

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO CV 2014-10-31

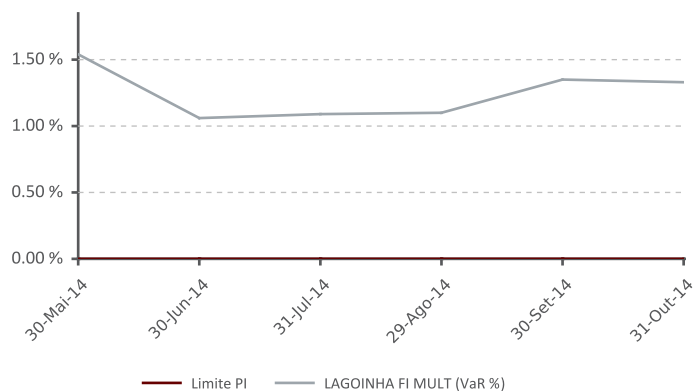
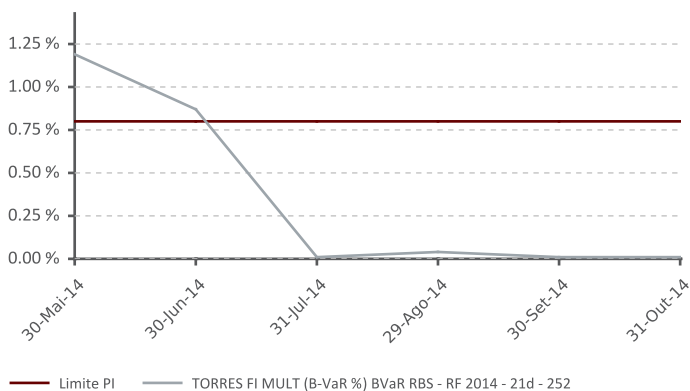
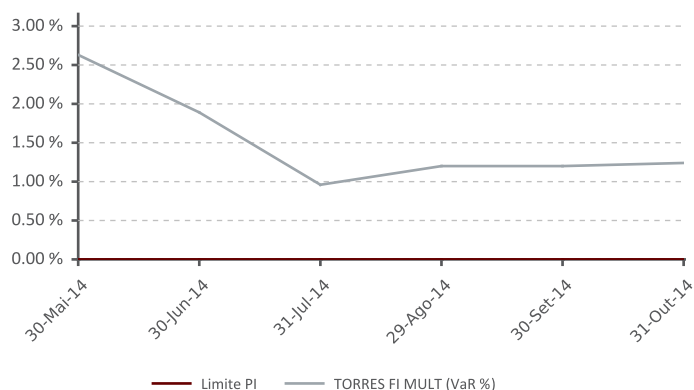
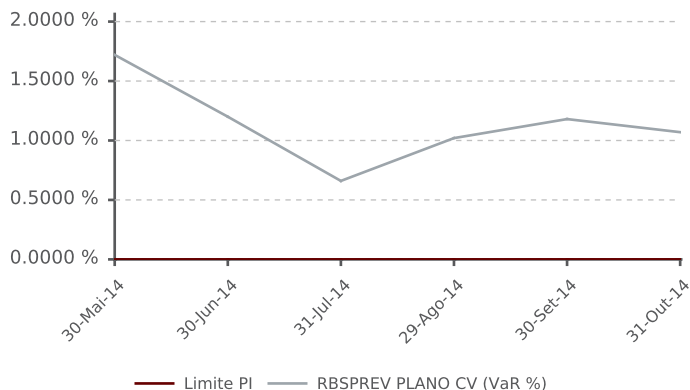
31/10/2014

