



Risco de Mercado

Patrimônio Líquido

PL Calculado	127.269.260,51
PL Informado	127.157.984,40
PL Calculado a Mercado	127.269.260,51

Value At Risk

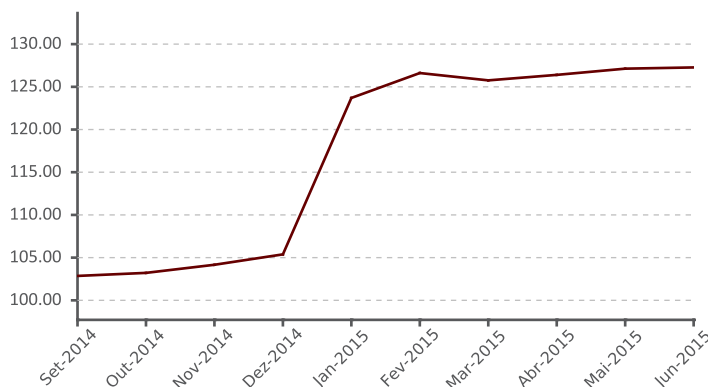
Value-at-Risk	441.083,43
Value-at-Risk (%)	0,3466

Parâmetros Para Cálculo Do VaR

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

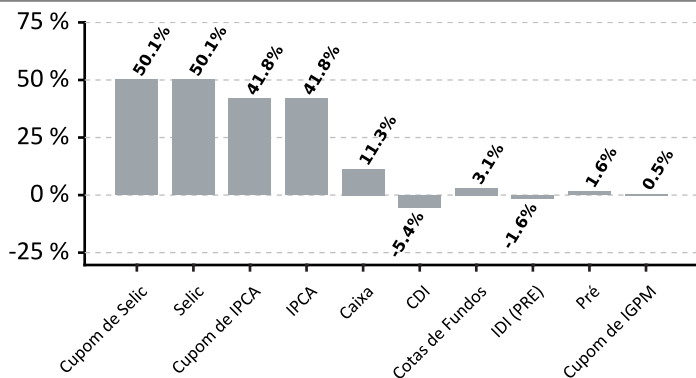
Evolução do PL

(em milhões)

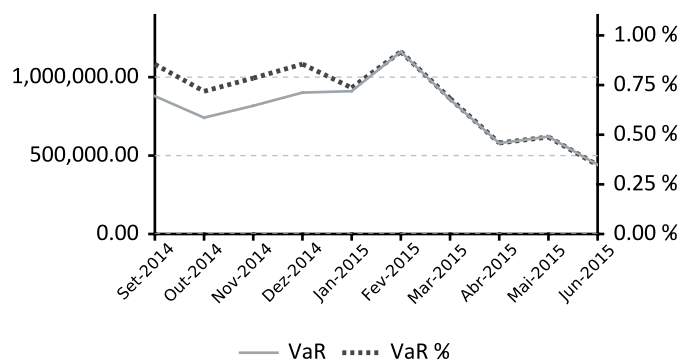


Distribuição Percentual da Carteira por Fator de Risco

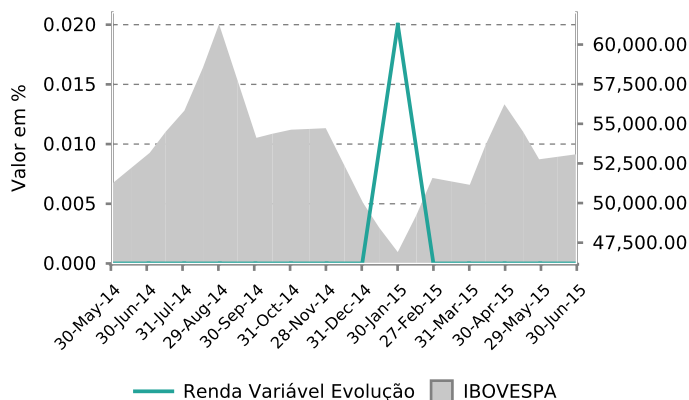
(% sobre PL Calculado)



