

## RBSPREV - RBSPREV PGA

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>735.469,80</b>	<b>100,01%</b>				<b>0,45%</b>	<b>1,37%</b>	<b>2,91%</b>	<b>2,36%</b>	<b>7,33%</b>	<b>21,58%</b>	<b>38,72%</b>	
Benchmark:	CDI					0,52%	1,58%	3,20%	2,64%	7,68%	21,96%	39,01%	
<b>RF CRÉDITO</b>	<b>582.559,76</b>	<b>79,22%</b>											
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	582.559,76	79,22%	VOTORANTIM	0,15%	0,00%	0,51%	1,56%	3,18%	2,62%	7,82%	22,51%	40,12%	
Benchmark:	CDI					0,52%	1,58%	3,20%	2,64%	7,68%	21,96%	39,01%	
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>152.910,05</b>	<b>20,79%</b>											
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	152.910,05	20,79%	BRADESCO	0,00%	0,01%	0,49%	1,52%	3,09%	2,55%	7,59%	21,61%	38,31%	
Benchmark:	CDI					0,52%	1,58%	3,20%	2,64%	7,68%	21,96%	39,01%	
<b>Total</b>	<b>735.408,64</b>	<b>100%</b>				<b>0,00%</b>	<b>0,45%</b>	<b>1,37%</b>	<b>2,91%</b>	<b>2,36%</b>	<b>7,33%</b>	<b>21,58%</b>	<b>38,72%</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 relatório 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.

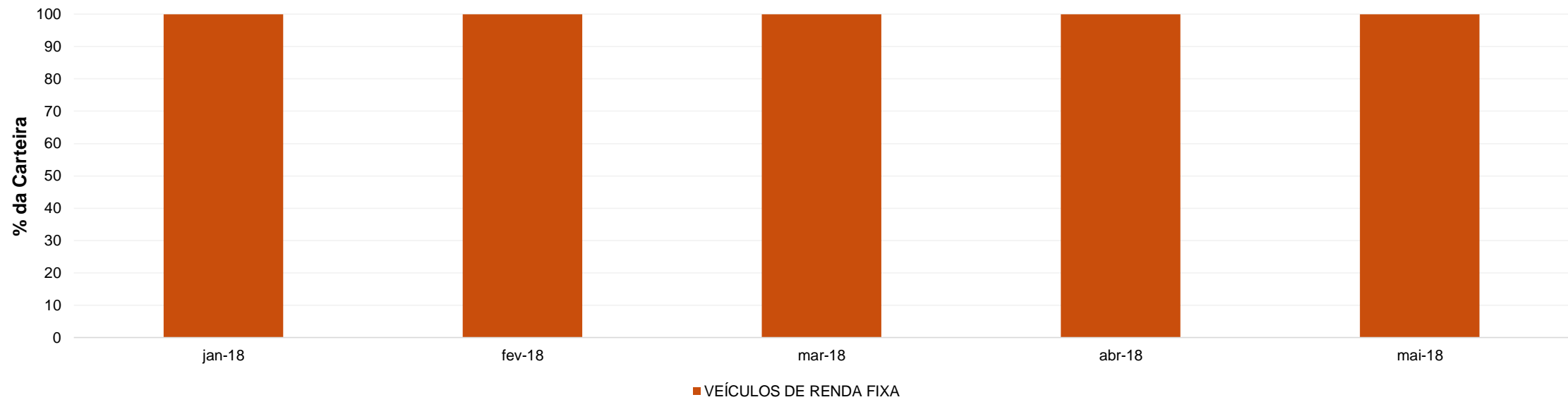


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.  
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.  
A ADITUS não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

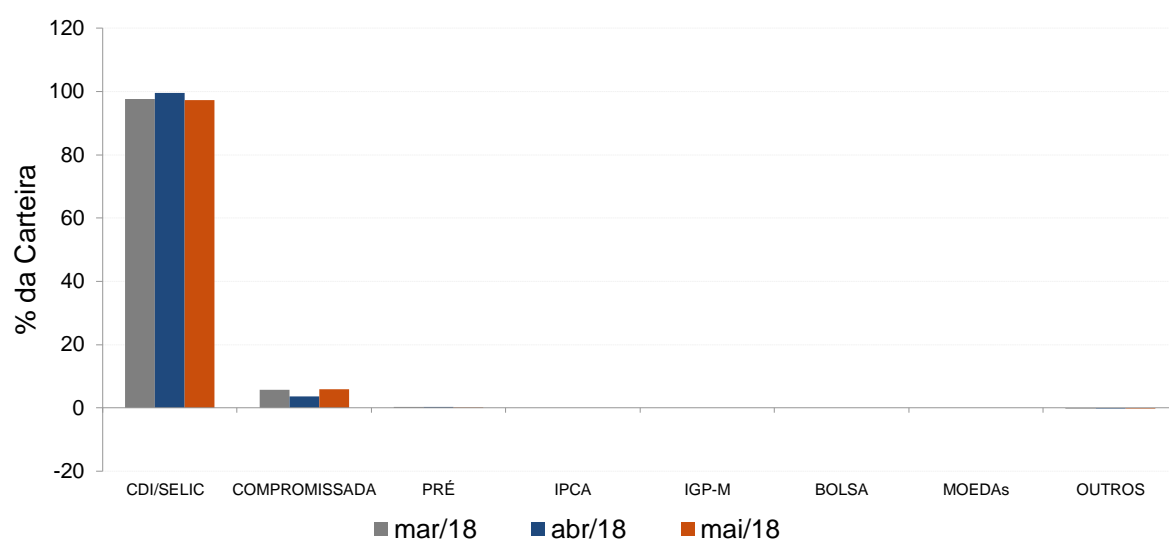
## Distribuição da Carteira

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.

