

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR 2015-11-30

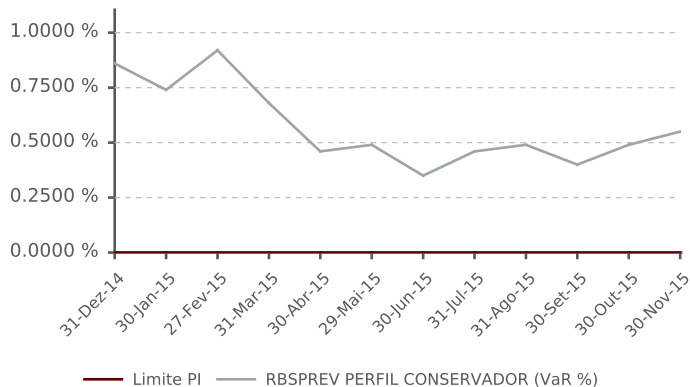
30/11/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PERFIL CONSERVADOR	-	133,052,088.15	133,104,258.83	0.55%	-	-	(1,500,167.44)	(1.13)%

* 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	33,480,651.89	100.00	25.15
Faixa 2	<= AA+	23,716,461.61	70.84	17.82
Faixa 3	<= A+	1,997,728.88	5.97	1.50
Faixa 4	<= BBB+	1,618,657.59	4.83	1.22
Faixa 5	<= BB+	0.00	0.00	0.00
-	Sem Nota	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	484,081.74	1.45	0.36

Total Crédito Privado 33,480,651.89

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	25.15	65.00	✓
Grau Especulativo	0.00	6.00	✓

1. Este documento é de propriedade exclusiva da Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;

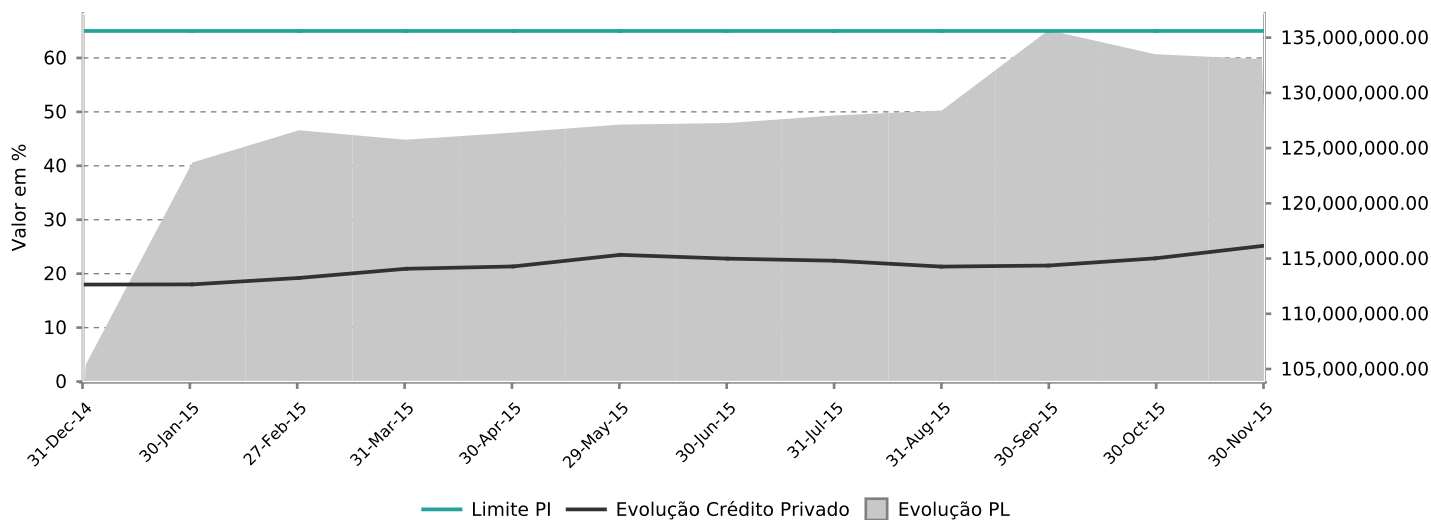
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;

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.



EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	6,359,231.94	4.78%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	5,246,441.32	3.94%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	4,116,129.95	3.09%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	3,246,562.57	2.44%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	2,301,980.51	1.73%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	1,836,511.79	1.38%	20.00%	✓
BCO BMG SA	1,618,657.59	1.22%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	1,612,582.50	1.21%	20.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	962,456.14	0.72%	10.00%	✓
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	894,073.36	0.67%	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 RENDA FIXA VERTICE INFLATION	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* 0.42%

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 2015-11-30

30/11/2015

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	78.03%	78.03%	10.00%	✓
21	1.82%	79.85%	20.00%	✓
Longo	20.15%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1,266,008.99	1,616,706,731.51	0.08%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	34,053,198.38	58,852,933.78	57.86%
TORRES FI MULTIMERCADO	30,721,991.33	53,095,726.89	57.86%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	31,221,335.64	53,958,725.94	57.86%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	35,841,724.49	61,943,979.93	57.86%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.05%	97.50%	100.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.95%	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.