

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO CV 2015-03-31

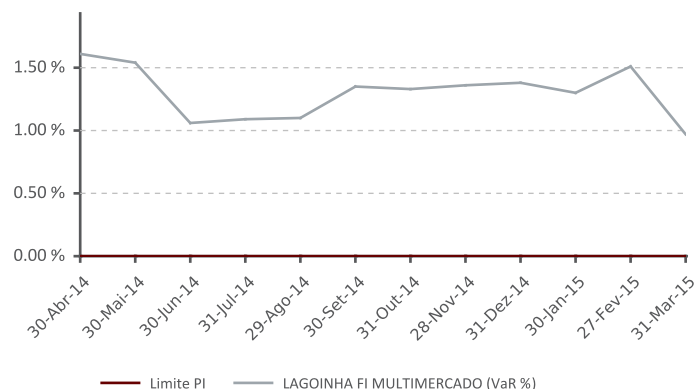
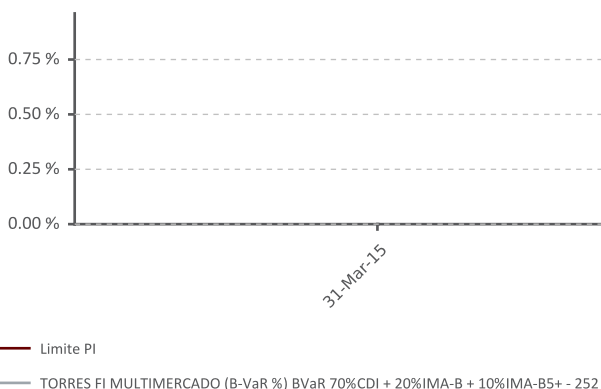
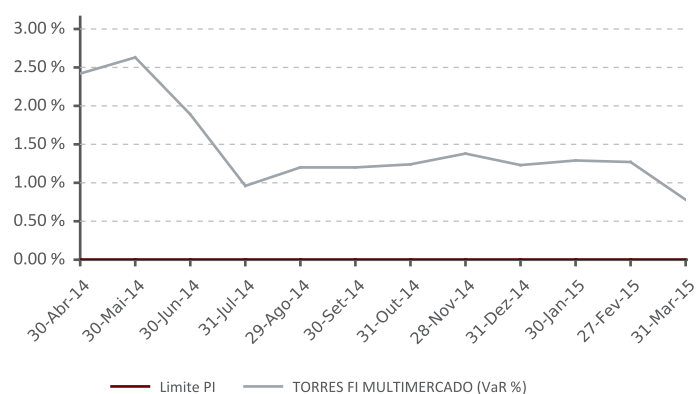
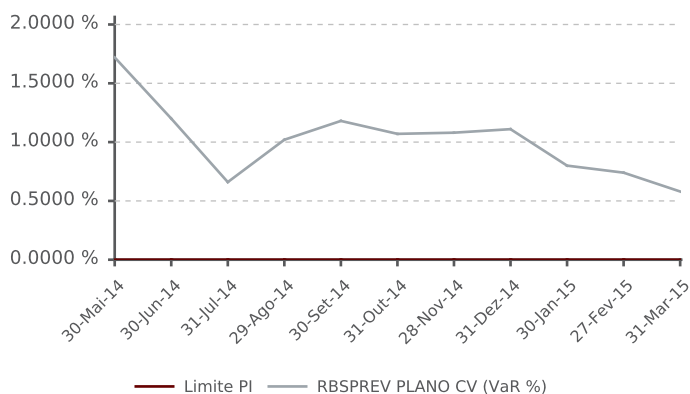
31/03/2015

## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO CV	-	238,573,368.65	238,310,806.38	0.58%	-	-	(5,552,222.21)	(2.33)%
TORRES FI MULTIMERCADO (PREV - 21D - 252)	-	51,941,033.88	51,938,754.45	0.78%	-	-	(1,049,557.25)	(2.02)%
TORRES FI MULTIMERCADO	70%CDI + 20%IMA-B + 10%IMA-B5+	51,941,033.88	51,938,754.45	0.51%	0.80%	✓	(1,049,557.25)	(2.02)%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO (PREV - 21D -	-	54,426,554.18	54,480,001.05	0.97%	-	-	(1,375,387.26)	(2.53)%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	70%CDI + 20%IMA-B + 10%IMA-B5+	54,426,554.18	54,480,001.05	0.34%	0.80%	✓	(1,375,387.26)	(2.53)%
ITAU FOF RPI 30 ACOES FICFI	IBOVESPA	58,832,971.61	58,815,226.37	3.01%	5.40%	✓	-	-
ITAU FOF RPI 30 ACOES FICFI (PREV - 21D -	-	70,368,947.66	70,348,922.61	6.33%	-	-	(9,984,992.24)	(14.19)%
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	IBOVESPA	21,066,586.80	21,067,820.08	3.36%	5.40%	✓	-	-
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	-	28,243,152.19	28,263,265.29	5.38%	-	-	(3,580,199.94)	(12.68)%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	-	58,791,909.20	58,412,472.96	0.58%	3.00%	✓	(786,211.47)	(1.34)%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	-	62,249,267.17	62,313,239.58	0.64%	3.00%	✓	(1,043,396.80)	(1.68)%
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	IBOVESPA	182,734,402.44	182,721,552.60	2.62%	5.40%	✓	-	-
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	-	217,556,398.78	217,631,482.51	6.07%	-	-	(32,113,765.06)	(14.76)%
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	-	1,567,312,299.59	1,563,975,719.22	1.74%	4.25%	✓	49,468,523.55	3.16%

