

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL MODERADO 2015-12-31

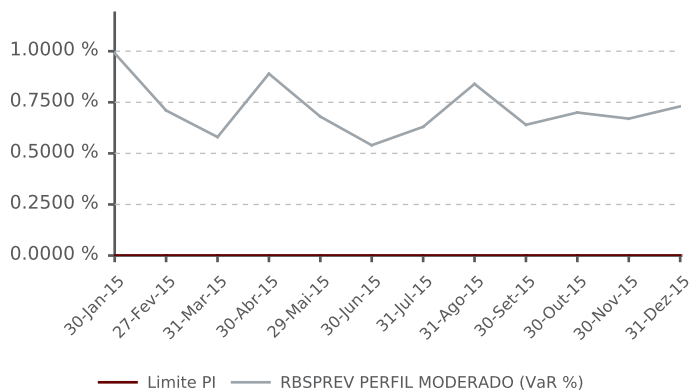
31/12/2015

## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PERFIL MODERADO	-	101,720,456.55	101,720,629.39	0.73%	-	-	(1,563,566.80)	(1.54)%

\* 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	21,877,841.87	100.00	21.51
Faixa 2	<= AA+	15,326,588.92	70.06	15.07
Faixa 3	<= A+	274,412.09	1.25	0.27
Faixa 4	<= BBB+	4,174.54	0.02	0.00
Faixa 5	<= BB+	4,174.54	0.02	0.00
-	Sem Nota	4,174.54	0.02	0.00
Outros (*)	-	415,510.59	1.90	0.41

**Total Crédito Privado 21,877,841.87**

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

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

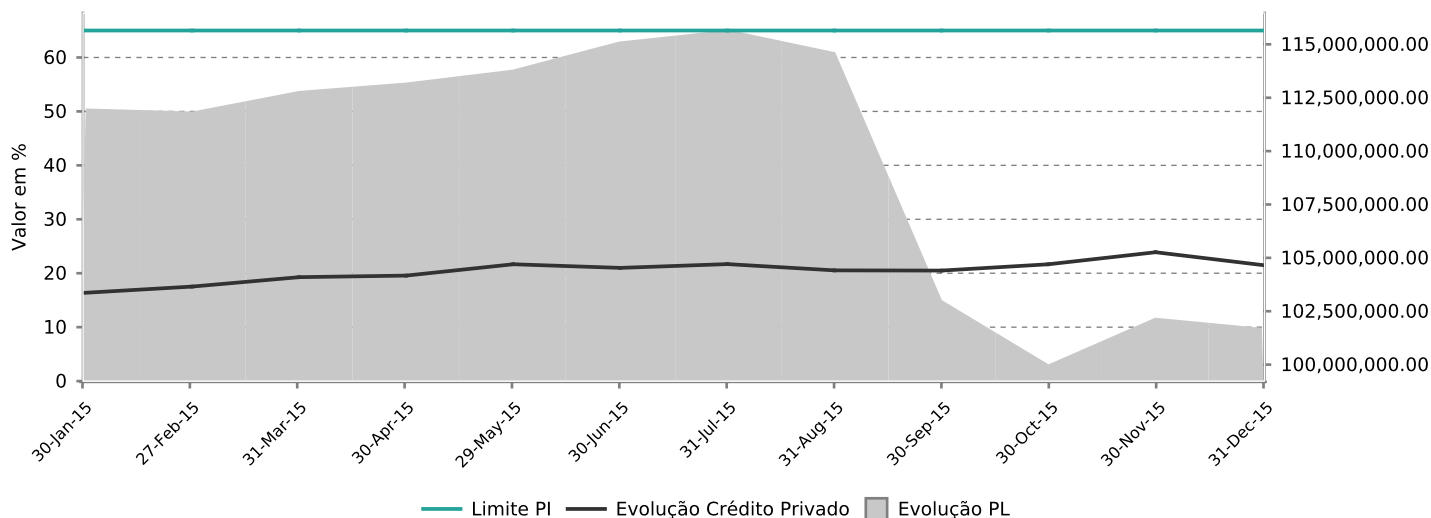
	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	21.51	65.00	✓
Grau Especulativo	0.00	6.00	✓



## ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
CAIXA	32.75	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL FC FI ACOES
CAIXA	607.35	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI ACOES
CAIXA	0.99	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX OVER FI CURTO PRAZO
CAIXA	3,533.49	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX ACOES FIC FI ACOES INSTITUCIONAL
CAIXA	3.71	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX MASTER FI DE ACOES INSTITUCIONAL
CAIXA	0.24	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	0.72	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP II
CAIXA	0.72	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP III
CAIXA	0.77	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IV
CAIXA	0.84	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IX
CAIXA	0.83	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP V
CAIXA	0.79	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP VI
CAIXA	0.80	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	0.84	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP X
CAIXA	0.85	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUID FI REF DI LP VIII
CAIXA	(11.15)	EQUATORIAL ENERGIA SA	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI ACOES

## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO





## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	4,861,215.74	4.78%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	4,187,247.26	4.12%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	3,055,813.80	3.00%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	1,702,497.93	1.67%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	1,359,178.86	1.34%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	1,333,228.34	1.31%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	1,194,310.61	1.17%	20.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	711,988.58	0.70%	10.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	638,430.21	0.63%	10.00%	✓
BR MALLS PARTICIPACOES SA	608,033.75	0.60%	10.00%	✓

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.



## 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 CAIXA ACOES FI	11.32%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO	0.00%	0.00%
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA	0.00%	0.00%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	1.37%	0.01%
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%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5	0.00%	0.00%
JGP INSTITUCIONAL FIA	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL BOLSA INDEX	0.56%	0.00%
IBIUNA EQUITIES MASTER FI EM	0.00%	0.00%
PACIFICO ACOES MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION	0.00%	0.00%
ITAU INST ACOES FOF MULTIGESTOR	0.00%	0.00%
APEX MASTER FI DE ACOES	0.00%	0.68%
APEX ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	2.71%
BLACKROCK INST IBOVESPA YIELD FI	0.00%	0.00%
SUL AMERICA INDICES FI RENDA FIXA	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%
PACIFICO RV FIC FI ACOES	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%
PACIFICO RV MASTER FI ACOES	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%

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 PERFIL MODERADO 2015-12-31

31/12/2015

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI	0.00%	0.55%
ITAU FOF RPI MASTER ACOES IBOV	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%
INDIE INSTITUCIONAL FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
INDIE INSTITUCIONAL MASTER FI	0.00%	0.00%
BRASIL PLURAL MACRO FIC FI MULTI	0.00%	0.00%
BRASIL PLURAL MACRO FI MULTI	0.00%	6.04%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
OCEANA VALOR MASTER FIA	0.00%	0.05%
RBSPREV PERFIL MODERADO	0.00%	0.00%
BRASIL PLURAL FI DE ACOES	0.00%	0.00%
BRASIL PLURAL FC FI DE ACOES	0.00%	0.00%
OCEANA VALOR A FIC FI DE ACOES	0.00%	0.00%
ITAU RF JUROS OCEAN FI	0.00%	0.00%
ITAU VERSO J RF FI	0.00%	0.00%
IBIUNA EQUITIES A FC DE FI EM	0.00%	0.00%
NORMANDIE MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
NORMANDIE FIC FI ACOES	0.00%	0.00%

Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia\* 0.37%

Total do percentual gasto com compra de opções\* 0.06%

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

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	81.31%	81.31%	10.00%	✓
21	2.99%	84.30%	20.00%	✓
Longo	15.70%	100.00%	-	-

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	918,929.61	1,597,210,877.75	0.06%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	2,485,247.67	422,194,003.63	0.59%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	25,141,045.37	59,481,263.58	42.27%
TORRES FI MULTIMERCADO	22,676,904.92	53,651,347.38	42.27%
BRASIL PLURAL MACRO FIC FI MULTI	1,015,832.35	57,159,699.13	1.78%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	23,017,853.40	54,457,998.25	42.27%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	26,467,170.95	62,618,747.50	42.27%

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.



## ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	96.54%	82.00%	98.00%	✓
Renda Variável	2.43%	2.00%	10.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.90%	0.00%	4.00%	✓
Investimentos no Exterior	0.13%	0.00%	4.00%	✓

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.