



### Risco de Mercado

#### Patrimônio Líquido

PL Calculado	128.404.530,07
PL Informado	128.444.452,99
PL Calculado a Mercado	128.404.530,07

#### Value At Risk

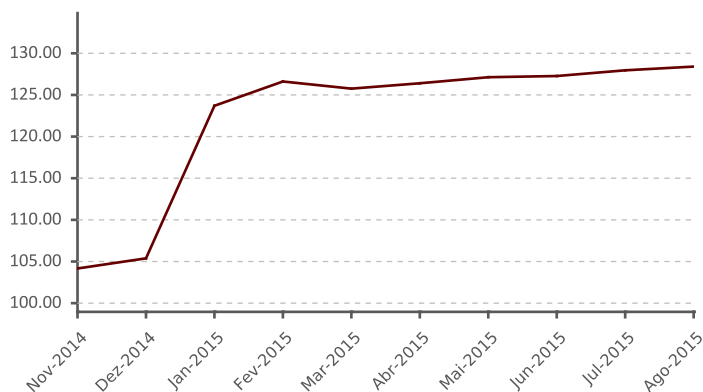
Value-at-Risk	635.348,88
Value-at-Risk (%)	0,4948

#### Parâmetros Para Cálculo Do VaR

Modelo	Non-Parametric
Nível de Confiança	95%
Horizonte de Tempo	21

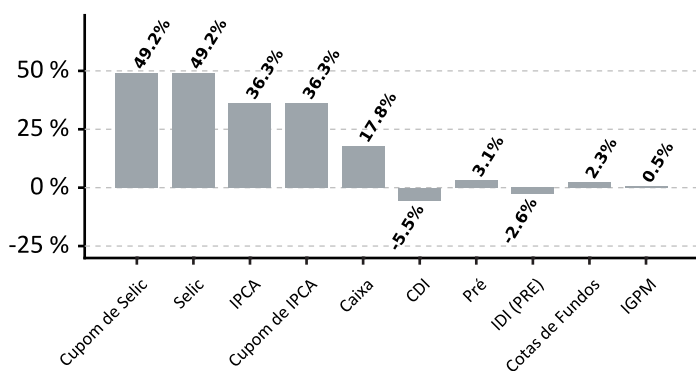
### Evolução do PL

(em milhões)

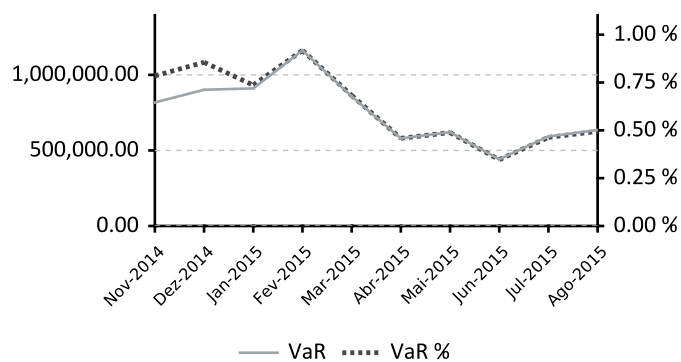


### Distribuição Percentual da Carteira por Fator de Risco

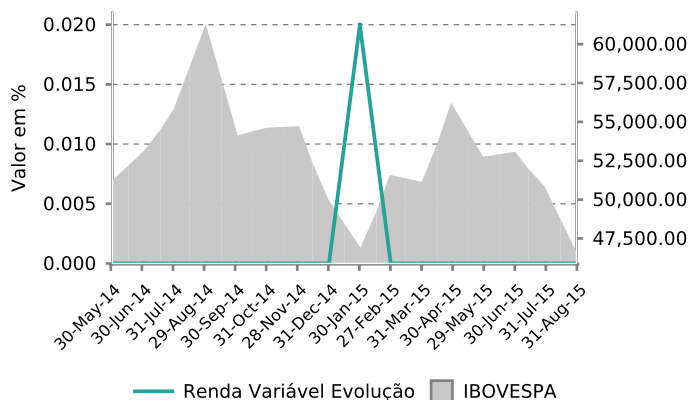
(% sobre PL Calculado)