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO CV	-	229,585,231.70	229,579,951.83	1.07%	-	-	(6,282,436.31)	(2.74)%
TORRES FI MULT	-	50,046,196.97	50,031,653.20	1.24%	-	-	(1,503,593.82)	(3.00)%
TORRES FI MULT	62%CDI + 20%IMA-B5 + 18%IMAB 5+	50,046,196.97	50,031,653.20	0.01%	0.80%	✓	-	-
LAGOINHA FI MULT	-	52,876,765.15	52,946,694.85	1.33%	-	-	(1,807,214.11)	(3.42)%
LAGOINHA FI MULT	62%CDI + 20%IMA-B5 + 18%IMAB 5+	52,876,765.15	52,946,694.85	0.14%	0.80%	✓	-	-
BTG PACTUAL MULT RV INST FIC FIA	IBOVESPA	1,007,406.20	1,007,395.83	1.82%	8.07%	✓	-	-
BTG PACTUAL MULT RV INST FIC FIA	-	1,207,068.66	1,207,312.30	8.13%	-	-	(173,594.75)	(14.38)%
ATLANTIDA FI MULT	-	54,863,651.10	54,731,675.98	0.84%	3.00%	✓	(1,035,692.60)	(1.89)%
ITAPEMA FI MULT	-	58,064,028.90	58,134,489.83	0.19%	3.00%	✓	(180,771.47)	(0.31)%
BRANCO FI MULT TACTICAL	-	1,000,886.61	1,000,886.61	1.94%	7.00%	✓	0.00	0.00%
HSBC FICFI ACOES IBOV REG DE PREVID	IBOVESPA	6,473,374.35	6,473,052.39	1.55%	8.07%	✓	-	-
HSBC FICFI ACOES IBOV REG DE PREVID	-	7,492,950.29	7,493,438.95	8.64%	-	-	(1,137,744.91)	(15.18)%
ITAU FOF RPI 30	IBOVESPA	2,567,031.95	2,567,148.06	1.68%	8.07%	✓	-	-
ITAU FOF RPI 30	-	3,033,134.52	3,033,250.61	8.03%	-	-	(443,824.66)	(14.63)%
ITAU HEDGE MULT FI	-	1,000,549.50	1,000,549.50	0.49%	7.00%	✓	0.00	0.00%

* Quando o campo Benchmark estiver preenchido, o valor apresentado na coluna VaR/BVaR será o Benchmark VaR. Caso contrário o valor apresentado será o Value at Risk.

