

RBSPREV - RBSPREV CONSOLIDADO

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	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*								
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M		
Renda Fixa	240.645.264,92	87,00%											
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,42%	1,66%	3,81%	1,66%	6,70%	16,06%	32,00%		
Total Return	226.442.808,59	81,87%			1,18%	2,96%	5,37%	2,96%	10,23%	25,24%			
TORRES FI MULT	22.292.032,51	8,06%	ITAU	100%	0,26%	1,14%	2,74%	3,84%	2,74%	8,02%	24,34%	42,62%	
ATLANTIDA FI MULT	65.155.820,89	23,56%	ITAU	100%	0,27%	1,14%	2,98%	4,49%	2,98%	8,90%	23,04%	41,57%	
ITAPEMA FI MULT	83.407.291,20	30,15%	SUL AMERICA	100%	0,57%	1,24%	2,96%	4,83%	2,96%	11,35%	27,12%	45,45%	
LAGOINHA FI MULT	55.587.664,01	20,10%	SUL AMERICA	100%	0,26%	1,18%	2,95%	4,08%	2,95%	9,83%	25,54%	43,23%	
Benchmark:	IPCA + 4% a.a.				0,42%	1,66%	3,81%	1,66%	6,70%	16,06%	32,00%		
Renda Fixa CDI	7.626.032,69	2,76%			0,52%	2,10%	4,01%	1,56%	9,84%	23,98%			
BRAM FI REF DI FEDERAL II	519.235,81	0,19%	BRADESCO	0,01%	0,00%	0,53%	1,57%	3,37%	1,57%	8,48%	23,31%	40,15%	
ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI	2.733.026,34	0,99%	ITAU	0,22%	0,00%	0,52%	1,55%	3,31%	1,55%	8,29%	23,29%	40,34%	
FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV	3.797.132,45	1,37%	VOTORANTIM	0,26%	0,00%	0,52%	1,57%	3,39%	1,57%	8,69%	24,44%	41,50%	
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	576.638,10	0,21%	VOTORANTIM	0,09%	0,00%	0,53%	1,58%	3,41%	1,58%	8,62%	23,96%	41,51%	
Benchmark:	CDI				0,53%	1,59%	3,38%	1,59%	8,41%	23,33%	40,25%		
CARTEIRA PRÓPRIA RF	6.423.760,64	2,32%			0,74%	2,57%	5,19%	2,57%	10,91%	24,09%			
RBSPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	6.423.760,64	2,32%		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%		
RF REFERENCIADO DI	152.663,00	0,06%			0,52%	1,54%	3,30%	1,54%	8,35%	22,97%			
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	152.663,00	0,06%	BRADESCO	0,00%	0,00%	0,52%	1,54%	3,30%	1,54%	8,35%	22,97%	39,57%	
Benchmark:	CDI				0,53%	1,59%	3,38%	1,59%	8,41%	23,33%	40,25%		
Renda Variável	10.771.905,82	3,89%											
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.				0,26%	12,53%	16,56%	12,53%	35,23%	80,84%	82,24%		
Renda Variável Ativa	10.771.905,82	3,89%			0,95%	6,12%	7,39%	6,12%	23,45%	52,99%			
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	3.063.875,70	1,11%	BTG PACTUAL	0,49%	4,69%	1,90%	10,10%	10,24%	10,10%	31,92%	53,15%	58,57%	
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FI	3.664.913,61	1,32%	ITAU	0,73%	3,13%	1,83%	11,79%	13,10%	11,79%	31,89%	84,25%	77,52%	
AZ QUEST ACOES FC FIA	2.053.079,61	0,74%	AZ QUEST	0,61%	7,88%	1,29%	17,54%	18,70%	17,54%	38,85%	72,07%	60,13%	
NEO NAVITAS FICFI EM ACOES	1.990.036,91	0,72%	NEO GESTAO	0,32%	3,84%	0,61%	0,90%	4,56%	0,90%	39,08%	74,90%	99,43%	
Benchmark:	IBOVESPA + 3% a.a.				0,26%	12,53%	16,56%	12,53%	35,23%	80,84%	82,24%		
Estruturados	25.189.046,09	9,11%											
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,70%	2,08%	4,38%	2,08%	10,54%	28,27%	48,76%		
Multimercado Estruturado	25.189.046,09	9,11%			1,01%	3,37%	6,04%	3,37%	10,99%	27,99%			
BTG PACTUAL DISCOVERY FI MULT	4.046.176,10	1,46%	BTG PACTUAL	0,34%	1,44%	1,52%	4,28%	7,03%	4,28%	18,72%	36,85%	59,20%	
GARDE D ARTAGNAN FICFI MULT	3.043.991,01	1,10%	GARDE	0,09%	3,49%	0,76%	2,83%	3,71%	2,83%	12,78%	35,93%	59,49%	
KINEA CHRONOS FI MULT	6.858.239,90	2,48%	KINEA	0,27%	0,71%	1,36%	3,70%	4,83%	3,70%	12,76%	38,36%	-	
SUL AMERICA ENDURANCE FI MULT	3.149.928,66	1,14%	SUL AMERICA	0,70%	0,09%	0,43%	1,50%	3,17%	1,50%	9,80%	26,06%	49,40%	
FICFI MULT GARDE DUMAS	4.530.718,02	1,64%	GARDE	0,59%	3,49%	0,76%	2,85%	3,71%	2,85%	12,76%	35,78%	59,28%	
AZ QUEST MULT FC FI MULT	3.559.992,41	1,29%	AZ QUEST	0,61%	1,08%	0,79%	4,65%	5,34%	4,65%	11,69%	40,31%	66,45%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,70%	2,08%	4,38%	2,08%	10,54%	28,27%	48,76%		
Total	276.598.262,69	100%			0,65%								
Benchmark:	IPCA + 4.39% a.a.				0,45%	1,75%	3,99%	1,75%	7,10%	16,93%	33,47%		