\* 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

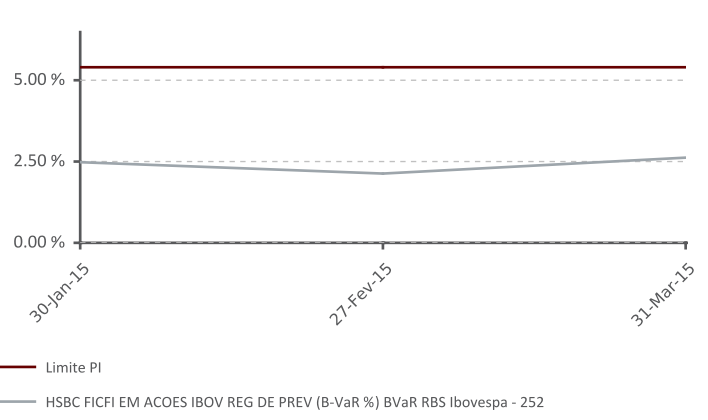
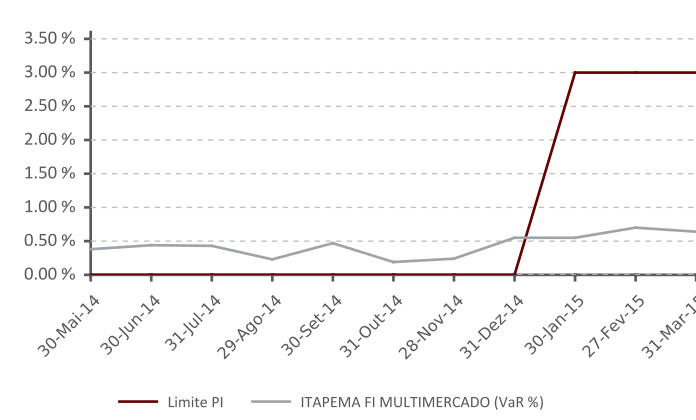
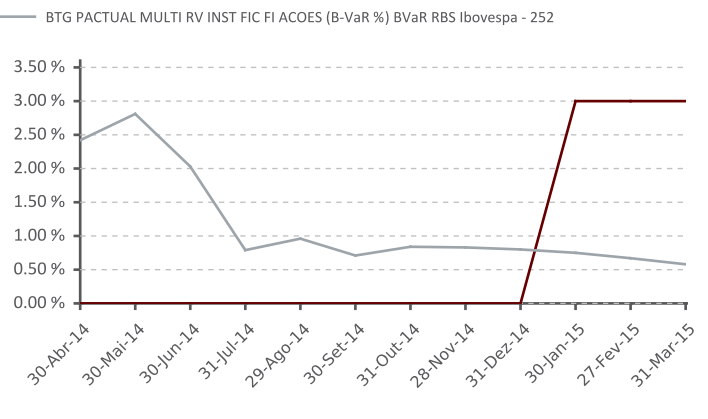
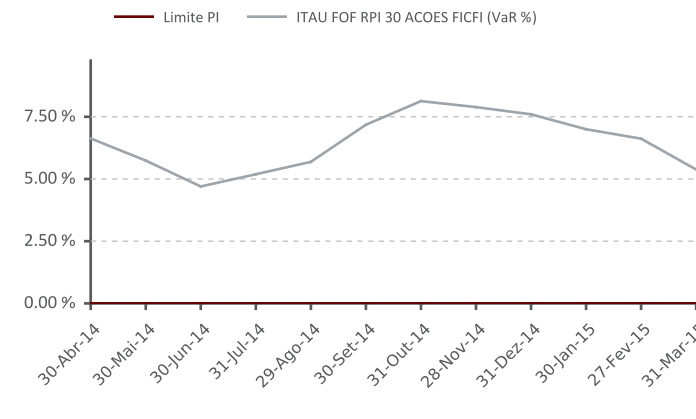
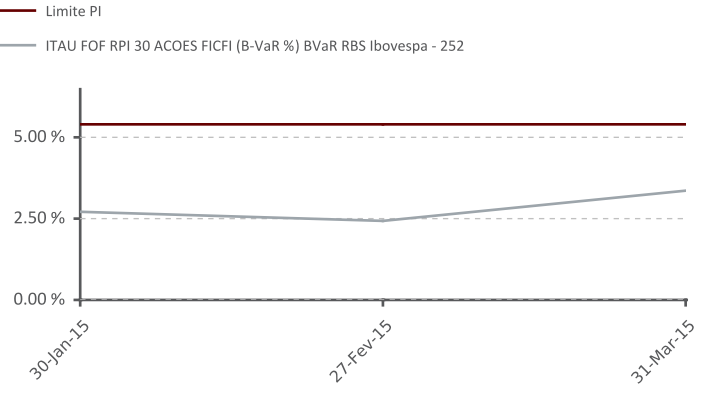
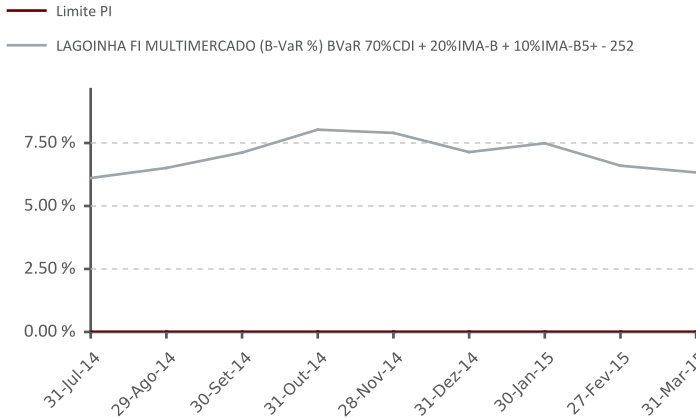
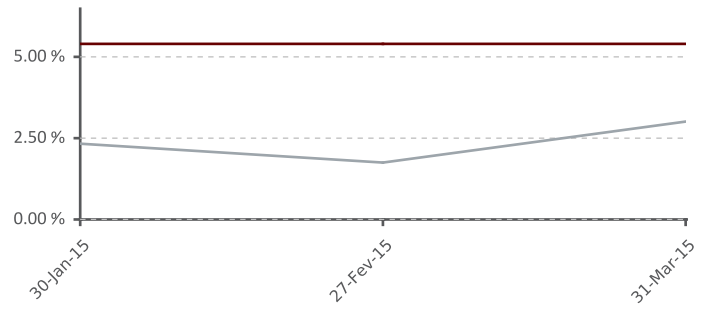
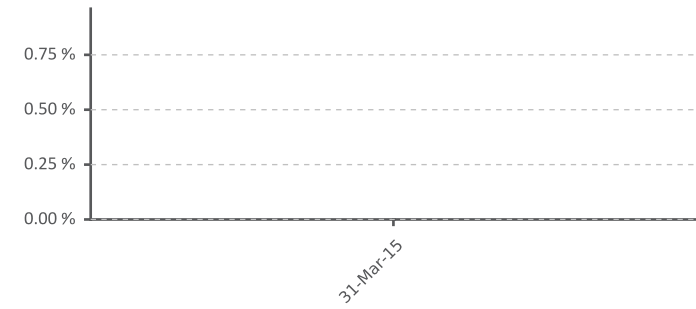


1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2015-03-31

31/03/2015

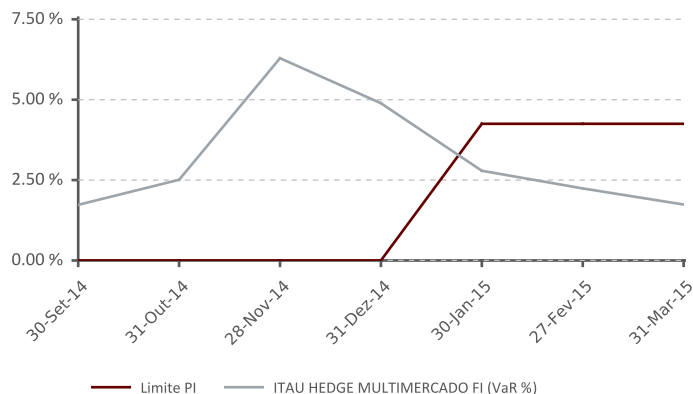
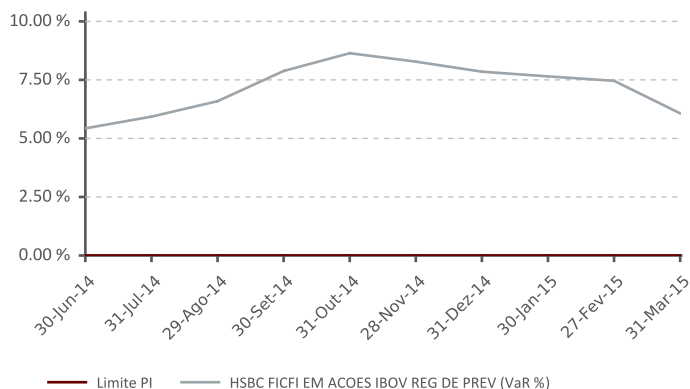


1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;  
 2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça 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 2015-03-31

31/03/2015



## RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	32,132,096.25	67.03	13.48
Faixa 2	AA	12,758,880.67	26.62	5.35
Faixa 3	A	499,848.13	1.04	0.21
Faixa 4	BBB	2,546,125.37	5.31	1.07
Faixa 5	< BBB-	0.00	0.00	0.00
Sem Nota	-	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	(163,909.22)	(0.34)	(0.07)
<b>Total</b>		<b>47,936,950.41</b>		

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

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	20.12	65.00	✓
Grau Especulativo	0.00	6.00	✓

## ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
CAIXA	38.68	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	POLLUX ACOES INSTIT. I FIC FI DE ACOES
CAIXA	11.04	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	POLLUX ACOES INSTIT. MASTER FI DE
CAIXA	0.54	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	1.95	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP II
CAIXA	1.95	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP III
CAIXA	1.95	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IV
CAIXA	2.43	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IX
CAIXA	2.27	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP V
CAIXA	2.13	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP VI
CAIXA	2.16	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	2.34	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP X
CAIXA	2.36	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUID FI REF DI LP VIII
CAIXA	6.34	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL FC FI ACOES
CAIXA	32.83	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI ACOES
CAIXA	0.29	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX OVER FI CURTO PRAZO
CAIXA	6.51	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	ATMOS INSTITUCIONAL FI DE ACOES

1. Este documento é de propriedade exclusiva do 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.

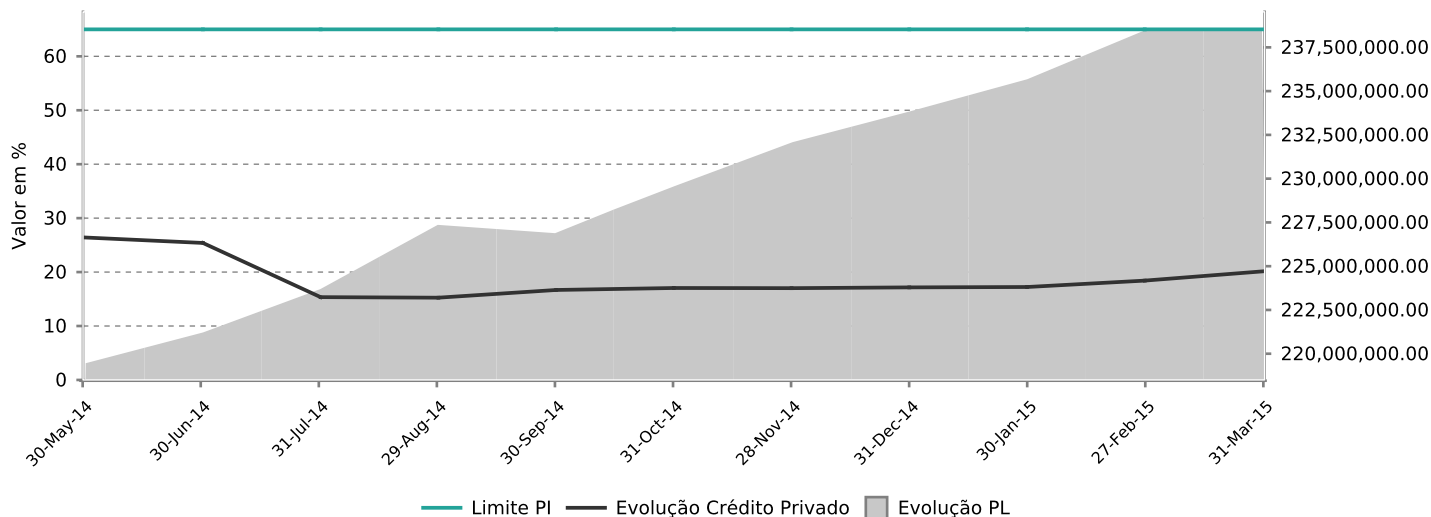
# Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO CV 2015-03-31

31/03/2015

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
CAIXA	0.27	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	ATMOS INSTITUCIONAL MASTER FIA
CAIXA	1.49	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	STK LONG ONLY INSTITUCIONAL FI EM
CAIXA	2,041.47	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX ACOES FC FI ACOES INSTITUCIONAL
CAIXA	2.94	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX MASTER FI DE ACOES INSTITUCIONAL

## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	11,140,052.24	4.67%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	7,776,371.15	3.26%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	6,492,449.68	2.72%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	3,927,804.23	1.65%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	2,874,346.47	1.21%	20.00%	✓
BCO BMG SA	2,546,125.37	1.07%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	2,066,134.73	0.87%	20.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	1,776,366.81	0.75%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	1,639,473.54	0.69%	10.00%	✓
OI SA	1,591,838.46	0.67%	10.00%	✓

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO CV 2015-03-31

31/03/2015

## 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%
ARX FUNDO DE INVESTIMENTO EM	0.00%	0.00%
ITAU SOBERANO REFERENCIADO DI LP	0.00%	0.00%
ITAU CAIXA ACOES FI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
HSBC FI REFERENCIADO DI CASH	0.00%	0.00%
GAP ACOES FUNDO DE	82.20%	0.27%
SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA	0.00%	0.00%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.03%
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%
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%	0.10%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI	0.00%	0.00%
BBM VALUATION MASTER FIA	0.00%	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	0.00%	0.00%
SUL AMERICA RENDA FIXA ATIVO FI	0.00%	0.00%
HSBC FI EM EM ACOES IBOVESPA	0.00%	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	25.84%	0.41%

1. Este documento é de propriedade exclusiva do 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 2015-03-31

31/03/2015

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	3.55%
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%
BOGARI VALUE INSTITUCIONAL FI DE	18.98%	0.38%
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%
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%	0.71%
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%
Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*	0.28%	
Total do percentual gasto com compra de opções*	0.01%	

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

1. Este documento é de propriedade exclusiva do 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 2015-03-31

31/03/2015

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	82.91%	82.91%	10.00%	✓
7	1.26%	84.17%	-	-
21	0.19%	84.35%	20.00%	✓
Longo	15.65%	100.00%	-	-

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	2,092,265.81	1,562,866,205.35	0.13%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	58,412,472.96	58,412,472.96	100.00%
TORRES FI MULTIMERCADO	51,938,754.45	51,938,754.45	100.00%
HSBC FICFI EM ACOES IBOV REG DE PREV	4,968,450.93	217,631,482.51	2.28%
BTG PACTUAL MULTI RV INST FIC FI ACOES	1,193,100.57	28,263,265.29	4.22%
ITAU FOF RPI 30 ACOES FICFI	2,912,660.31	70,352,286.68	4.14%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	54,480,001.05	54,480,001.06	100.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	62,313,239.58	62,313,239.58	100.00%

## ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total Inf.	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	95.98%	90.00%	99.00%	✓
Renda Variável	3.14%	1.00%	5.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.88%	0.00%	2.00%	✓

1. Este documento é de propriedade exclusiva do 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.