



RBSPREV PLANO CV

Enquadramento Legal CMN 3792 RiskOffice

2014-11-28

Limites de alocação

Modalidades de Investimento	Alocação	%	Limite	%	Status
Renda fixa	R\$ 219.935.324,70	94,76%	R\$ 232.089.745,30	100,00%	✓
Títulos da dívida mobiliária federal	R\$ 180.835.676,69	77,92%	R\$ 232.089.745,30	100,00%	✓
Ativos de renda fixa, exceto títulos da dívida mobiliária federal	R\$ 39.500.289,26	17,02%	R\$ 185.671.796,24	80,00%	✓
Cédulas de crédito bancário (CCB), certificados de cédulas de crédito bancário (CCCB) e notas promissórias (NP)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Notas de crédito à exportação (NCE) e cédulas de crédito à exportação (CCE)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios (FIDC) e de fundo de cotas de FIDCs	R\$ 3.809.149,29	1,64%	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Certificados de recebíveis imobiliários (CRI)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Cédulas de crédito imobiliário (CCI)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Títulos do agronegócio (CPR; CDCA; CRA e Warrant Agropecuário)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Demais títulos e valores mobiliários (exceto debêntures) de companhias abertas, exceto de securitizadoras	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Renda variável	R\$ 10.129.751,45	4,36%	R\$ 162.462.821,71	70,00%	✓
Ações de companhias abertas admitidas à negociação no segmento Novo Mercado da BM&FBovespa	R\$ 5.440.970,26	2,34%	R\$ 162.462.821,71	70,00%	✓
Ações de companhias abertas admitidas à negociação no segmento Nível 2 da BM&FBovespa	R\$ 994.367,64	0,43%	R\$ 139.253.847,18	60,00%	✓
Ações de companhias abertas admitidas à negociação no segmento Bovespa Mais da BM&FBovespa	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 116.044.872,65	50,00%	✓
Ações de companhias abertas admitidas à negociação no segmento Nível 1 da BM&FBovespa	R\$ 3.913.689,12	1,69%	R\$ 104.440.385,38	45,00%	✓
Ações sem classificação de governança corporativa + cotas de fundos de índices de ações (inclui ETFs)	R\$ 816.001,34	0,35%	R\$ 81.231.410,85	35,00%	✓
Títulos e valores mobiliários de emissão de Sociedades de Propósito Específico (SPEs)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Debêntures com part. nos lucros + Cert. Potencial Adicional de Construção + Crédito de Carbono + Ouro	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 6.962.692,36	3,00%	✓
Investimentos estruturados	R\$ 2.024.669,15	0,87%	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Fundos de participação	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Fundos Mútuos de Investimentos em Empresas Emergentes	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Fundos imobiliários	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓
Fundos multimercado cujos regulamentos observem exclusivamente a legislação estabelecida pela CVM	R\$ 2.024.669,15	0,87%	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓
Investimentos no exterior	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓
Imóveis	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 18.567.179,62	8,00%	✓
Operações com participantes	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 34.813.461,79	15,00%	✓

Derivativos

Limites	Limite	%	Status
Prêmio das opções	R\$ 9.599.787,02	5,00%	✓
Depósitos de margem	R\$ 28.799.361,06	15,00%	✓

Limites de Concentração por plano

Emissores	Limite	%	Status
Instituição financeira autorizada a funcionar pelo Bacen	R\$ 46.417.949,06	20,00%	✓
Companhias abertas e securitizadoras	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓
Organismo multilateral	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓
Fundo de Investimento ou Fundo de Investimento em Cota de Fundo de Investimento Classificado como Dívida Externa	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓
Companhias limitadas	R\$ 11.604.487,26	5,00%	✓

Limites de Concentração por plano

Veículos	Limite	%	Status
Fundo de investimento em direitos creditórios (FIDC)	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓
Fundo de índice referenciado em cesta de ações de companhias abertas (inclui ETFs)	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓
Fundo de Participação ou de Empresas Emergentes	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓
Fundo imobiliário	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓
Fundo Multimercado cujo regulamento observe exclusivamente a legislação estabelecida pela CVM	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓
Sociedades de propósito específico (SPE)	R\$ 23.208.974,53	10,00%	✓

Vedações

Tipos de Vedação	Status
Aplicar em companhias sem registro na CVM	✓
Aplicar em companhias que não estejam admitidas à negociação nos segmentos Novo Mercado, Nível 2 ou Bovespa Mais da BM&Fbovespa	✓
Aplicar em veículos que alavancam mais de uma vez o PL	✓
Locar títulos e valores mobiliários (short de ações)	✓
Ativos sem ISIN	✓
Alocar recursos em terrenos	✓
Swaps sem garantia	✓
Aplicar em fundos não institucionais (exceto estruturados)	✓

Recursos garantidores das reservas técnicas

R\$ 232.089.745,30

- As informações utilizadas na geração do enquadramento foram obtidas junto ao RPPS que administra o plano e aos seus prestadores de serviço. Não são de responsabilidade do RiskOffice, portanto, quaisquer erros decorrentes de ruído ou falhas de informação.
- Os dados de mercado utilizados para verificação do enquadramento foram obtidos junto a fontes públicas nas quais o RiskOffice deposita confiança. Entretanto, o RiskOffice não se responsabiliza pela acurácia desses dados.
- Adicionalmente, é preciso ressaltar que os relatórios aqui apresentados são confidenciais, de uso restrito dos contratantes e de caráter informativo. Não devem, portanto, ser utilizados para embasar quaisquer procedimentos junto aos órgãos reguladores ou fiscalizadores sem prévia autorização.
- O enquadramento não observa as operações realizadas nas carteiras dos fundos de participação (FIP); dos fundos de investimento em cotas de FIP (FIC FIP); dos fundos de investimento em empresas emergentes (FMIEE); dos fundos imobiliários (FII); dos fundos de investimento em direitos creditórios (FIDC); e dos fundos de investimento em dívida externa (FIDE).