EVOLUÇÃO GRÁFICA

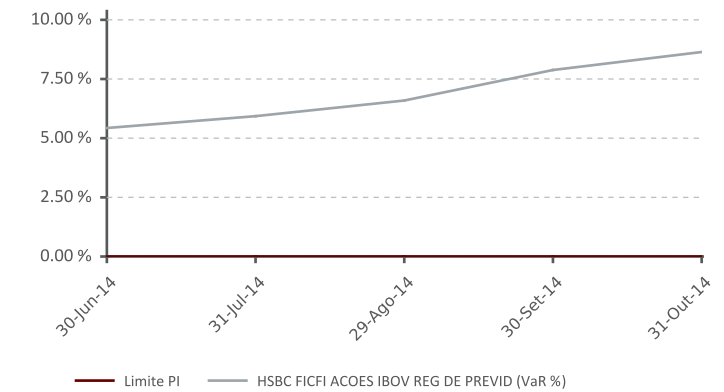
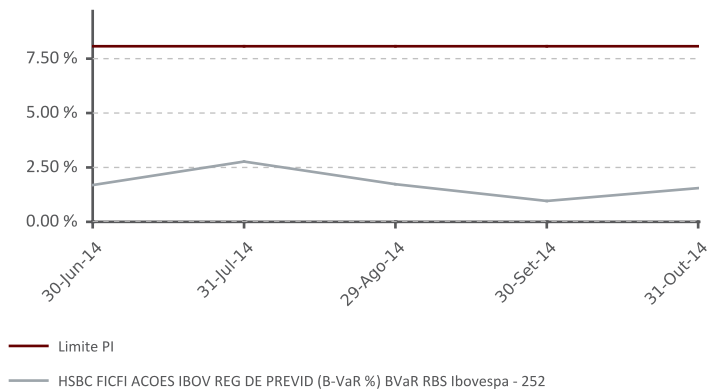
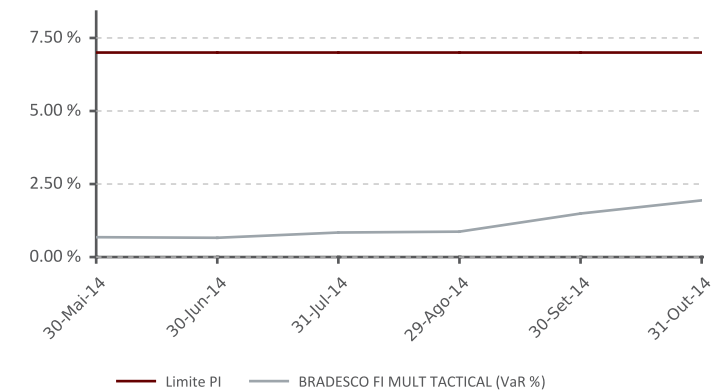
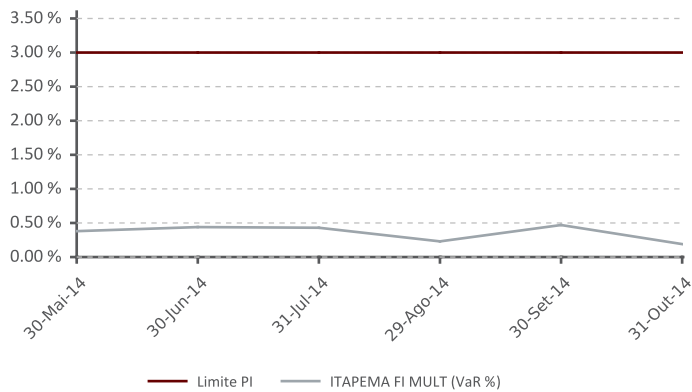
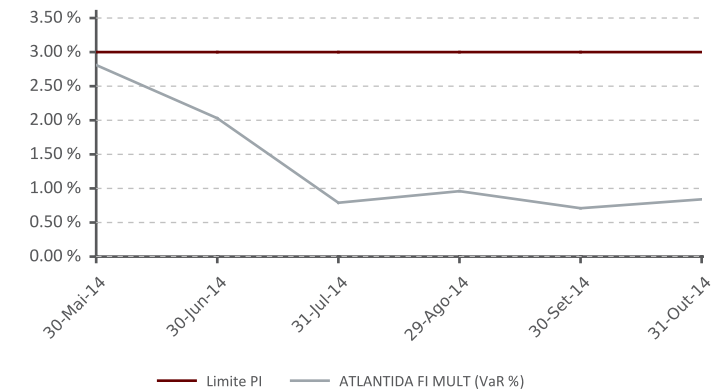
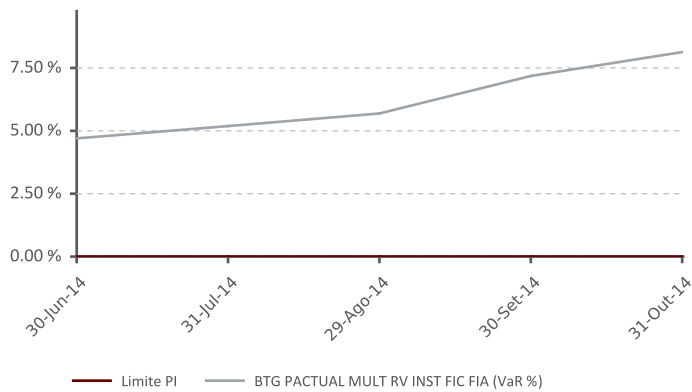
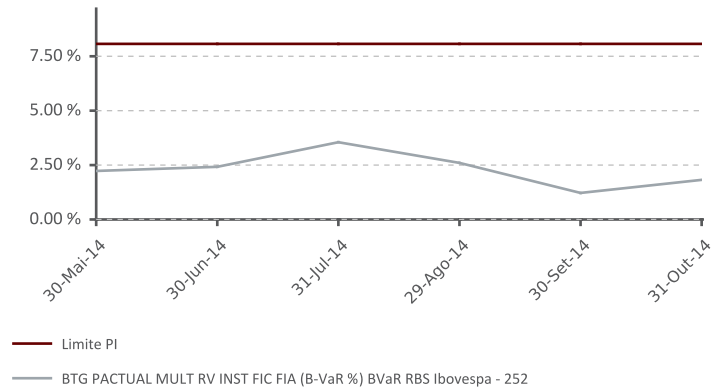
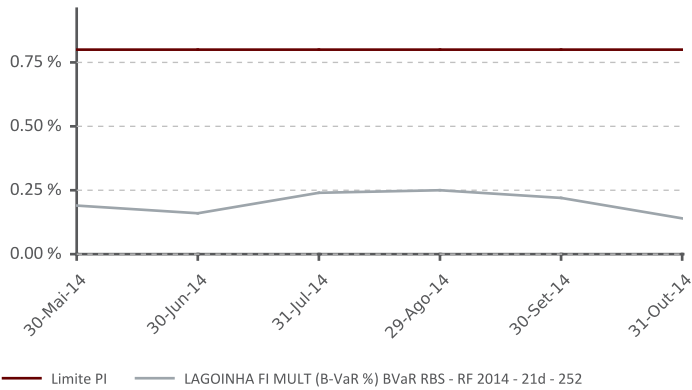


