

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO CV 2015-04-30

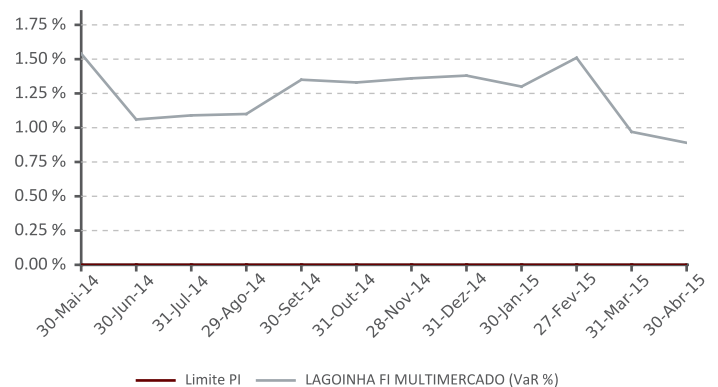
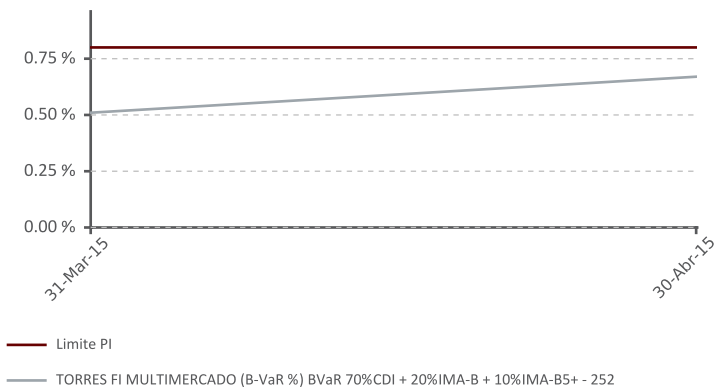
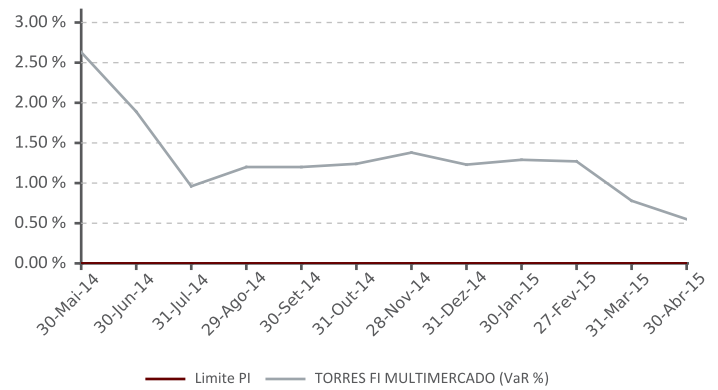
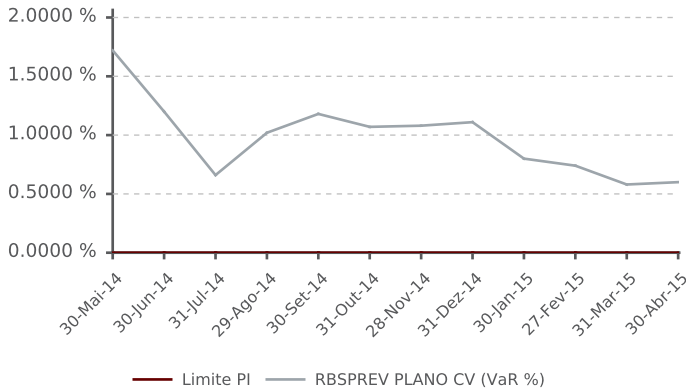
30/04/2015

## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO CV	-	239,608,344.99	239,513,030.32	0.60%	-	-	(5,646,996.23)	(2.36)%
TORRES FI MULTIMERCADO (PREV - 21D - 252)	-	51,975,620.15	51,972,759.82	0.55%	-	-	(1,134,055.86)	(2.18)%
TORRES FI MULTIMERCADO	70%CDI + 20%IMA-B + 10%IMA-B5+	51,975,620.15	51,972,759.82	0.67%	0.80%	✓	(1,134,055.86)	(2.18)%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO (PREV - 21D -	-	54,157,872.47	54,196,413.24	0.89%	-	-	(1,423,151.46)	(2.63)%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	70%CDI + 20%IMA-B + 10%IMA-B5+	54,157,872.47	54,196,413.24	0.34%	0.80%	✓	(1,423,151.46)	(2.63)%
ITAU FOF RPI 30 ACOES FICFI	IBOVESPA	61,113,813.30	61,118,794.37	1.75%	5.40%	✓	-	-
ITAU FOF RPI 30 ACOES FICFI (PREV - 21D -	-	74,658,940.27	74,663,763.88	8.37%	-	-	(10,713,466.64)	(14.35)%
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	IBOVESPA	23,209,529.91	23,210,577.45	2.54%	5.40%	✓	-	-
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	-	28,173,206.94	28,203,202.91	7.66%	-	-	(3,947,861.97)	(14.01)%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	-	58,682,881.14	58,498,735.92	0.78%	3.00%	✓	(803,961.10)	(1.37)%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	-	63,052,153.36	63,101,008.43	0.47%	3.00%	✓	(868,094.86)	(1.38)%
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	IBOVESPA	183,068,703.54	183,061,325.50	1.80%	5.40%	✓	-	-
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	-	215,393,359.35	215,505,410.94	8.34%	-	-	(32,500,078.28)	(15.09)%
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	-	1,480,049,656.79	1,536,414,890.24	1.66%	4.25%	✓	44,695,560.43	3.02%