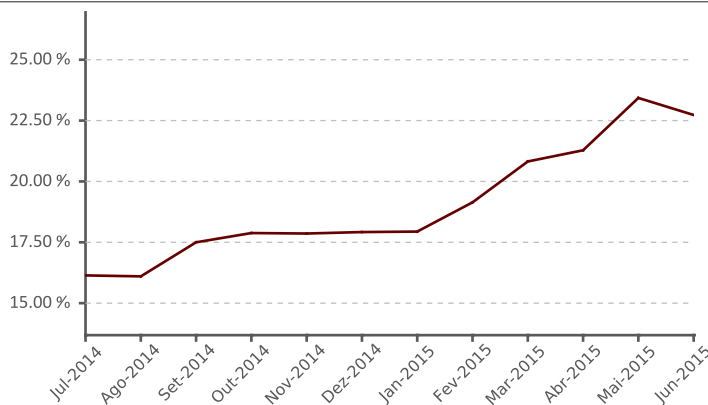
Evolução do VaR



Alocação em Renda Variável



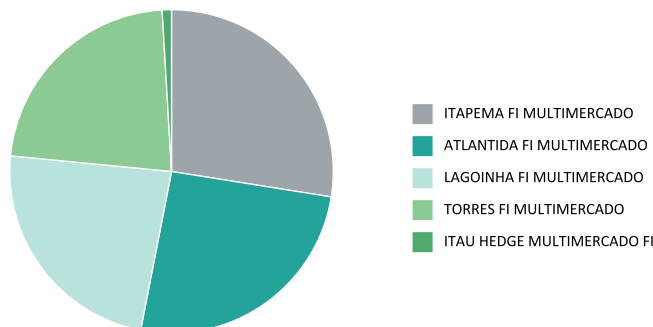
Evolução de Crédito Privado





Composição do Plano

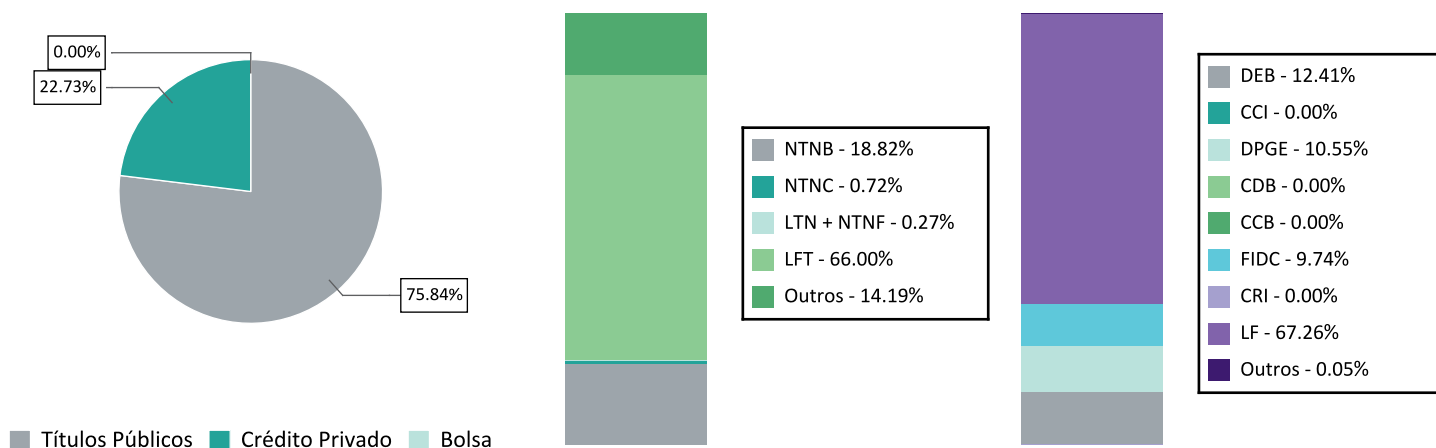
Book	Valor
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	34.985.930,67
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	32.486.435,34
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	29.855.717,91
TORRES FI MULTIMERCADO	28.652.604,54
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1.177.295,95



