

RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/03/2018

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	6.942.996,45	100,02%				0,53%	2,08%	4,08%	2,08%	9,58%	22,24%		
Benchmark:	CDI					0,53%	1,59%	3,38%	1,59%	8,41%	23,33%	40,25%	
RF REFERENCIADO DI	519.235,81	7,48%											
BRAM FI REF DI FEDERAL II	519.235,81	7,48%	BRADESCO	0,01%	0,00%	0,53%	1,57%	3,37%	1,57%	8,48%	23,31%	40,15%	
Benchmark:	CDI					0,53%	1,59%	3,38%	1,59%	8,41%	23,33%	40,25%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	6.423.760,64	92,54%				0,74%	2,57%	5,19%	2,57%	10,91%	24,09%		
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.423.760,64	92,54%		100%		0,74%	2,57%	5,19%	2,57%	10,91%	24,09%	-	
Benchmark:	CDI					0,53%	1,59%	3,38%	1,59%	8,41%	23,33%	40,25%	
Total	6.941.557,12	100%				0,00%	0,53%	2,08%	4,08%	2,08%	9,58%	22,24%	
Benchmark:	CDI					0,53%	1,59%	3,38%	1,59%	8,41%	23,33%	40,25%	

* 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.

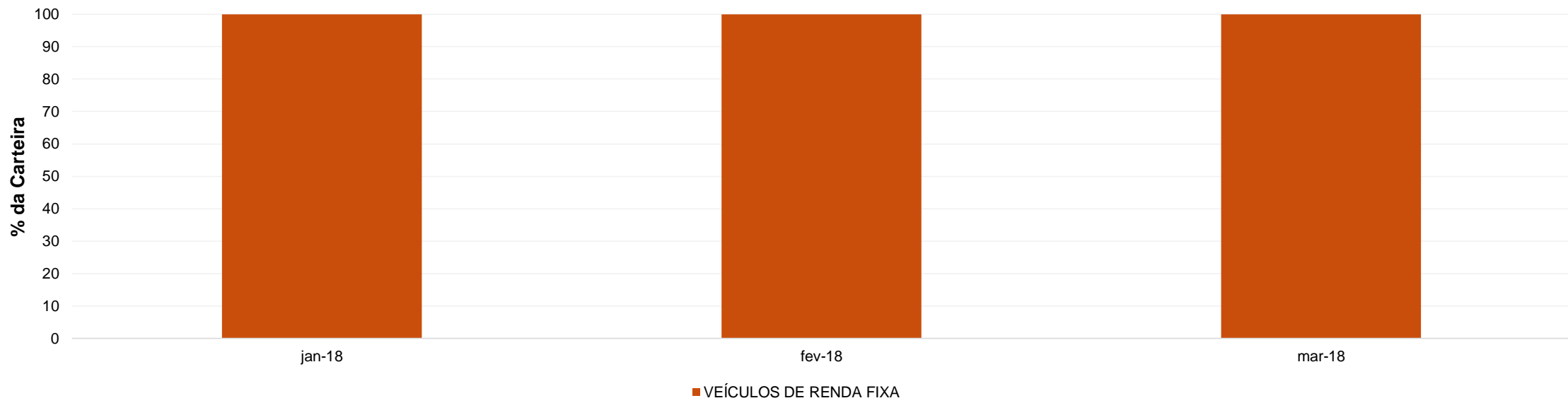
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informação aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

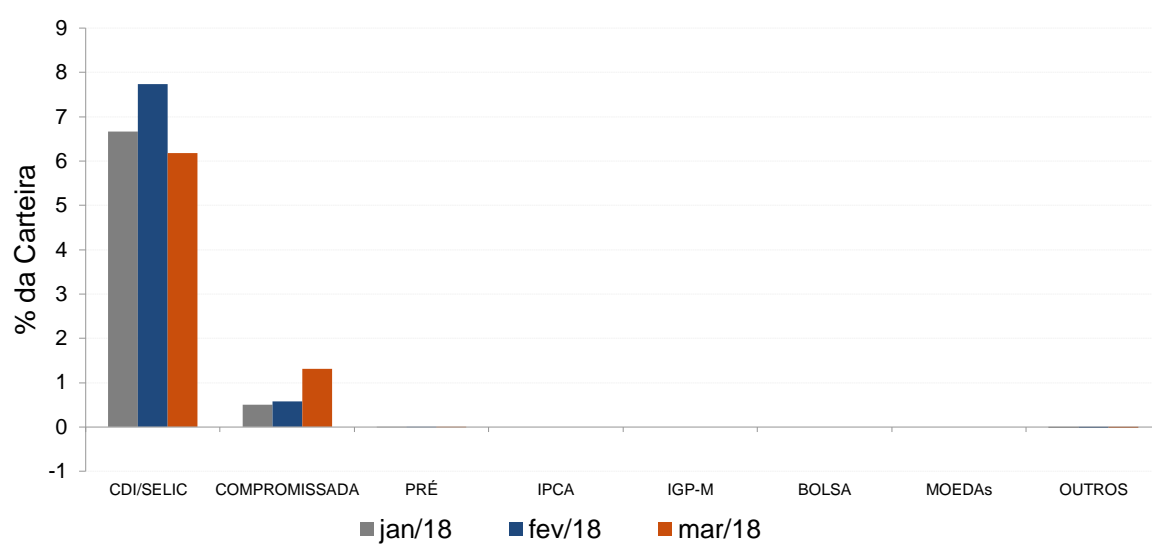
Distribuição da Carteira

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.