\* 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

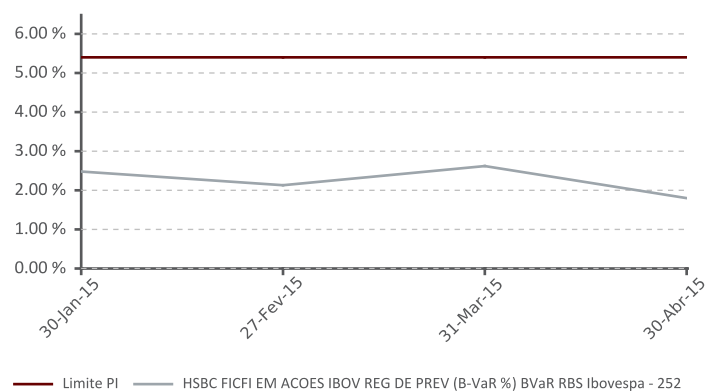
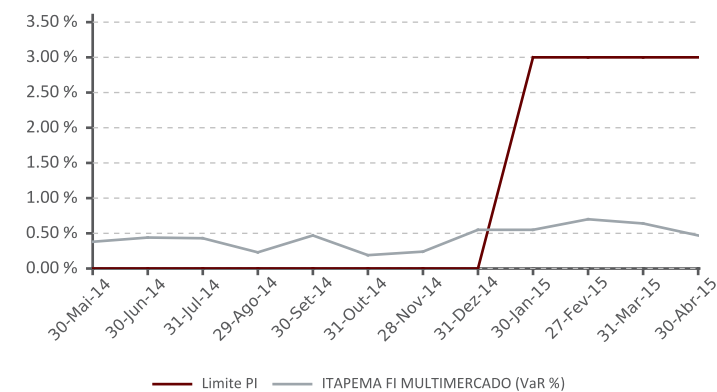
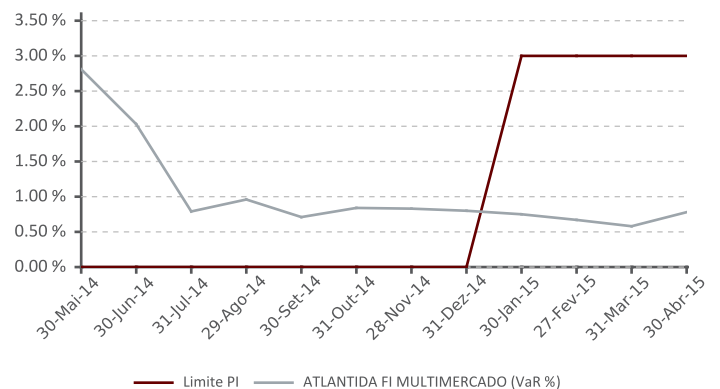
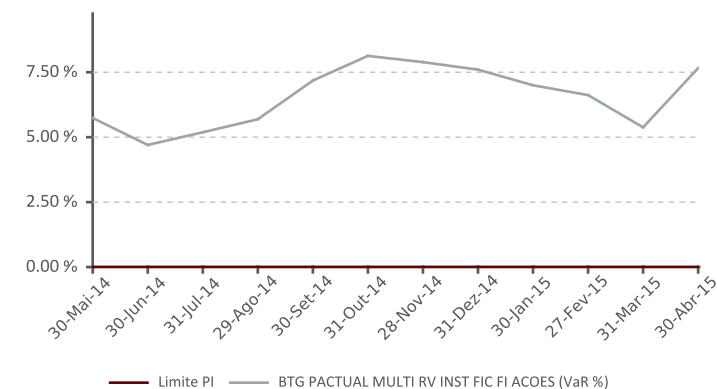
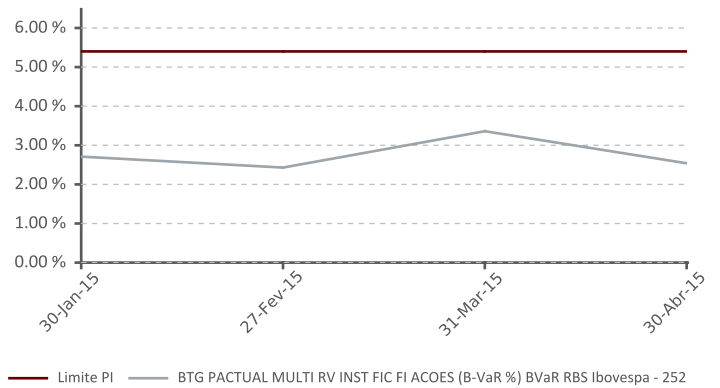
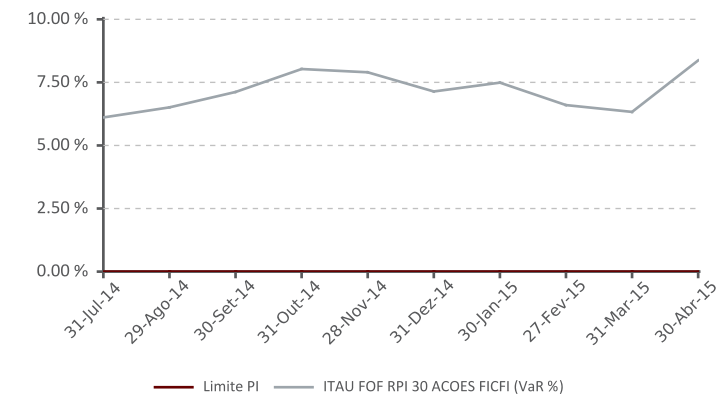
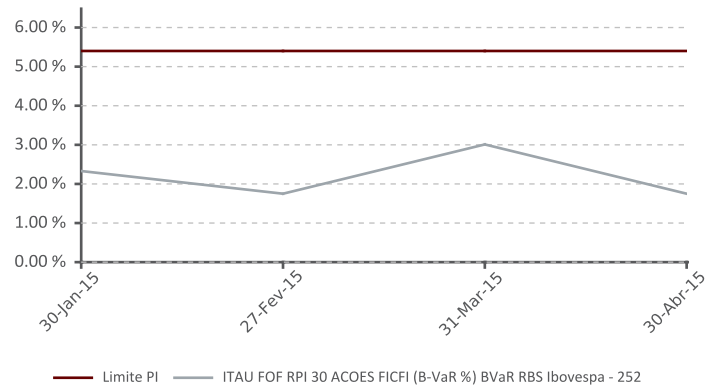
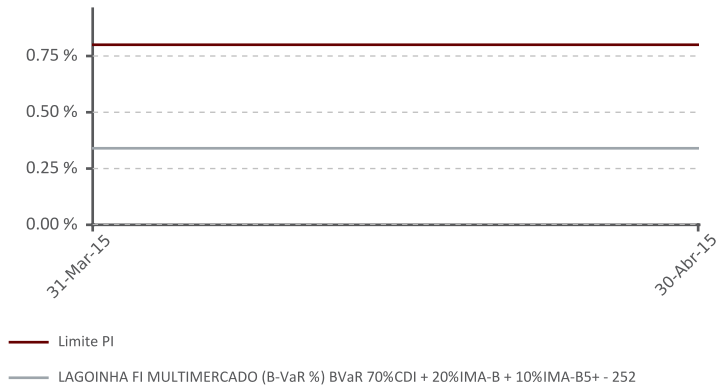


# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO CV 2015-04-30

30/04/2015



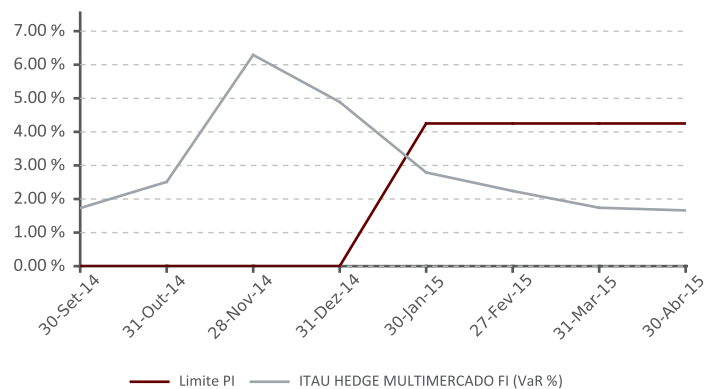
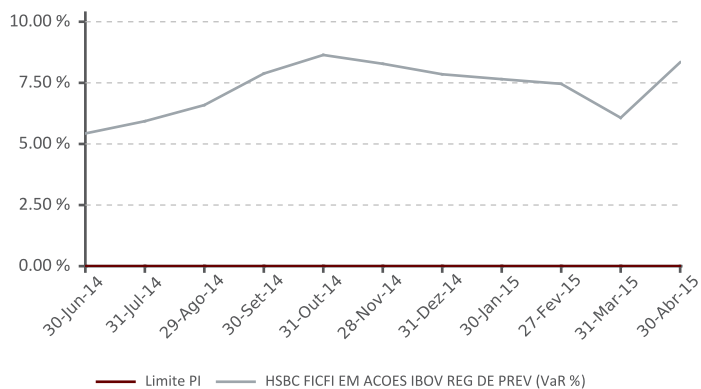
1. Este documento é de propriedade exclusiva da Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2015-04-30

30/04/2015



# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO CV 2015-04-30

30/04/2015

## RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	30,245,345.70	61.65	12.63
Faixa 2	AA	15,761,807.15	32.13	6.58
Faixa 3	A	480,337.81	0.98	0.20
Faixa 4	BBB	2,573,183.86	5.24	1.07
Faixa 5	< BBB-	0.00	0.00	0.00
Sem Nota	-	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	(117,192.99)	(0.24)	(0.05)
<b>Total</b>		<b>49,060,674.52</b>		

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

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	20.48	65.00	✓
Grau Especulativo	0.00	6.00	✓

## ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
CAIXA	51.58	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	POLLUX ACOES INSTIT. I FIC FI DE ACOES
CAIXA	12.54	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	POLLUX ACOES INSTIT. MASTER FI DE
CAIXA	0.59	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	1.82	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP II
CAIXA	1.82	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP III
CAIXA	1.82	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IV
CAIXA	1.85	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IX
CAIXA	2.09	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP V
CAIXA	1.96	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP VI
CAIXA	1.99	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	2.14	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP X
CAIXA	2.16	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUID FI REF DI LP VIII
CAIXA	31.41	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL FC FI ACOES
CAIXA	32.51	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI ACOES
CAIXA	0.11	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX OVER FI CURTO PRAZO
CAIXA	3.30	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	ATMOS INSTITUCIONAL FI DE ACOES
CAIXA	0.21	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	ATMOS INSTITUCIONAL MASTER FIA
CAIXA	0.69	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	STK LONG ONLY INSTITUCIONAL FI EM
CAIXA	2,586.99	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX ACOES FC FI ACOES INSTITUCIONAL
CAIXA	2.67	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX MASTER FI DE ACOES INSTITUCIONAL

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

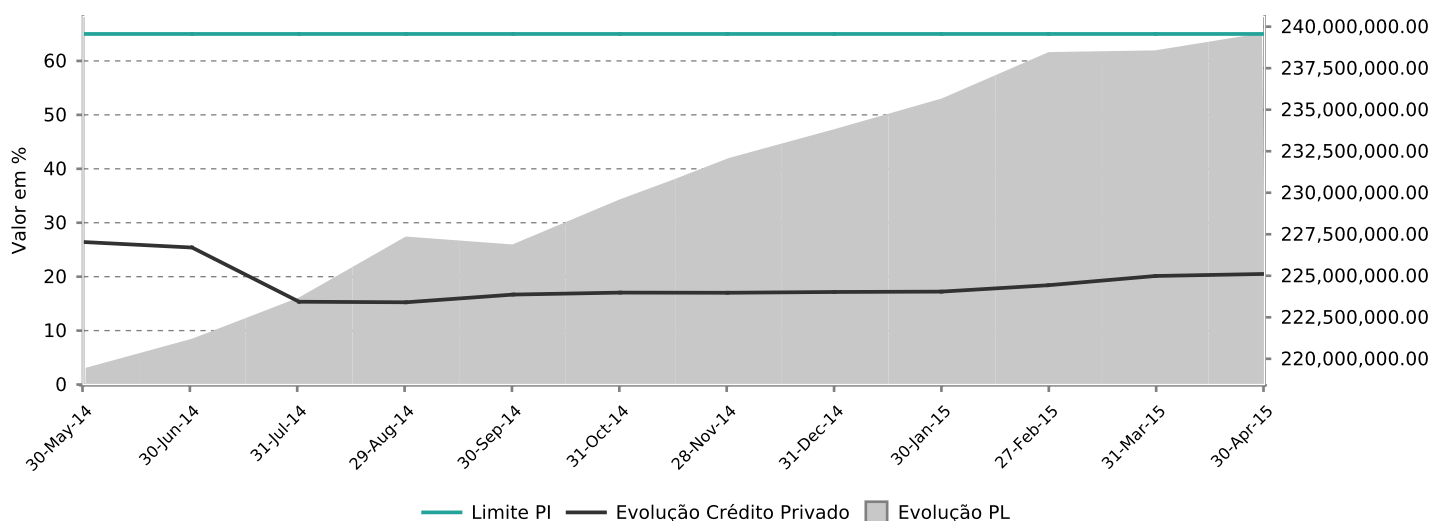
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;

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.



## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	11,251,309.09	4.70%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	7,835,760.09	3.27%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	6,572,654.59	2.74%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	4,127,870.11	1.72%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	2,903,058.74	1.21%	20.00%	✓
BCO BMG SA	2,573,183.86	1.07%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	2,087,714.48	0.87%	20.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	1,798,252.70	0.75%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	1,658,950.03	0.69%	10.00%	✓
OI SA	1,602,703.56	0.67%	10.00%	✓

## DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
BNY MELLON ARX CASH FI CURTO	0.00%	0.00%
ITAU SOBERANO REFERENCIADO DI LP	0.00%	0.00%
ITAU CAIXA ACOES FI	13.60%	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%	0.30%
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA	0.00%	0.00%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.04%
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%

1. Este documento é de propriedade exclusiva da 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 2015-04-30

30/04/2015

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
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%	0.00%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI	0.00%	0.00%
BBM VALUATION MASTER FIA	43.16%	0.00%
POLLUX ACOES INSTIT. MASTER FI DE	0.00%	0.00%
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	0.36%	0.00%
SUL AMERICA RENDA FIXA ATIVO FI	0.00%	0.00%
HSBC FI EM EM ACOES IBOVESPA	9.84%	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%
ITAU INST ACOES FOF MULTIGESTOR	0.00%	0.00%
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI	0.00%	0.00%
NEO NAVITAS FIA	0.00%	0.00%
APEX MASTER FI DE ACOES	0.00%	0.36%
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	0.43%
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%
BNY MELLON ARX LONG TERM INSTIT	0.00%	0.00%
BOGARI VALUE INSTITUCIONAL FI DE	0.00%	0.69%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX OVER FI CURTO	0.00%	0.00%
GAP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%

1. Este documento é de propriedade exclusiva da 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 2015-04-30

30/04/2015

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
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%	2.19%
ATMOS INSTITUCIONAL MASTER FIA	0.00%	0.00%
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	0.00%	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%
NEO NAVITAS MASTER FIA	0.00%	0.00%
NORMANDIE FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
ITAU RF JUROS OCEAN FI	0.00%	0.00%
NORMANDIE MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
<b>Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*</b>	<b>0.10%</b>	
<b>Total do percentual gasto com compra de opções*</b>		<b>0.02%</b>

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

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	82.75%	82.75%	10.00%	✓
7	1.40%	84.14%	-	-
21	0.56%	84.71%	20.00%	✓
Longo	15.29%	100.00%	-	-

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	2,103,389.51	1,528,595,934.90	0.14%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	58,498,735.92	58,498,735.92	100.00%
TORRES FI MULTIMERCADO	51,972,759.82	51,972,759.82	100.00%
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	5,302,524.53	215,505,410.95	2.46%
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	1,259,036.88	28,203,202.91	4.46%
ITAU FOF RPI 30 ACOES FICFI	3,079,161.99	74,663,763.88	4.12%

1. Este documento é de propriedade exclusiva da 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 2015-04-30

30/04/2015

Fundos	Alocação	PL	% PL
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	54,196,413.24	54,236,451.00	99.93%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	63,101,008.43	63,104,383.74	99.99%

## ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	95.76%	90.00%	99.00%	✓
Renda Variável	3.36%	1.00%	5.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.88%	0.00%	2.00%	✓

1. Este documento é de propriedade exclusiva da 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.