* 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.

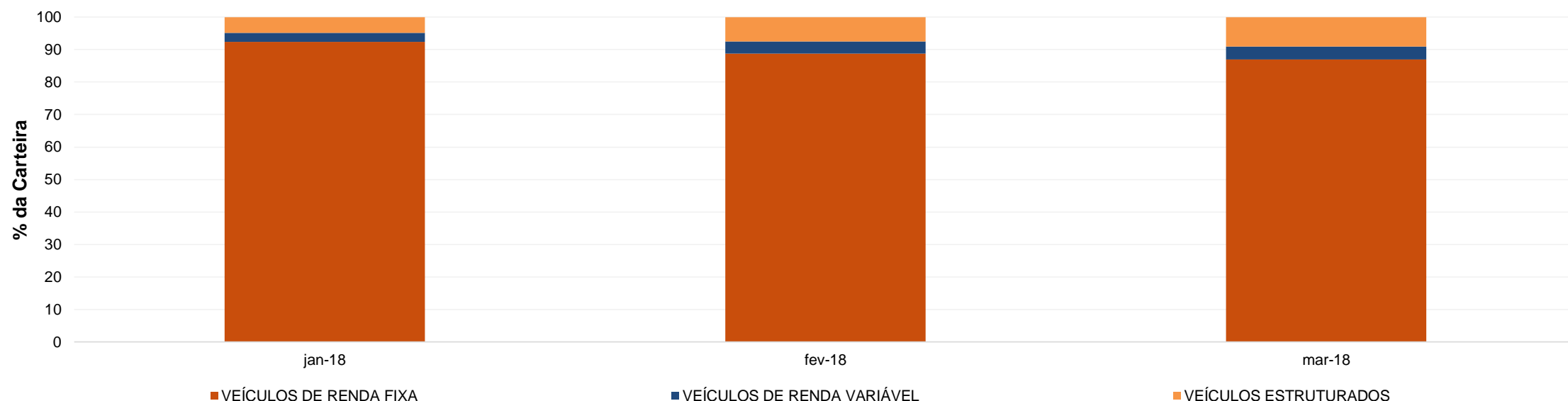
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