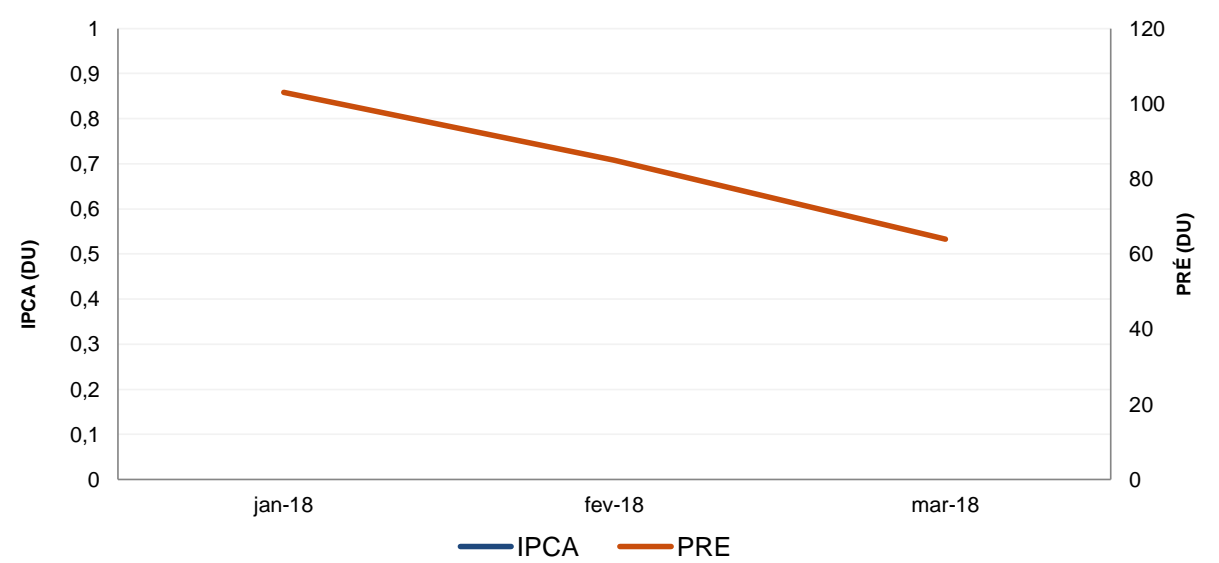
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



RBSPREV - RBSPREV CONSERVADOR VITALÍCIO

Data-base: 29/03/2018

Análises de Contrapartes

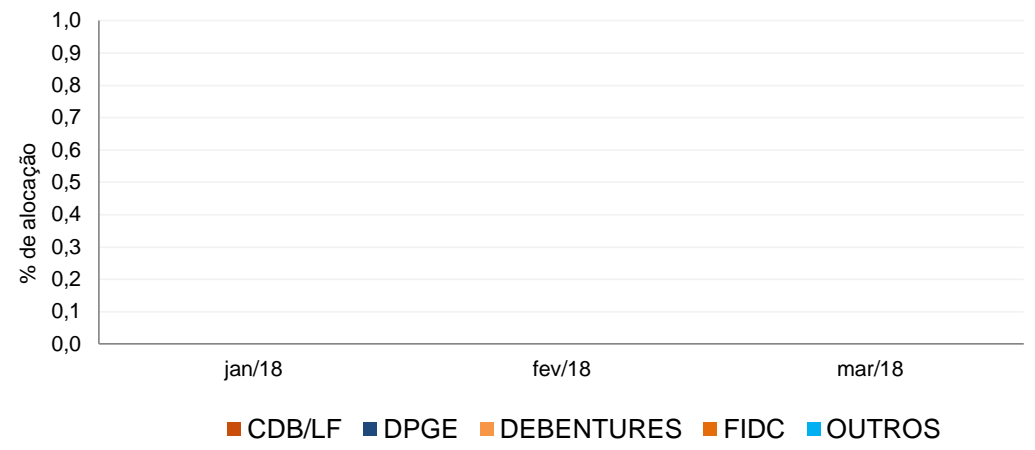
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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: 29/03/2018

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	17.095	0,25%	Selic	08-mar-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	5.972	0,09%	Selic	08-mar-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.851	0,03%	Selic	27-mar-18	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II