1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;
3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;
4. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO CV 2014-10-31

31/10/2014

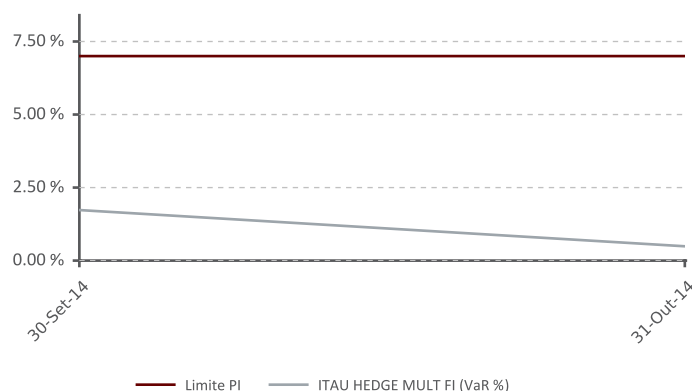
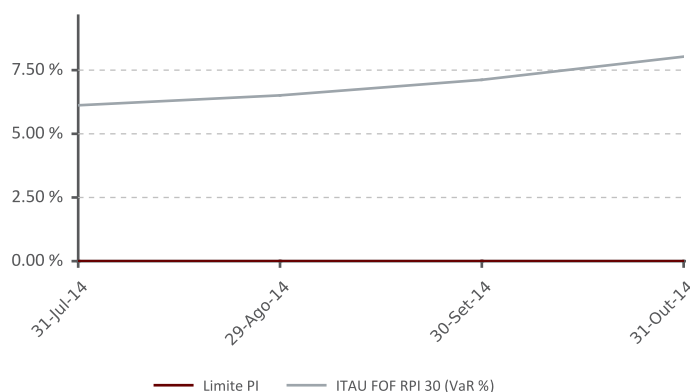
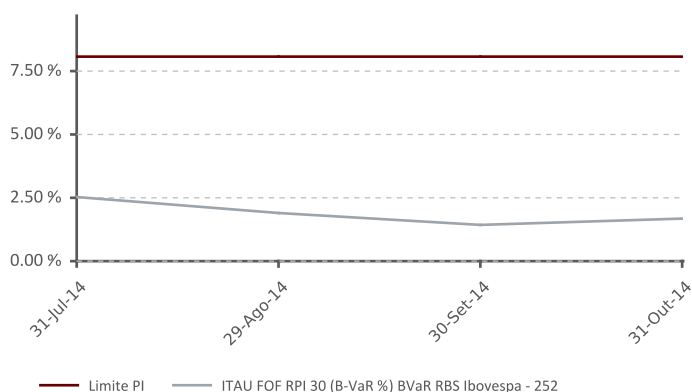


1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;
3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;
4. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO CV 2014-10-31

31/10/2014



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	24,982,500.79	63.81	10.88
Faixa 2	AA	8,730,010.33	22.30	3.80
Faixa 3	A	600,435.91	1.53	0.26
Faixa 4	BBB	4,836,543.46	12.35	2.11
Faixa 5	< BBB-	0.00	0.00	0.00
Sem Nota	-	3,023.58	0.01	0.00
Outros (*)	-	(318,691.04)	(0.81)	(0.14)
Total		39,152,514.06		

*Os valores apresentados em crédito privado não contemplam o financeiro dos swaps.

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	17.05	65.00	✓
Grau Especulativo	2.11	6.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	2,418,271.73	BCO BMG SA	Baa3.br	MOODY	LAGOINHA FI MULTIMERCADO
DPGE_cdi	2,418,271.73	BCO BMG SA	Baa3.br	MOODY	ITAPEMA FI MULTIMERCADO
CAIXA	8.30	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	CONSTELLATION FEEDER II INST FIA
CAIXA	16.80	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	55.46	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP II
CAIXA	55.46	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP III

- Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
- Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;
- O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;
- A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