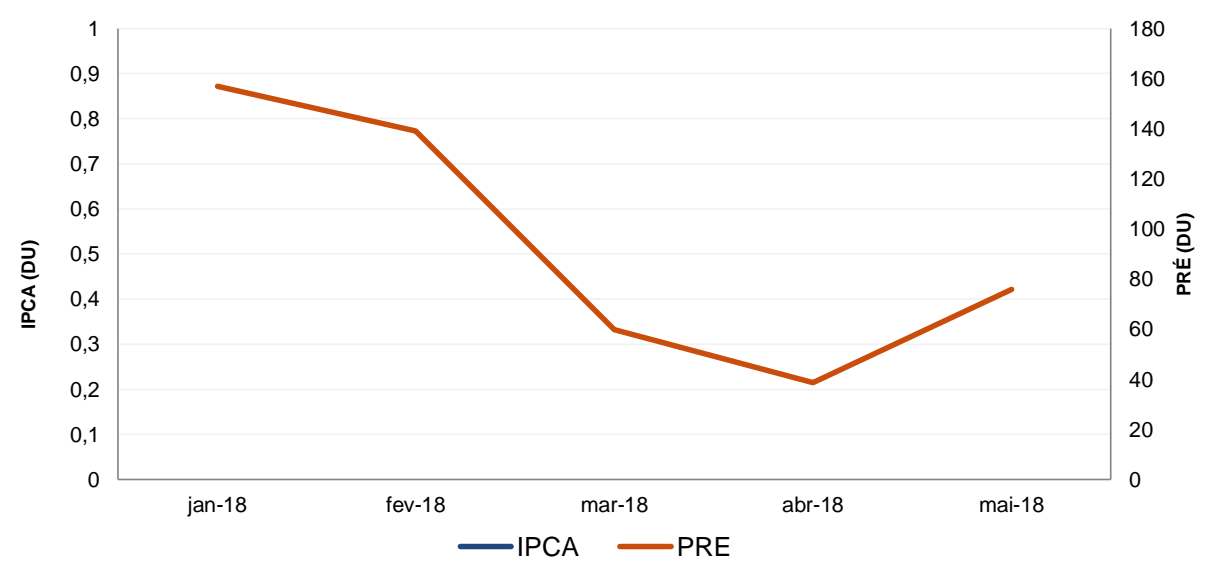
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV PGA

Data-base: 30/05/2018

## Análises de Contrapartes

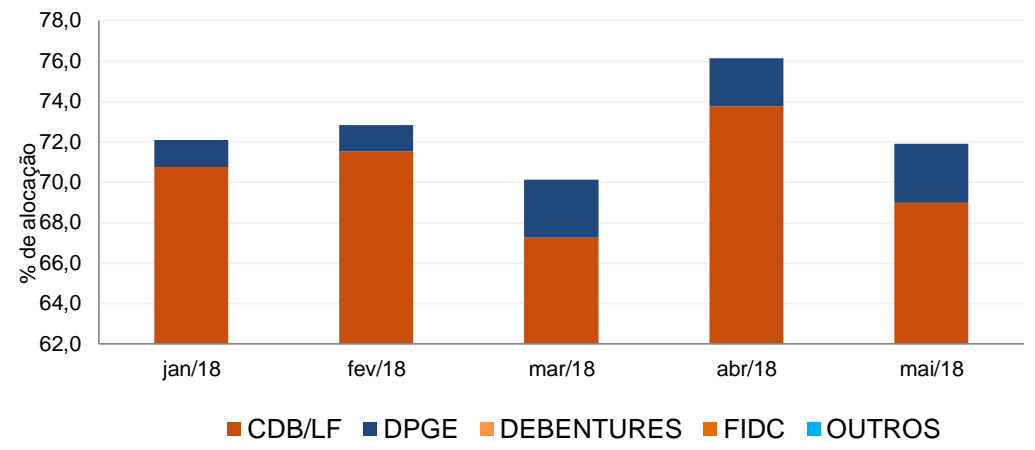
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

### Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO VOTORANTIM SA	93,81	12,32		Aa3.br	brAA-
BCO SAFRA SA	90,40	11,87		Aa1.br	brAA-
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM	86,96	11,42	AAA (bra)	Aa2.br	brAA-
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	71,34	9,37			brAA-
BCO BRADESCO SA	49,18	6,46	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL IN\	44,12	5,79	AA (bra)	Aa1.br	
BCO GMAC SA	28,94	3,80	AAA (bra)		
BCO VOLKSWAGEN SA	22,63	2,97			brAA-
BCO BBM SA	17,57	2,31	AAA (bra)	Aaa.br	
BCO TOYOTA BRASIL SA	16,63	2,18			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
Nenhuma mudança de rating encontrada.									



RBSPREV - RBSPREV PGA

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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2018-09-01	01-set-18	435	0,06%	Selic	16-mai-18	0,00%	0,00%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	1.431	0,19%	Selic	09-mai-18	0,02%	0,01%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	18.600	2,44%	Selic	21-mai-18	0,02%	0,01%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.086	0,14%	Selic	15-mai-18	0,01%	0,01%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.954	0,26%	Selic	15-mai-18	0,01%	0,01%	BRABESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT

