



# RBSPREV PLANO CV

## Enquadramento Legal CMN 3792 RiskOffice

2014-09-30

### Limites de alocação

Modalidades de Investimento	Alocação	%	Limite	%	Status
<b>Renda fixa</b>	<b>R\$ 215.011.140,62</b>	<b>94,76%</b>	<b>R\$ 226.894.302,88</b>	<b>100,00%</b>	<b>✓</b>
Títulos da dívida mobiliária federal	R\$ 177.225.654,36	78,11%	R\$ 226.894.302,88	100,00%	✓
Ativos de renda fixa, exceto títulos da dívida mobiliária federal	R\$ 37.807.197,53	16,66%	R\$ 181.515.442,30	80,00%	✓
Cédulas de crédito bancário (CCB), certificados de cédulas de crédito bancário (CCCB) e notas promissórias (NP)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 45.378.860,58	20,00%	✓
Notas de crédito à exportação (NCE) e cédulas de crédito à exportação (CCE)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 45.378.860,58	20,00%	✓
Cotas de fundos de investimento em direitos creditórios (FIDC) e de fundo de cotas de FIDCs	R\$ 3.779.335,01	1,67%	R\$ 45.378.860,58	20,00%	✓
Certificados de recebíveis imobiliários (CRI)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 45.378.860,58	20,00%	✓
Cédulas de crédito imobiliário (CCI)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 45.378.860,58	20,00%	✓
Títulos do agronegócio (CPR; CDCA; CRA e Warrant Agropecuário)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 45.378.860,58	20,00%	✓
Demais títulos e valores mobiliários (exceto debêntures) de companhias abertas, exceto de securitizadoras	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 45.378.860,58	20,00%	✓
<b>Renda variável</b>	<b>R\$ 9.856.673,67</b>	<b>4,34%</b>	<b>R\$ 158.826.012,01</b>	<b>70,00%</b>	<b>✓</b>
Ações de companhias abertas admitidas à negociação no segmento Novo Mercado da BM&FBovespa	R\$ 4.823.962,71	2,13%	R\$ 158.826.012,01	70,00%	✓
Ações de companhias abertas admitidas à negociação no segmento Nível 2 da BM&FBovespa	R\$ 836.311,74	0,37%	R\$ 136.136.581,73	60,00%	✓
Ações de companhias abertas admitidas à negociação no segmento Bovespa Mais da BM&FBovespa	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 113.447.151,44	50,00%	✓
Ações de companhias abertas admitidas à negociação no segmento Nível 1 da BM&FBovespa	R\$ 3.479.285,15	1,53%	R\$ 102.102.436,29	45,00%	✓
Ações sem classificação de governança corporativa + cotas de fundos de índices de ações (inclui ETFs)	R\$ 1.323.868,07	0,58%	R\$ 79.413.006,01	35,00%	✓
Títulos e valores mobiliários de emissão de Sociedades de Propósito Específico (SPEs)	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 45.378.860,58	20,00%	✓
Debêntures com part. nos lucros + Cert. Potencial Adicional de Construção + Crédito de Carbono + Ouro	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 6.806.829,09	3,00%	✓
<b>Investimentos estruturados</b>	<b>R\$ 2.026.488,59</b>	<b>0,89%</b>	<b>R\$ 45.378.860,58</b>	<b>20,00%</b>	<b>✓</b>
Fundos de participação	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 45.378.860,58	20,00%	✓
Fundos Mútuos de Investimentos em Empresas Emergentes	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 45.378.860,58	20,00%	✓
Fundos imobiliários	R\$ 0,00	0,00%	R\$ 22.689.430,29	10,00%	✓
Fundos multimercado cujos regulamentos observem exclusivamente a legislação estabelecida pela CVM	R\$ 2.026.488,59	0,89%	R\$ 22.689.430,29	10,00%	✓
<b>Investimentos no exterior</b>	<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>R\$ 22.689.430,29</b>	<b>10,00%</b>	<b>✓</b>
<b>Imóveis</b>	<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>R\$ 18.151.544,23</b>	<b>8,00%</b>	<b>✓</b>
<b>Operações com participantes</b>	<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>R\$ 34.034.145,43</b>	<b>15,00%</b>	<b>✓</b>

## Derivativos

Limites	Limite	%	Status
Prêmio das opções	R\$ 9.063.621,16	5,00%	✓
Depósitos de margem	R\$ 27.190.863,48	15,00%	✓

## Limites de Concentração por plano

Emissores	Limite	%	Status
Instituição financeira autorizada a funcionar pelo Bacen	R\$ 45.378.860,58	20,00%	✓
Companhias abertas e securitizadoras	R\$ 22.689.430,29	10,00%	✓
Organismo multilateral	R\$ 22.689.430,29	10,00%	✓
Fundo de Investimento ou Fundo de Investimento em Cota de Fundo de Investimento Classificado como Dívida Externa	R\$ 22.689.430,29	10,00%	✓
Companhias limitadas	R\$ 11.344.715,14	5,00%	✓

## Limites de Concentração por plano

Veículos	Limite	%	Status
Fundo de investimento em direitos creditórios (FIDC)	R\$ 22.689.430,29	10,00%	✓
Fundo de índice referenciado em cesta de ações de companhias abertas (inclui ETFs)	R\$ 22.689.430,29	10,00%	✓
Fundo de Participação ou de Empresas Emergentes	R\$ 22.689.430,29	10,00%	✓
Fundo imobiliário	R\$ 22.689.430,29	10,00%	✓
Fundo Multimercado cujo regulamento observe exclusivamente a legislação estabelecida pela CVM	R\$ 22.689.430,29	10,00%	✓
Sociedades de propósito específico (SPE)	R\$ 22.689.430,29	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\$ 226.894.302,88

- 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).