

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR 2015-12-31

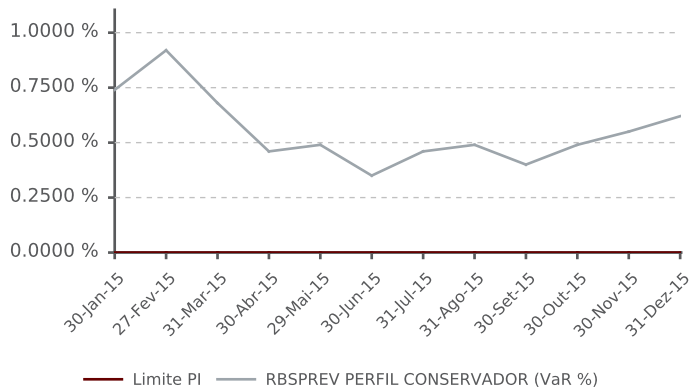
31/12/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PERFIL CONSERVADOR	-	134,170,400.25	134,161,550.37	0.62%	-	-	(1,633,088.59)	(1.22)%

* 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



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.
Faixa 1	<= AAA	29,854,286.18	100.00	22.25
Faixa 2	<= AA+	20,906,043.15	70.03	15.58
Faixa 3	<= A+	369,113.13	1.24	0.28
Faixa 4	<= BBB+	0.00	0.00	0.00
Faixa 5	<= BB+	0.00	0.00	0.00
-	Sem Nota	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	567,546.98	1.90	0.42

Total Crédito Privado

29,854,286.18

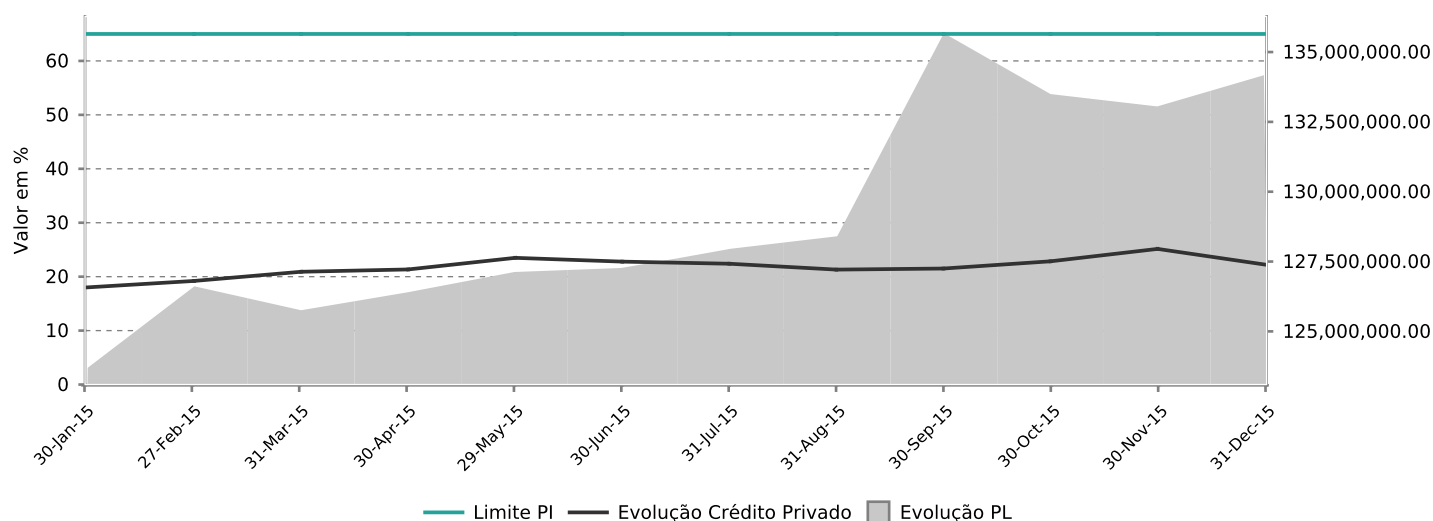
*Contempla o financeiro dos Swaps intermediados pela BM&FBovespa e/ou com garantia.

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	22.25	65.00	✓
Grau Especulativo	0.00	6.00	✓



EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	6,430,261.14	4.79%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	5,372,793.45	4.00%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	4,164,606.41	3.10%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	2,325,446.28	1.73%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	1,855,497.40	1.38%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	1,821,060.00	1.36%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	1,631,311.92	1.22%	20.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	972,507.02	0.72%	10.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	872,033.46	0.65%	10.00%	✓
BR MALLS PARTICIPACOES SA	816,033.53	0.61%	10.00%	✓

DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA	0.00%	0.00%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	1.37%	0.01%
TORRES FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5	0.00%	0.00%
ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION	0.00%	0.00%
SUL AMERICA INDICES FI RENDA FIXA	0.00%	0.00%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
RBSPREV PERFIL CONSERVADOR	0.00%	0.00%
ITAU RF JUROS OCEAN FI	0.00%	0.00%
ITAU VERSO J RF FI	0.00%	0.00%

Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia* 0.38%

Total do percentual gasto com compra de opções* 0.00%

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

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR 2015-12-31

31/12/2015

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	80.58%	80.58%	10.00%	✓
21	3.17%	83.75%	20.00%	✓
Longo	16.25%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1,255,168.31	1,597,210,877.75	0.08%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	34,340,218.21	59,481,263.58	57.73%
TORRES FI MULTIMERCADO	30,974,442.46	53,651,347.38	57.73%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	31,440,144.86	54,457,998.25	57.73%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	36,151,576.53	62,618,747.50	57.73%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.06%	97.50%	100.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.94%	0.00%	2.50%	✓

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.