

RBSPREV - RBSPREV PGA

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	729.301,10	100,00%				0,52%	1,51%	3,32%	1,51%	8,24%	23,21%	40,24%
Benchmark:	CDI					0,53%	1,59%	3,38%	1,59%	8,41%	23,33%	40,25%
RF CRÉDITO	576.638,10	79,07%										
VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV	576.638,10	79,07%	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%
RF REFERENCIADO DI	152.663,00	20,93%										
BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	152.663,00	20,93%	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%
Total	729.301,10	100%			0,00%	0,52%	1,51%	3,32%	1,51%	8,24%	23,21%	40,24%
Benchmark:	CDI					0,53%	1,59%	3,38%	1,59%	8,41%	23,33%	40,25%

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse 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.

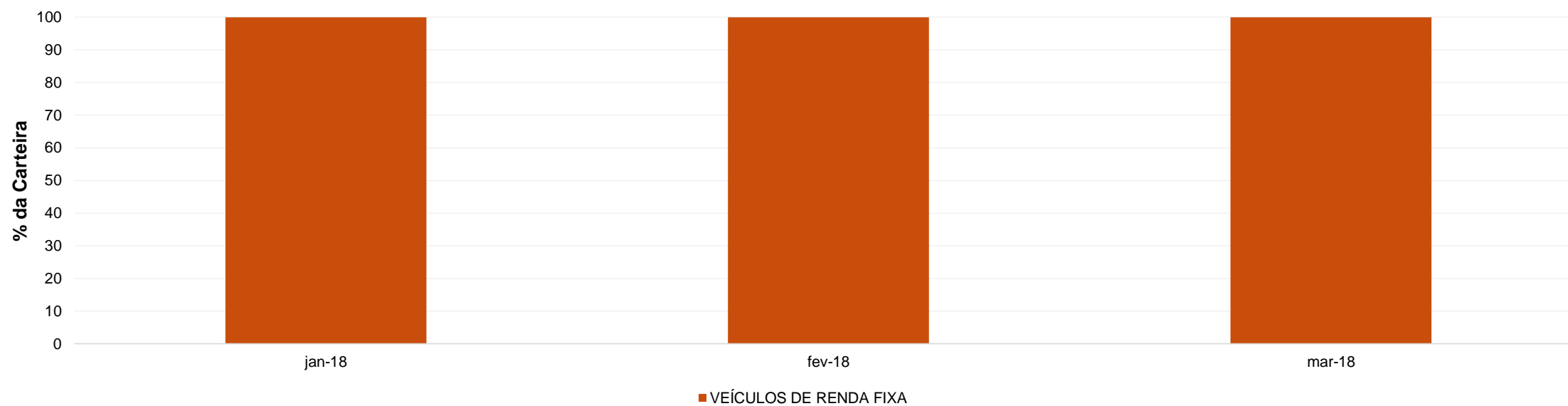


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.
A ADITUS não se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

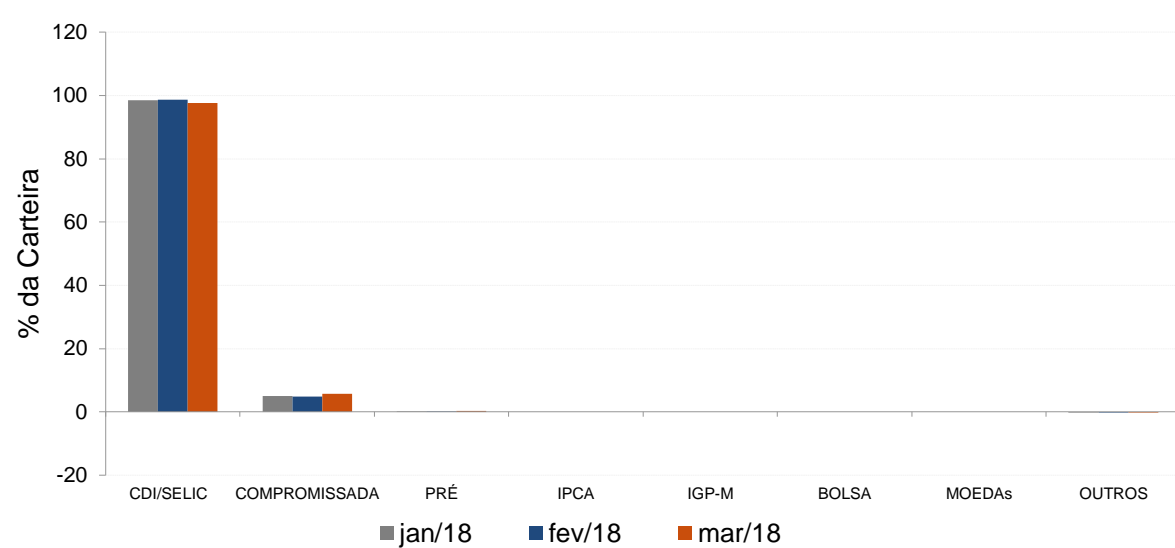
Distribuição da Carteira

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.

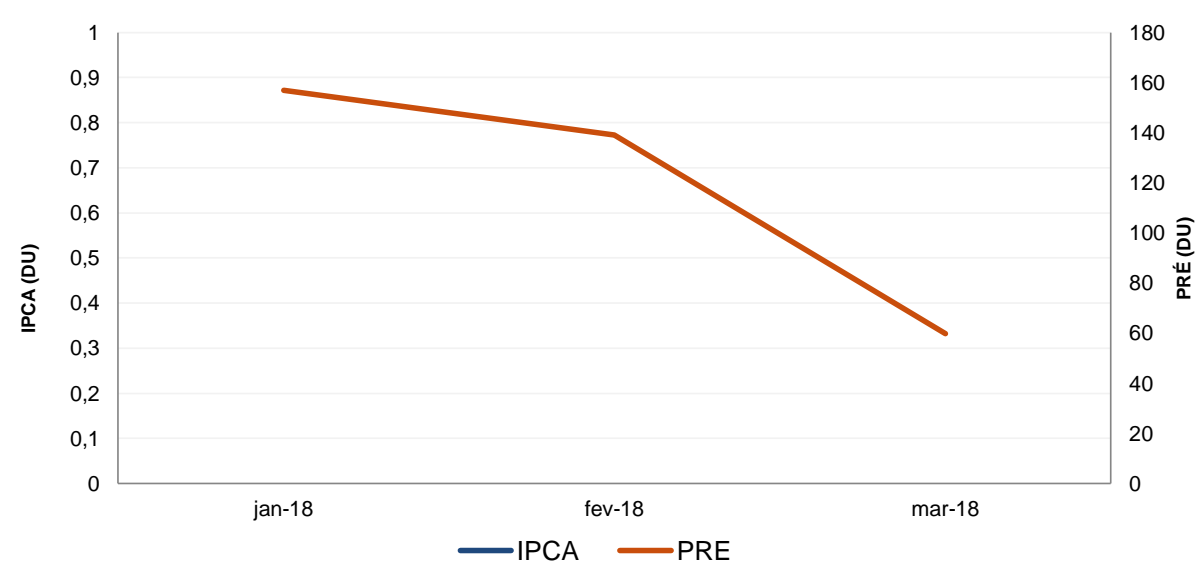
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



Análises de Contrapartes

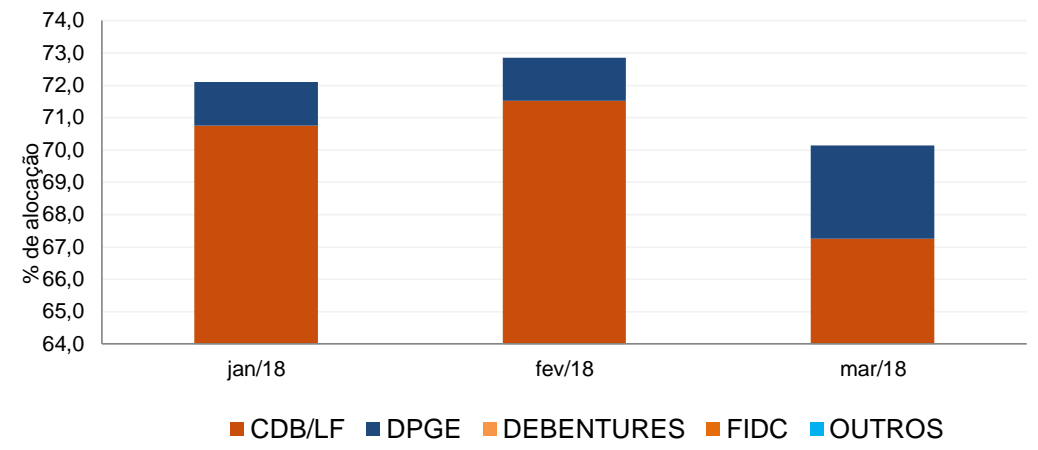
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	87,73	11,91			brAA-
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM	78,52	10,65	AA+ (bra)	Aa2.br	brAA-
BCO VOTORANTIM SA	67,91	9,22		Aa3.br	brAA-
BCO SAFRA SA	50,74	6,88		Aa1.br	brAA-
BCO TOYOTA BRASIL SA	48,00	6,51			brAA-
BCO BRADESCO SA	33,81	4,59	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL IN\	31,03	4,21	AA (bra)	Aa1.br	
BCO GMAC SA	28,88	3,92	AAA (bra)	Aa2.br	
BCO VOLKSWAGEN SA	25,40	3,45			brAA-
BCO CITIBANK SA	17,88	2,43			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: 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	6.794	0,92%	Selic	01-mar-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2020-03-01	01-mar-20	720	0,10%	Selic	08-mar-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2021-03-01	01-mar-21	3.601	0,49%	Selic	01-mar-18	0,00%	0,00%	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXT
LFT 2022-09-01	01-set-22	16.479	2,24%	Selic	26-mar-18	0,01%	0,01%	VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV