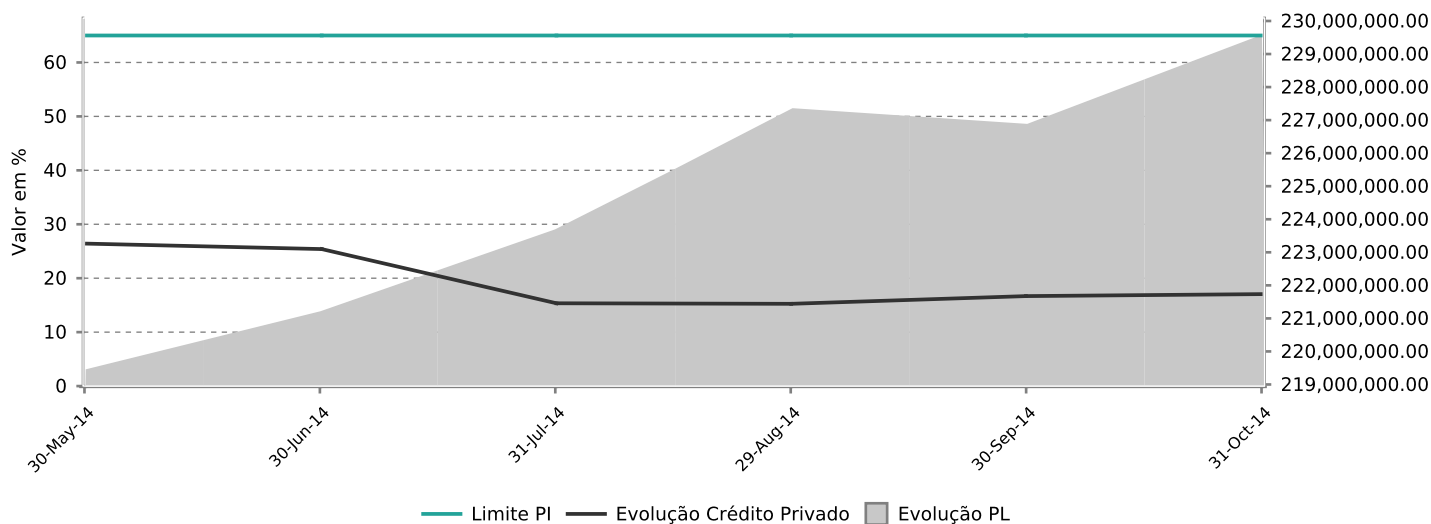
Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO CV 2014-10-31

31/10/2014

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
CAIXA	55.46	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IV
CAIXA	55.61	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IX
CAIXA	55.74	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP V
CAIXA	55.53	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP VI
CAIXA	55.60	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	55.57	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP X
CAIXA	55.63	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUID FI REF DI LP VIII
CAIXA	27.66	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL FC FI ACOES
CAIXA	30.60	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI ACOES
CAIXA	0.35	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX OVER FI CURTO PRAZO
CAIXA	130.43	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	STK LONG ONLY INSTITUCIONAL FI EM
CAIXA	2,297.08	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX ACOES FC FI ACOES INSTITUCIONAL
CAIXA	0.00	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX MASTER FI DE ACOES INSTITUCIONAL
CAIXA	12.27	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	POLLUX ACOES INSTIT. I FIC FI DE ACOES
CAIXA	0.00	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	POLLUX ACOES INSTIT. MASTER FI DE

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO CV 2014-10-31

31/10/2014

RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
ITAUSA INVESTS ITAU SA	7,872,758.76	3.43%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	6,814,476.55	2.97%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	6,259,246.47	2.73%	20.00%	✓
BCO BMG SA	4,836,543.46	2.11%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	2,737,060.93	1.19%	20.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	1,674,321.39	0.73%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	1,656,208.04	0.72%	10.00%	✓
OI SA	1,615,228.74	0.70%	10.00%	✓
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	1,522,636.22	0.66%	10.00%	✓
BR MALLS PARTICIPACOES SA	1,416,613.15	0.62%	10.00%	✓

1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;
3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;
4. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO CV 2014-10-31

31/10/2014

DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
ARX INCOME FI EM ACOES	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX CASH FI CURTO	0.00%	0.00%
ARX FUNDO DE INVESTIMENTO EM	0.00%	0.00%
ITAU SOBERANO REFERENCIADO DI LP	0.00%	0.00%
ITAU CAIXA ACOES FI	11.22%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
HSBC FI REFERENCIADO DI CASH	0.00%	0.00%
GAP ACOES FUNDO DE	0.00%	0.00%
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA	0.00%	0.00%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
TORRES FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX CASH V FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX CASH IV FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX CASH II FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX CASH III FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
OCEANA VALOR FI DE ACOES	0.00%	0.00%
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE	0.00%	0.00%
JGP INSTITUCIONAL FIA	0.00%	0.23%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI	0.00%	0.00%
BBM VALUATION MASTER FIA	26.40%	0.00%
POLLUX ACOES INSTIT. MASTER FI DE	0.00%	4.10%
POLLUX ACOES INSTIT. I FIC FI DE	0.00%	0.00%
BBM VALUATION II FIC DE FIA	0.00%	0.00%
SQUADRA INSTITUCIONAL FI DE	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL BOLSA INDEX	0.41%	0.00%
HSBC FI EM EM ACOES IBOVESPA	12.05%	0.00%
PACIFICO ACOES MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
PACIFICO ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION	0.00%	0.00%
ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION	0.00%	0.00%
BRASIL CAPITAL LONG ONLY FIC FI	0.00%	0.00%
BRASIL CAPITAL LONG ONLY MASTER	0.00%	0.00%
ITAU INST ACOES FOF MULTIGESTOR	0.00%	0.00%
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI	0.00%	0.00%

1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;

2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;

3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;

4. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO CV 2014-10-31

31/10/2014

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
NEO NAVITAS FIA	4.53%	0.00%
APEX MASTER FI DE ACOES	0.00%	2.94%
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	4.54%
EQUITAS SELEC INST MASTER FI	0.00%	0.00%
EQUITAS SELECTION INST FIC FI	0.00%	0.00%
ATMOS INSTITUCIONAL FI DE ACOES	0.00%	0.00%
SPX APACHE MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
STK LONG ONLY INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	0.00%
ITAU FOF RPI 30 ACOES FICFI	0.00%	0.00%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST M FI	0.00%	0.00%
APEX ACOES FC FI ACOES	0.00%	0.00%
ITAU FOF RPI 30 MASTER ACOES FI	0.00%	0.00%
SUL AMERICA INDICES FI RENDA FIXA	0.00%	0.00%
BOGARI VALUE INSTITUCIONAL FI DE	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX OVER FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
CONSTELLATION FEEDER II INST FIA	0.00%	1.35%
ITAU VERTICE IBOVESPA INDEX FICFI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
VERTRA INSTITUCIONAL FC FI ACOES	0.00%	0.00%
VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI	0.00%	0.00%
ATMOS INSTITUCIONAL MASTER FIA	0.00%	2.12%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUID FI REF DI LP	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS MASTER	0.00%	0.00%
INDIE INSTITUCIONAL FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
INDIE INSTITUCIONAL MASTER FI	0.00%	0.00%
VENOM FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS II FIC FI	0.00%	0.00%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	2.89%	0.00%
OCEANA VALOR MASTER FIA	0.00%	0.00%
RBSPREV PLANO CV	0.00%	0.00%
APAPORT FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
OSPREY FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*	0.80%	
Total do percentual gasto com compra de opções*	0.01%	

* Valores colhidos de forma bruta a partir das informações apresentadas pelo arquivo XML.

1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;
3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;
4. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO CV 2014-10-31

31/10/2014

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	86.02%	86.02%	10.00%	✓
7	1.16%	87.18%	-	-
21	0.20%	87.38%	20.00%	✓
Longo	12.62%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1,000,549.50	1,677,047,385.24	0.06%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	54,731,675.98	54,731,675.98	100.00%
TORRES FI MULTIMERCADO	50,031,653.20	50,031,653.19	100.00%
BRDESCO FI MULTIMERCADO TACTICAL	1,000,886.61	223,063,285.24	0.45%
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	7,493,438.95	330,309,222.83	2.27%
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	1,207,312.30	35,974,467.83	3.36%
ITAU FOF RPI 30 ACOES FICFI	3,033,250.61	62,338,530.03	4.87%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	52,946,694.85	52,946,694.84	100.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	58,134,489.83	58,134,489.82	100.00%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total Inf.	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	94.75%	91.50%	96.00%	✓
Renda Variável	4.38%	4.00%	6.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.87%	0.00%	2.00%	✓
Investimentos no Exterior	0.00%	-	-	-
Imóveis	0.00%	-	-	-
Empréstimos	0.00%	-	-	-

1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;

2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;

3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;

4. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

5. Os valores informados nos segmentos de imóveis e empréstimos são considerados como parte do total dos recursos garantidores do plano quando verificamos os limites de concentração estipulados na Resolução CMN 3.792.