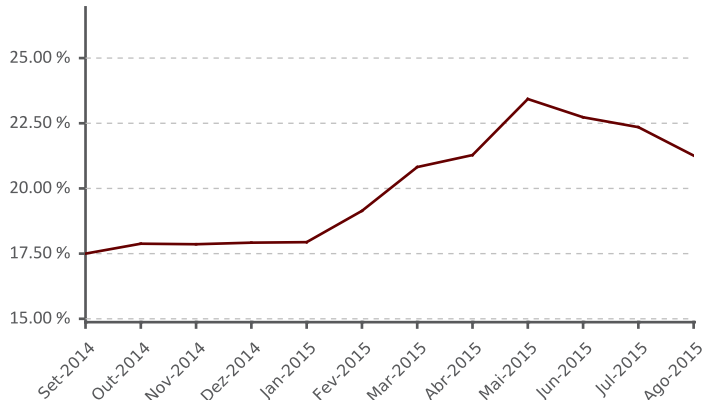
### Evolução do VaR



### Alocação em Renda Variável



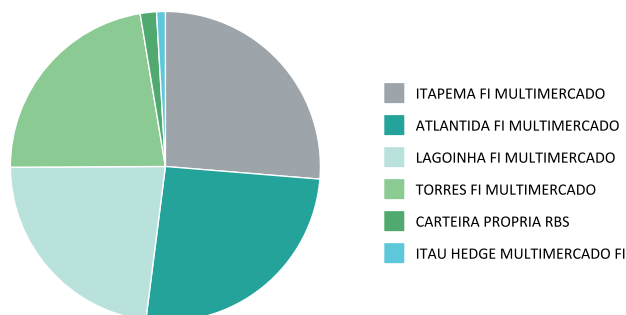
### Evolução de Crédito Privado





### Composição do Plano

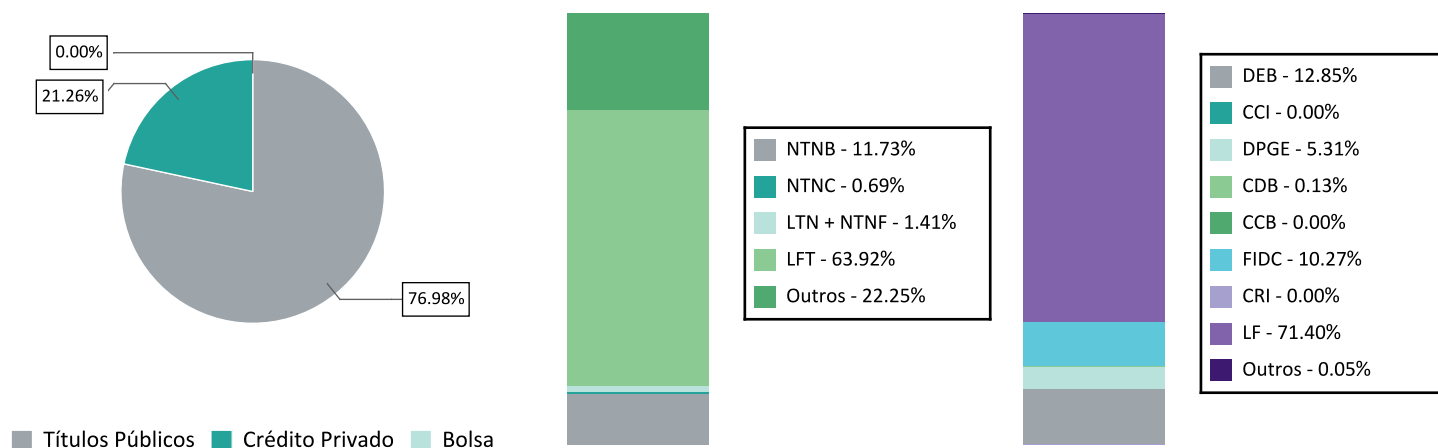
Book	Valor
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	33.785.529,88
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	33.029.649,73
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	29.418.958,93
TORRES FI MULTIMERCADO	28.860.003,87
CARTEIRA PROPRIA RBS	2.175.997,69
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1.174.312,28



### Participação por Classe de Ativos

Fatores de Risco	(% )			Dur. Ativa (du)			Dur. Passiva (du)		
	31/08/2015	31/07/2015	30/06/2015	31/08/2015	31/07/2015	30/06/2015	31/08/2015	31/07/2015	30/06/2015
CDI	(5,48)%	(3,56)%	(5,39)%	-	-	-	-	-	-
Caixa	17,82%	14,91%	11,33%	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos	2,26%	3,08%	3,14%	-	-	-	-	-	-
Cupom de IGPM	0,53%	0,54%	0,55%	1.178,80	1.202,85	1.227,58	0,00	0,00	0,00
Cupom de IPCA	36,29%	39,49%	41,80%	536,40	635,14	713,38	0,00	0,00	0,00
Cupom de Selic	49,20%	48,12%	50,06%	840,23	844,01	846,52	0,00	0,00	0,00
IDI (PRE)	(2,63)%	(0,99)%	(1,62)%	-	-	-	-	-	-
IGPM	0,53%	0,54%	0,55%	-	-	-	-	-	-
IPCA	36,29%	39,49%	41,80%	-	-	-	-	-	-
Pré	3,14%	(0,17)%	1,58%	315,79	104,87	224,60	163,75	42,97	98,85
Selic	49,20%	48,12%	50,06%	-	-	-	-	-	-

### Alocação em Títulos Públicos e Privados





## RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

31/Ago/2015

### Maiores Exposições Consolidado 10+

Contraparte	MtM Info	MtM Info (%)
SECRETARIA TESOUREIRO NACIONAL	76.851.699,49	59,83
BCO BRADESCO SA	6.288.205,46	4,90
BCO BRASIL SA	3.653.307,11	2,84
ITAUSA INVESTS ITAU SA	3.500.241,02	2,73
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	2.271.262,80	1,77
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	2.017.509,59	1,57
BCO BMG SA	1.452.143,03	1,13
BCO VOTORANTIM SA	1.442.290,55	1,12
FUNDO INVEST DIREITOS	1.023.159,67	0,80
SONAE SIERRA BRASIL SA	866.872,55	0,67

### Basiléia Emissores

Contraparte	Basiléia	MtM Info
BCO BMG SA	26,70	1.452.143,03
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	17,50	2.017.509,59
ITAUSA INVESTS ITAU SA	16,90	3.500.241,02
BCO BRADESCO SA	16,50	6.288.205,46
BCO BRASIL SA	16,10	3.653.307,11
BCO VOTORANTIM SA	15,00	1.442.290,55
BCO GMAC SA	14,20	168.808,12
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	13,60	236.188,92
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	13,10	2.271.262,80



### Aquisições durante o Mês

#### Títulos Privados

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
LF CDI - BBDC	BBDC	2.050.117,62	0,00	105.25	20/02/2018	Aaa.br	MOODY	ITAPEMA FI MULTIMERCADO
LF CDI - BBDC	BBDC	2.050.117,62	0,00	105.25	20/02/2018	Aaa.br	MOODY	LAGOINHA FI MULTIMERCADO

#### Títulos Públicos

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	19.356,19	6,80	7,05	15/05/2055	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	34.364,63	6,81	7,05	15/08/2050	SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP
NTNB	65.224,64	6,81	7,05	15/08/2050	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	126.201,06	6,81	7,05	15/08/2050	LAGOINHA FI MULTIMERCADO
NTNB	43.010,69	6,78	7,05	15/05/2045	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	21.076,17	6,78	7,05	15/08/2040	SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP
NTNB	23.941,90	6,78	7,05	15/08/2040	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	25.462,28	6,90	7,16	15/05/2035	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	44.385,28	6,87	7,11	15/08/2030	SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP
NTNB	18.529,01	6,87	7,11	15/08/2030	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	27.169,25	6,98	7,19	15/08/2024	SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP
NTNB	26.746,58	6,98	7,19	15/08/2024	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	33.322,25	7,01	7,23	15/05/2023	SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP
NTNB	546.881,54	7,01	7,23	15/05/2023	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	34.920,12	7,01	7,23	15/05/2023	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	102.984,88	7,01	7,23	15/05/2023	ITAU VERSO J RF FI
NTNB	12.222,38	6,99	7,23	15/08/2022	SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP
NTNB	55.194,50	6,99	7,23	15/08/2022	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	4.306,58	7,06	7,23	15/08/2020	SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP
NTNB	999.852,14	7,06	7,23	15/08/2020	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI
NTNB	544.823,08	7,12	7,30	15/05/2019	SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP
NTNB	31.622,48	7,12	7,30	15/05/2019	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI
NTNB	661,91	7,12	7,30	15/05/2019	SUL AMERICA INDICES FI RENDA FIXA LP
NTNB	25.096,76	7,05	7,25	15/08/2018	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI
NTNB	59.575,48	6,84	7,06	15/05/2017	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI
NTNB	27.732,08	7,28	7,42	15/08/2016	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI