

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL MODERADO 2015-11-30

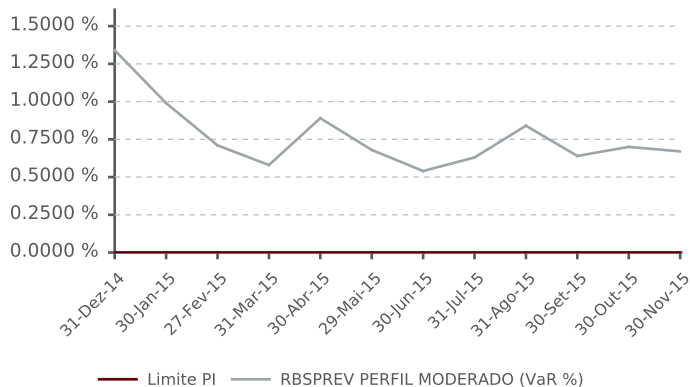
30/11/2015

## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PERFIL MODERADO	-	102,197,319.23	102,246,694.90	0.67%	-	-	(1,823,441.96)	(1.78)%

\* 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	24,424,699.69	100.00	23.89
Faixa 2	<= AA+	17,313,786.56	70.89	16.93
Faixa 3	<= A+	1,459,390.51	5.98	1.43
Faixa 4	<= BBB+	1,183,326.36	4.84	1.16
Faixa 5	<= BB+	4,515.50	0.02	0.00
-	Sem Nota	4,515.50	0.02	0.00
Outros (*)	-	352,539.55	1.44	0.34
<b>Total Crédito Privado</b>		<b>24,424,699.69</b>		

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

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

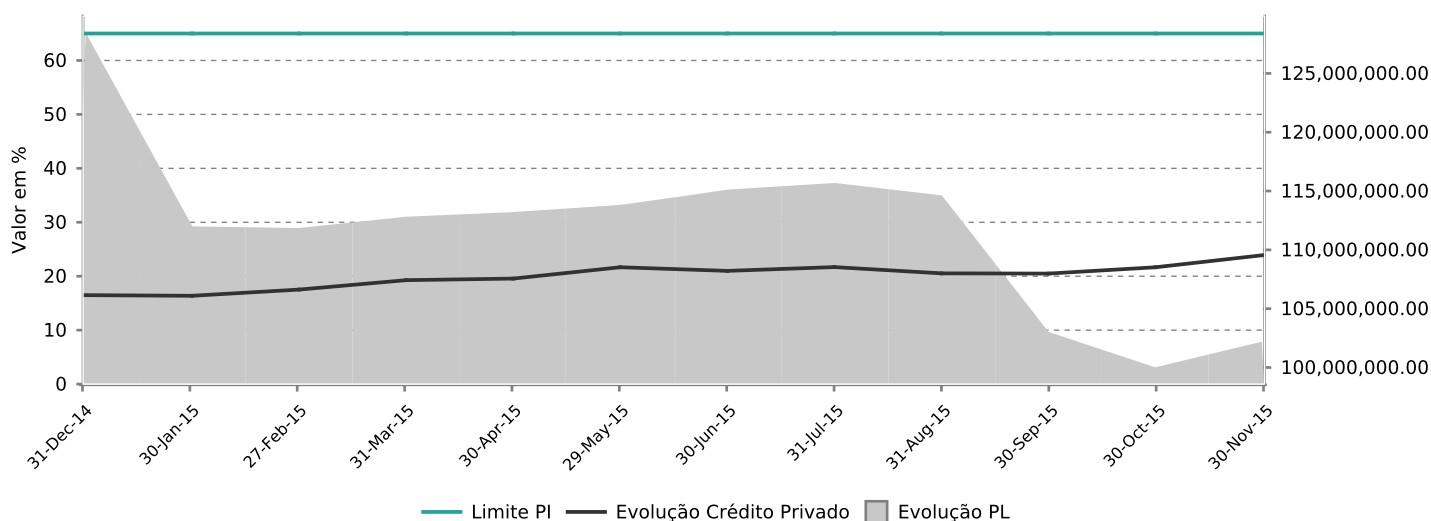
	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	23.89	65.00	✓
Grau Especulativo	0.00	6.00	✓



## ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
CAIXA	53.61	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL FC FI ACOES
CAIXA	937.94	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI ACOES
CAIXA	1.46	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX OVER FI CURTO PRAZO
CAIXA	3,485.57	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX ACOES FIC FI ACOES INSTITUCIONAL
CAIXA	3.70	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX MASTER FI DE ACOES INSTITUCIONAL
CAIXA	1.17	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	3.42	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP II
CAIXA	3.98	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP III
CAIXA	3.46	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IV
CAIXA	3.56	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IX
CAIXA	3.55	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP V
CAIXA	3.47	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP VI
CAIXA	3.49	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	3.56	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP X
CAIXA	3.56	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUID FI REF DI LP VIII

## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO





## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	4,861,468.45	4.75%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	4,296,519.33	4.20%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	3,009,901.09	2.94%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	2,364,356.25	2.31%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	1,676,450.68	1.64%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	1,339,035.74	1.31%	20.00%	✓
BCO BMG SA	1,178,810.86	1.15%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	1,174,386.58	1.15%	20.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	700,922.64	0.69%	10.00%	✓
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	651,121.88	0.64%	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	13.59%	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%
JGP INSTITUCIONAL FIA	0.00%	0.00%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL BOLSA INDEX	0.50%	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 RENDA FIXA VERTICE INFLATION	0.00%	0.00%
ITAU INST ACOES FOF MULTIGESTOR	0.00%	0.00%
APEX MASTER FI DE ACOES	0.00%	1.53%
APEX ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	0.78%
BLACKROCK INST IBOVESPA YIELD FI	0.00%	0.00%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST M 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%

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 2015-11-30

30/11/2015

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
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%	2.97%
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%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
OCEANA VALOR MASTER FIA	0.00%	0.01%
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\* 0.41%

Total do percentual gasto com compra de opções\* 0.02%

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

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	79.22%	79.22%	10.00%	✓
21	1.67%	80.88%	20.00%	✓
Longo	19.12%	100.00%	-	-

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	921,989.40	1,616,706,731.51	0.06%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3,852,809.19	432,759,917.93	0.89%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	24,799,735.40	58,852,933.78	42.14%
TORRES FI MULTIMERCADO	22,373,735.57	53,095,726.89	42.14%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	1,452,392.52	1,444,220,839.65	0.10%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	22,737,390.31	53,958,725.94	42.14%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	26,102,255.46	61,943,979.93	42.14%

## ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	94.69%	82.00%	98.00%	✓
Renda Variável	4.41%	2.00%	10.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.90%	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.

