | 0,44% | CDI | CENTRAIS ELETRICAS PARA SA CELPA | 18-mai-18 | 1,57% | AA- (bra) | Fitch | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| RILA11 | 20-dez-20 | 66.116 | 1,02% | CDI | RIOLOAN 2 COMPANHIA SECURITIZADOR | 03-mai-18 | 130,00% | Rating | Agência | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |

| Títulos Públicos | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | | Data Compra | Tx de Compra | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|---------|-----------------|-----------|--|-------------|--------------|----------------|-----------------------------------|
| LFT 2020-03-01 | 01-mar-20 | 3.960 | 0,06% | Selic | | 30-mai-18 | 0,00% | 0,00% | ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 14.513 | 0,22% | Selic | | 29-mai-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2021-09-01 | 01-set-21 | 12.116 | 0,19% | Selic | | 29-mai-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2022-09-01 | 01-set-22 | 141.091 | 2,17% | Selic | | 21-mai-18 | 0,02% | 0,01% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 79.844 | 1,23% | Selic | | 28-mai-18 | 0,02% | 0,02% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 31.938 | 0,49% | Selic | | 28-mai-18 | 0,02% | 0,02% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |
| LFT 2023-03-01 | 01-mar-23 | 12.110 | 0,19% | Selic | | 29-mai-18 | 0,02% | 0,02% | FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV |