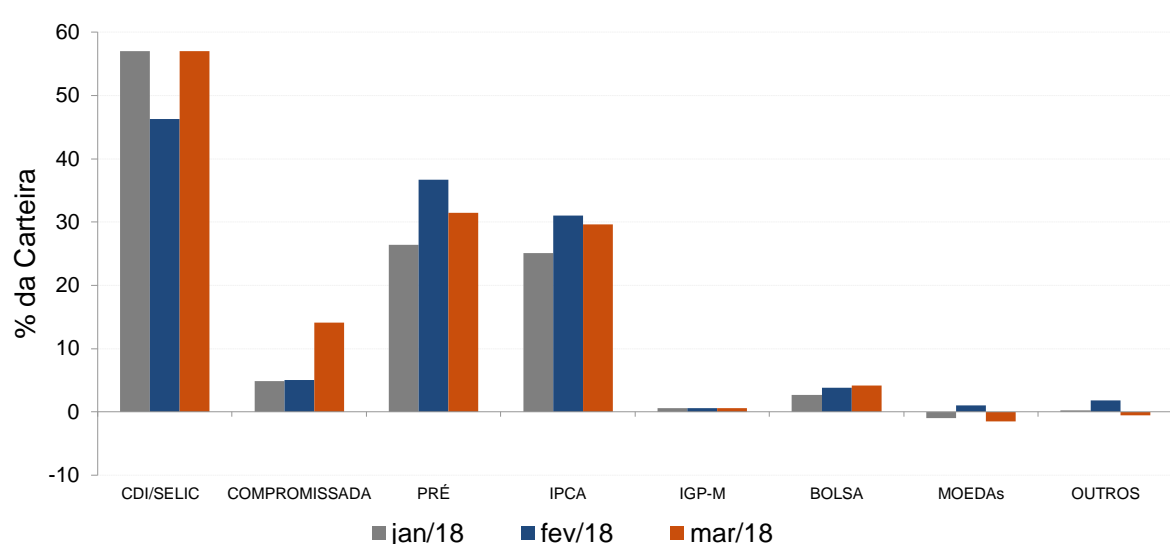
Distribuição da Carteira

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.

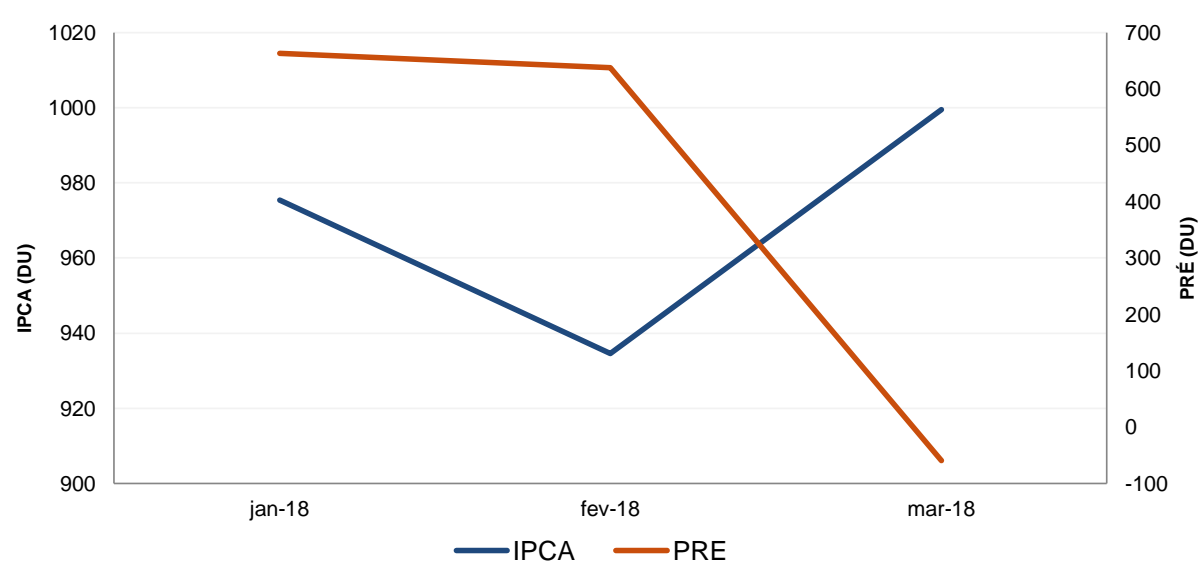
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Renda Variável

Essa seção abrange análises sobre a carteira de Renda Variável. Todas as informações sobre concentração são relativas ao total da carteira de Renda Variável do plano.

Maiores Exposições

A análise de maiores exposições apresenta as ações com maior participação na carteira, o setor ao qual pertencem e a evolução da posição em relação ao mês anterior.

Nome	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
T10M18Serie		1.022,66	7,41	3.074,52	19,72
ITUB4	Intermediários Financeiros	912,52	6,62	653,82	4,19
RENT3	Diversos	677,08	4,91	513,63	3,30
EQTL3	Energia Elétrica	613,30	4,45	595,25	3,82
LREN3	Comércio	595,76	4,32	341,51	2,19
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	557,28	4,04	684,08	4,39
ABEV3	Bebidas	538,44	3,90	380,24	2,44
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	523,68	3,80	0,00	
CVCB3	Viagens e Lazer	475,65	3,45	447,55	2,87
BBDC4	Intermediários Financeiros	461,02	3,34	444,04	2,85

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

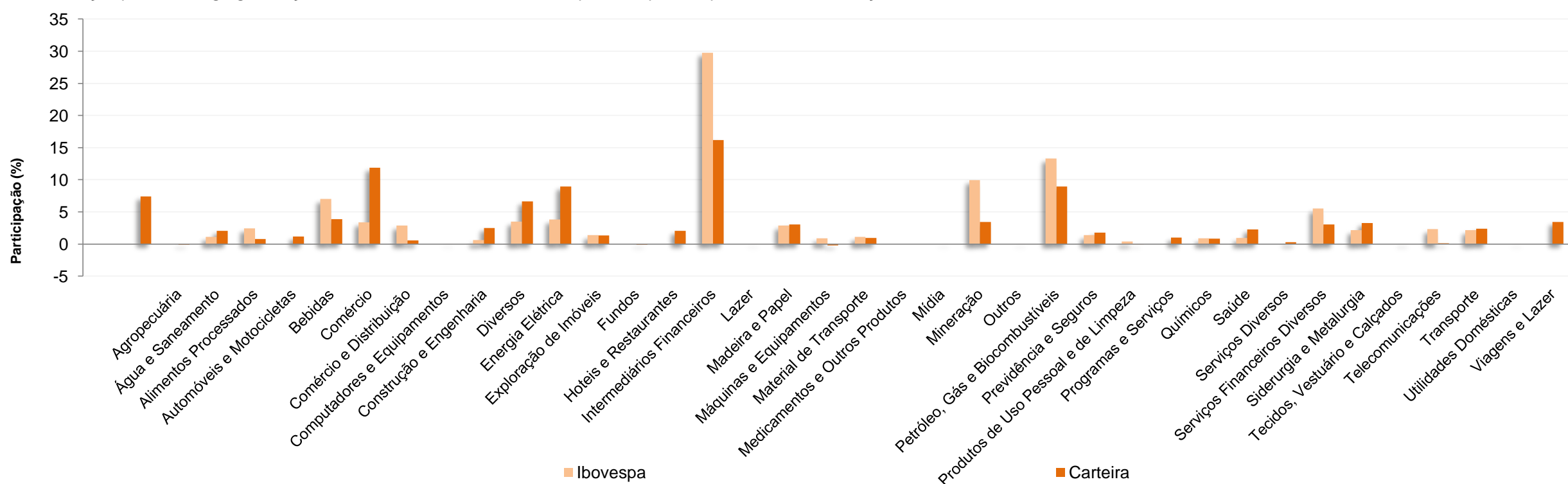
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
ITUB4	912,52	6,62	0,00	1
RENT3	677,08	4,91	0,00	1
EQTL3	613,30	4,45	0,00	1
LREN3	595,76	4,32	0,00	1
PETR4	557,28	4,04	0,00	1
ABEV3	538,44	3,90	0,00	1
B3SA3	523,68	3,80	0,00	1
CVCB3	475,65	3,45	0,01	1
BBDC4	461,02	3,34	0,00	1
ITSA4	398,91	2,89	0,00	1

* em mil R\$

Concentração por setor

A concentração por setor segrega as ações da carteira em setores da Bovespa e compara os percentuais de alocação da carteira com os do benchmark de renda variável.



Análises de Contrapartes

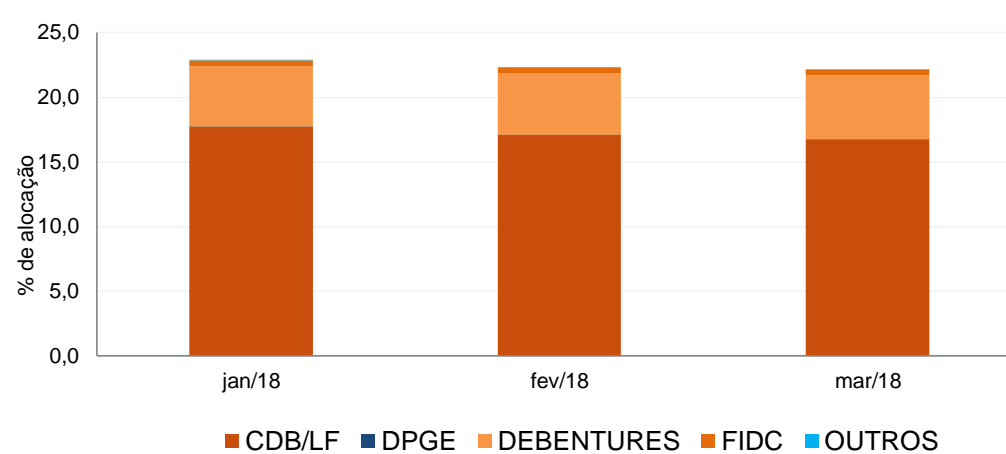
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO BRASIL SA	10.517,61	3,82	AA+ (bra)	Aa1.br	
BCO BRADESCO SA	9.977,77	3,62	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
ITAU UNIBANCO SA	9.519,82	3,45	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	4.218,92	1,53	AA+ (bra)	Aa1.br	brAA-
LOCALIZA RENT A CAR SA	4.071,97	1,48	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	3.778,86	1,37		Aaa.br	brAA-
BCO SAFRA SA	3.454,20	1,25		Aa1.br	brAA-
BCO VOTORANTIM SA	2.557,78	0,93		Aa3.br	brAA-
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	2.187,05	0,79	AA+ (bra)	Aaa.br	brA+
CCR SA	1.939,39	0,70	AA (bra)	A2.br	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
DASA19	277,73	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	Novo	AA+ (bra)	Fitch	26-mar-23	CDI	108,60%	LAGOINHA FI MULT



RBSPREV - RBSPREV CONSOLIDADO

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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Rating	Agência	Veículo
CDB CDI	22-fev-19	4.015	0,00%	CDI	BCO MERRILL LYNCH INVESTS SA	08-mar-18	102,00%	AAA (bra)	Fitch	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
CEMT18	15-fev-21	30.898	0,01%	CDI	ENERGISA MATO GROSSO DISTRIBUIDOF	07-mar-18	1,10%	AA+ (bra)	Fitch	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
DASA19	26-mar-23	277.727	0,10%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	26-mar-18	108,60%	AA+ (bra)	Fitch	LAGOINHA FI MULT
DPGE CDI	03-out-18	7.906	0,00%	CDI	BCO A J RENNER SA	27-mar-18	107,50%	Rating	Agência	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
IOCH18	26-mar-23	33.342	0,01%	CDI	IOCHPE MAXION SA	28-mar-18	1,40%	brAA	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	16-ago-19	60.655	0,02%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	14-mar-18	0,37%	Aa3.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	16-ago-19	9.367	0,00%	CDI	BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	13-mar-18	103,50%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	02-jan-20	2.374	0,00%	CDI	BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	06-mar-18	104,50%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	05-mar-20	44.989	0,02%	CDI	BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA	05-mar-18	104,50%	brAA-	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	12-mar-20	22.844	0,01%	CDI	BCO VOTORANTIM SA	19-mar-18	118,00%	Aa3.br	Moody's	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LF CDI	16-mar-20	4.906	0,00%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	09-mar-18	102,80%	brAA-	S&P	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
LF CDI	26-mai-20	20.681	0,01%	CDI	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	26-mar-18	102,00%	brAA-	S&P	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
LF CDI	09-mar-21	446	0,00%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	09-mar-18	103,80%	brAA-	S&P	ITAU INSTITUCIONAL RF REF DI FI
PETR35	15-ago-22	13.547	0,00%	CDI	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	05-mar-18	0,00%	brA+	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
PETR35	15-ago-22	5.419	0,00%	CDI	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	02-mar-18	0,00%	brA+	S&P	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2018-09-01	01-set-18	235.782	0,09%	Selic		29-mar-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2018-09-01	01-set-18	28.294	0,01%	Selic		23-mar-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2018-09-01	01-set-18	17.095	0,01%	Selic		08-mar-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2018-09-01	01-set-18	6.794	0,00%	Selic		01-mar-18	0,00%	0,00%	BRANCO FI REF DI FEDERAL EXT
LFT 2019-03-01	01-mar-19	603.593	0,22%	Selic		06-mar-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	720	0,00%	Selic		08-mar-18	0,00%	0,00%	BRANCO FI REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-09-01	01-set-20	1.574.922	0,57%	Selic		01-mar-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2020-09-01	01-set-20	311.212	0,11%	Selic		21-mar-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	2.715.895	0,99%	Selic		22-mar-18	0,00%	0,00%	TORRES FI MULT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	5.972	0,00%	Selic		08-mar-18	0,00%	0,00%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2021-03-01	01-mar-21	3.601	0,00%	Selic		01-mar-18	0,00%	0,00%	BRANCO FI REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-09-01	01-set-21	1.851	0,00%	Selic		27-mar-18	0,01%	0,01%	BRAM FI REF DI FEDERAL II
LFT 2022-09-01	01-set-22	195.942	0,07%	Selic		01-mar-18	0,00%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2022-09-01	01-set-22	49.917	0,02%	Selic		01-mar-18	0,00%	0,01%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2022-09-01	01-set-22	16.479	0,01%	Selic		26-mar-18	0,01%	0,01%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV
LFT 2024-03-01	01-mar-24	256.229	0,09%	Selic		02-mar-18	0,00%	0,00%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2024-03-01	01-mar-24	66.540	0,02%	Selic		02-mar-18	0,00%	0,00%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
LFT 2024-03-01	01-mar-24	3.724	0,00%	Selic		01-mar-18	0,00%	0,00%	FI VOT INSTITUCIONAL RF CRED PRIV
NTN-B 2018-08-15	15-ago-18	21.865	0,01%	IPCA		12-mar-18	3,05%	3,08%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2019-05-15	15-mai-19	22.839	0,01%	IPCA		12-mar-18	2,56%	2,56%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2020-08-15	15-ago-20	19.664	0,01%	IPCA		12-mar-18	3,58%	3,62%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	23.475	0,01%	IPCA		12-mar-18	3,90%	3,91%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	3.869.141	1,40%	IPCA		26-mar-18	4,11%	4,05%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	2.818.756	1,02%	IPCA		27-mar-18	4,05%	4,07%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	2.579.428	0,94%	IPCA		26-mar-18	4,14%	4,05%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	2.453.115	0,89%	IPCA		26-mar-18	4,11%	4,05%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.794.962	0,65%	IPCA		27-mar-18	4,05%	4,07%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.635.410	0,59%	IPCA		26-mar-18	4,14%	4,05%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.515.746	0,55%	IPCA		27-mar-18	4,05%	4,07%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.409.378	0,51%	IPCA		27-mar-18	4,06%	4,07%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	953.989	0,35%	IPCA		27-mar-18	4,05%	4,07%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	897.481	0,33%	IPCA		27-mar-18	4,06%	4,07%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	704.689	0,26%	IPCA		27-mar-18	4,06%	4,07%	ITAPEMA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	448.741	0,16%	IPCA		27-mar-18	4,06%	4,07%	LAGOINHA FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	46.536	0,02%	IPCA		12-mar-18	4,34%	4,34%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	320.560	0,12%	IPCA		16-mar-18	4,44%	4,43%	ATLANTIDA FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	107.978	0,04%	IPCA		16-mar-18	4,44%	4,43%	TORRES FI MULT

