

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR 2015-10-30

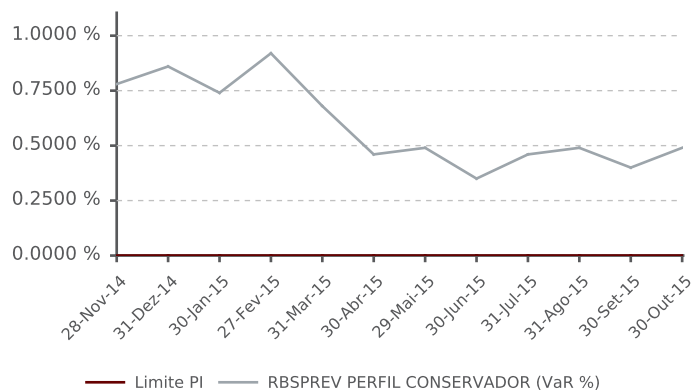
30/10/2015

## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PERFIL CONSERVADOR	-	133,495,063.26	133,496,585.61	0.49%	-	-	(1,491,782.13)	(1.12)%

\* 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	30,501,369.04	100.00	22.85
Faixa 2	<= AA+	20,851,213.72	68.36	15.62
Faixa 3	<= A+	2,013,512.08	6.60	1.51
Faixa 4	<= BBB+	1,618,119.29	5.31	1.21
Faixa 5	<= BB+	0.00	0.00	0.00
-	Sem Nota	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	299,936.10	0.98	0.22
<b>Total Crédito Privado</b>		<b>30,501,369.04</b>		

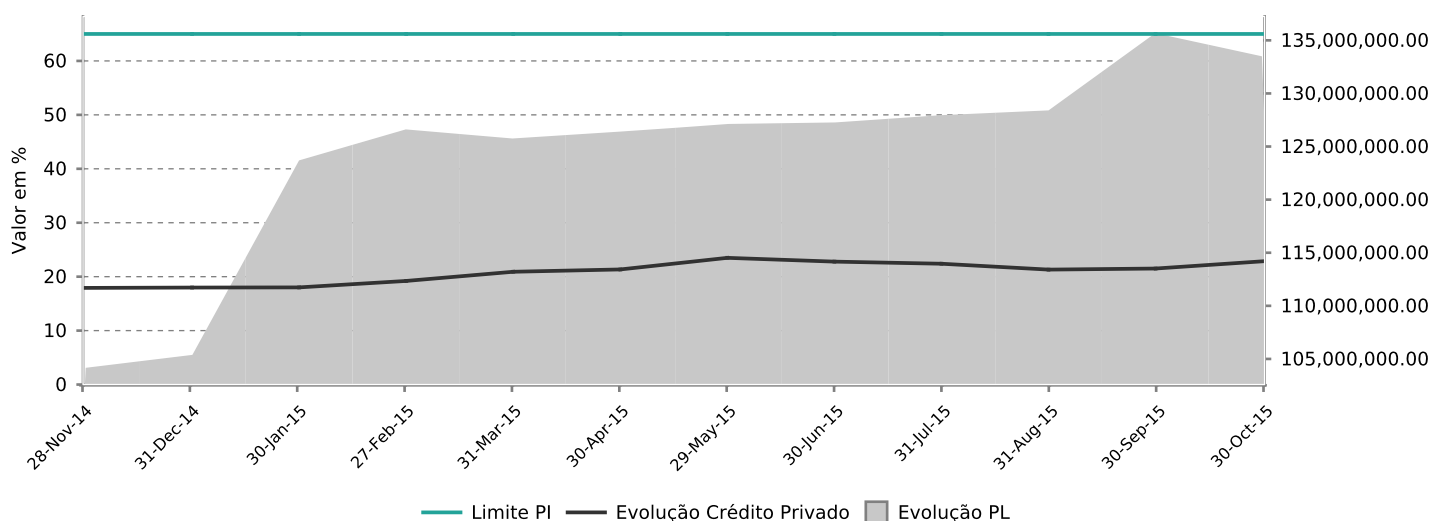
\*Contempla o financeiro dos Swaps intermediados pela BM&FBovespa e/ou com garantia.

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	22.85	65.00	✓
Grau Especulativo	0.00	6.00	✓



## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	6,437,953.73	4.82%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	5,247,934.70	3.93%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	4,107,572.46	3.08%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	2,301,856.73	1.72%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	1,836,166.71	1.38%	20.00%	✓
BCO BMG SA	1,618,119.29	1.21%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	1,610,763.67	1.21%	20.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	1,145,150.39	0.86%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	965,092.24	0.72%	10.00%	✓
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	894,017.59	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	1.36%	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 2015-10-30

30/10/2015

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	80.67%	80.67%	10.00%	✓
21	0.60%	81.27%	20.00%	✓
Longo	18.73%	100.00%	-	-

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1,311,261.41	1,589,487,546.95	0.08%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	34,042,084.40	58,177,993.74	58.51%
TORRES FI MULTIMERCADO	30,909,189.86	52,823,870.39	58.51%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	31,356,731.96	53,588,720.78	58.51%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	35,877,317.98	61,314,411.78	58.51%

## ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.02%	97.50%	100.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.98%	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.