Participação por Classe de Ativos

Fatores de Risco	%			Dur. Ativa (du)			Dur. Passiva (du)		
	30/06/2015	29/05/2015	30/04/2015	30/06/2015	29/05/2015	30/04/2015	30/06/2015	29/05/2015	30/04/2015
CDI	(5,39)%	(10,54)%	(12,15)%	-	-	-	-	-	-
Caixa	11,33%	19,86%	20,52%	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos	3,14%	3,14%	2,57%	-	-	-	-	-	-
Cupom de IGPM	0,55%	0,55%	0,55%	1.227,58	1.249,35	1.269,30	0,00	0,00	0,00
Cupom de IPCA	41,80%	41,14%	41,05%	713,38	737,99	695,87	0,00	0,00	0,00
Cupom de Selic	50,06%	41,11%	42,59%	846,52	723,04	708,65	0,00	0,00	0,00
IDI (PRE)	(1,62)%	(0,09)%	(2,69)%	-	-	-	-	-	-
IGPM	0,55%	0,55%	0,55%	-	-	-	-	-	-
IPCA	41,80%	41,14%	41,05%	-	-	-	-	-	-
Pré	1,58%	6,28%	8,90%	224,60	538,45	345,15	98,85	292,92	209,62
Selic	50,06%	41,11%	42,59%	-	-	-	-	-	-

Alocação em Títulos Públicos e Privados





RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

30/Jun/2015

Maiores Exposições Consolidado 10+

Contraparte	MtM Info	MtM Info (%)
SECRETARIA TESOUREIRO NACIONAL	82.828.266,91	65,14
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	6.276.723,05	4,94
ITAUSA INVESTS ITAU SA	3.646.466,00	2,87
BCO BRASIL SA	3.605.870,08	2,84
BCO BRADESCO SA	2.167.309,34	1,70
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	1.998.559,18	1,57
BCO INDL COML SA BICBANCO	1.619.673,09	1,27
BCO BMG SA	1.437.547,35	1,13
BCO VOTORANTIM SA	1.425.459,46	1,12
FUNDO INVEST DIREITOS	1.008.275,47	0,79

Basiléia Emissores Crédito Privado

Contraparte	Basiléia	MtM Info
BCO BMG SA	26,70	1.437.547,35
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	17,50	1.998.559,18
ITAUSA INVESTS ITAU SA	16,90	3.646.466,00
BCO BRADESCO SA	16,50	2.167.309,34
BCO BRASIL SA	16,10	3.605.870,08
BCO VOTORANTIM SA	15,00	1.425.459,46
BCO GMAC SA	14,20	167.001,87
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	13,60	233.928,41
BCO INDL COML SA BICBANCO	13,60	1.619.673,09
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	13,10	6.276.723,05



Aquisições durante o Mês

Títulos Públicos

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	52.400,47	5,95	6,09	15/05/2055	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	812.998,35	5,93	6,06	15/08/2050	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	521.607,15	5,94	6,12	15/05/2045	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	263.875,79	5,94	6,13	15/08/2040	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	267.727,94	6,00	6,17	15/05/2035	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	203.715,12	5,96	6,15	15/08/2030	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	316.248,36	6,17	6,36	15/08/2024	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	246.332,83	6,26	6,49	15/05/2023	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	567.960,09	6,25	6,44	15/08/2022	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	365.633,98	6,45	6,61	15/08/2020	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	261.171,84	6,61	6,73	15/05/2019	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI
NTNB	31.814,32	6,56	6,70	15/08/2018	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI
NTNB	29.837,46	6,42	6,68	15/05/2017	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI
NTNB	400.111,81	6,16	7,21	15/08/2016	SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP
NTNB	6.065,21	6,16	7,21	15/08/2016	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI

Alterações de Ratings

Títulos Privados

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
LF CDI - BCGM	BCO GMAC SA	FR	AA-(bra)	AA+(bra)	Emissão	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO