

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO CV 2015-10-30

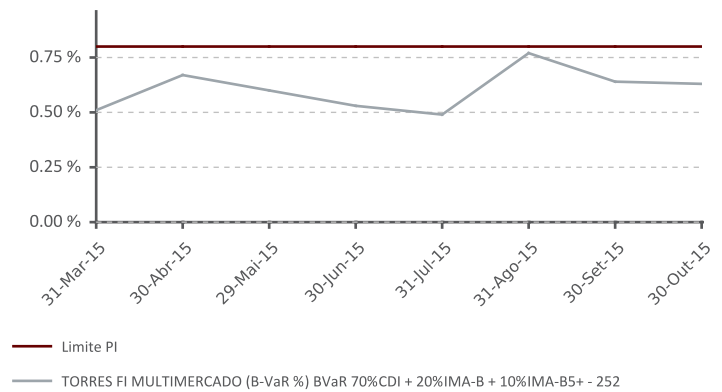
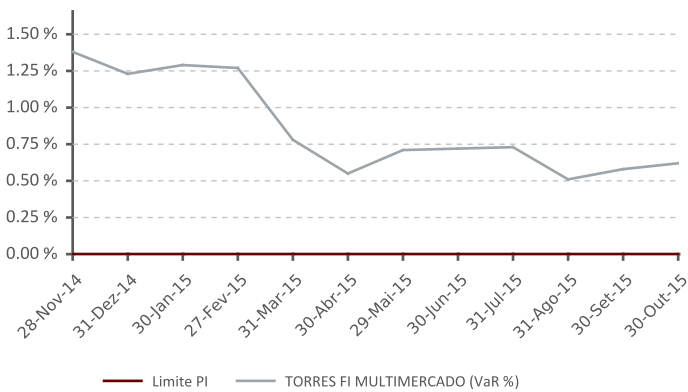
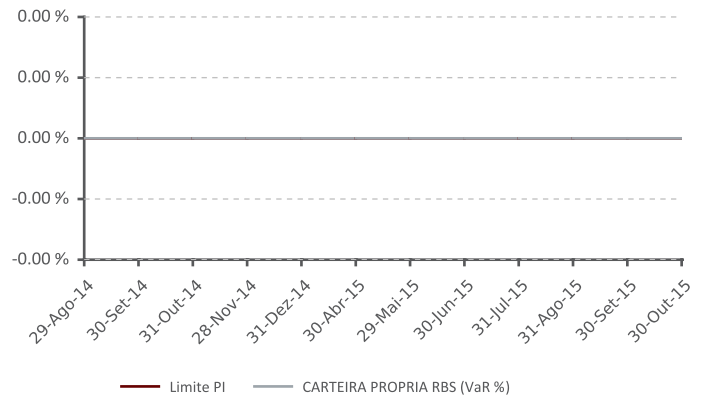
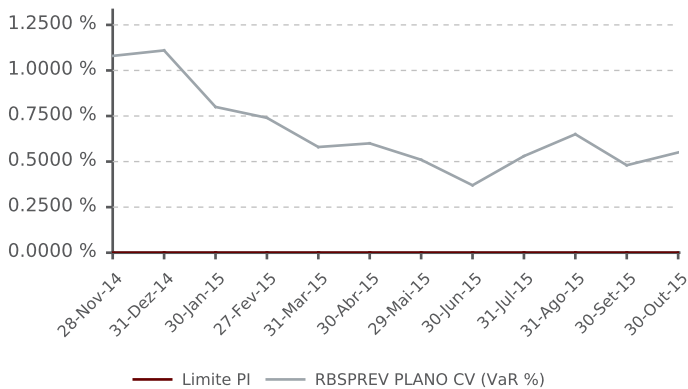
30/10/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO CV	-	240,225,117.01	240,250,155.57	0.55%	-	-	(3,294,698.31)	(1.37)%
CARTEIRA PROPRIA	-	(2,420.23)	(2,420.23)	0.00%	-	-	0.00	(0.00)%
TORRES FI MULTIMERCADO (PREV - 21D - 252)	-	52,823,989.88	52,823,870.39	0.62%	-	-	(861,539.45)	(1.63)%
TORRES FI MULTIMERCADO	70%CDI + 20%IMA-B + 10%IMA-B5+	52,823,989.88	52,823,870.39	0.63%	0.80%	✓	(861,539.45)	(1.63)%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO (PREV - 21D -	-	53,488,135.79	53,588,720.79	0.75%	-	-	(1,046,878.54)	(1.96)%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	70%CDI + 20%IMA-B + 10%IMA-B5+	53,488,135.79	53,588,720.79	0.46%	0.80%	✓	(1,046,878.54)	(1.96)%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	-	1,444,181,788.97	1,452,422,146.28	6.28%	-	-	(197,093,059.3)	(13.65)%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	-	58,385,588.37	58,177,993.74	0.98%	3.00%	✓	(185,127.91)	(0.32)%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	-	61,204,680.97	61,314,411.79	0.28%	3.00%	✓	(455,912.90)	(0.74)%
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	-	6,554,528,620.53	6,566,406,853.05	0.00%	0.30%	✓	19,954.63	0.00%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI (PREV -	-	448,218,749.19	448,431,067.92	5.76%	-	-	(62,693,901.13)	(13.99)%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	IBOVESPA	385,546,928.75	385,759,254.59	2.80%	5.40%	✓	-	-
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	-	1,588,976,110.82	1,588,964,772.42	5.61%	4.25%	✗	234,732,859.6	14.77%

* 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

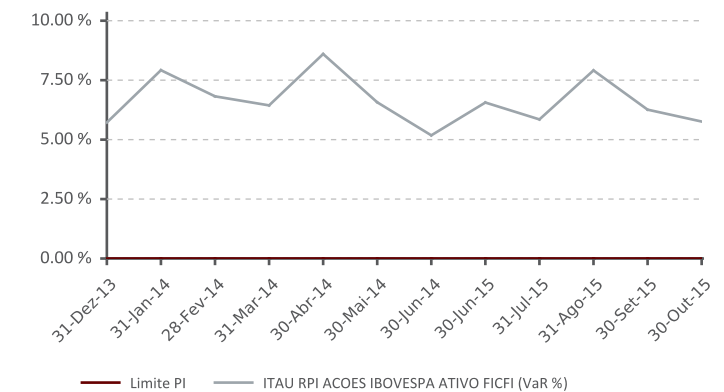
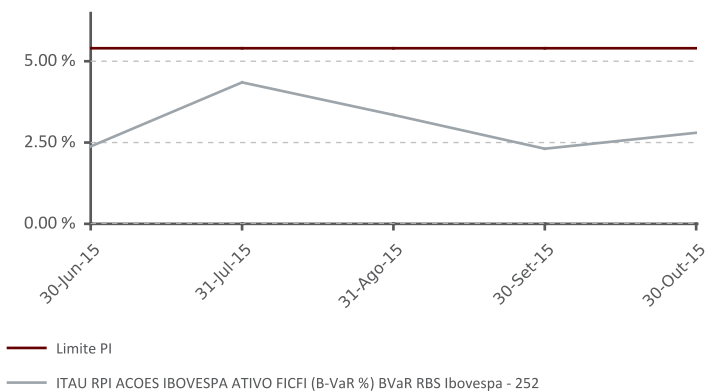
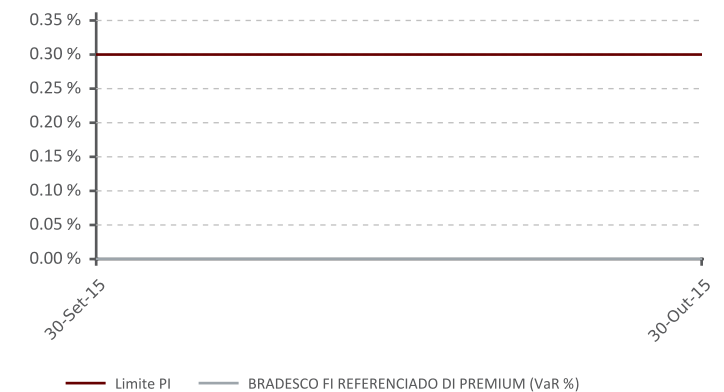
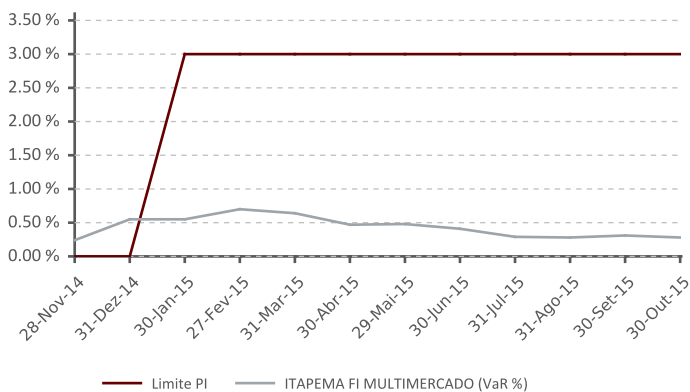
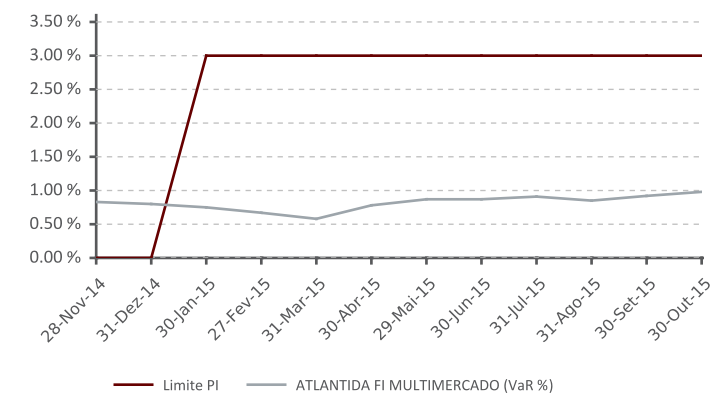
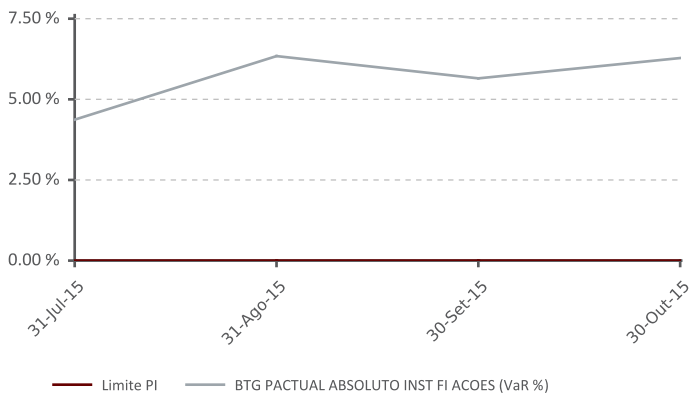
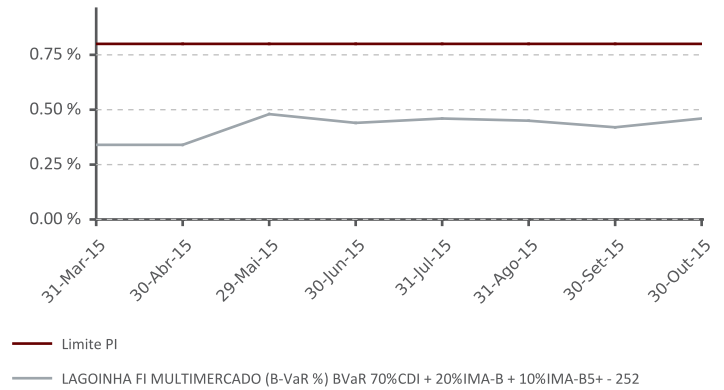
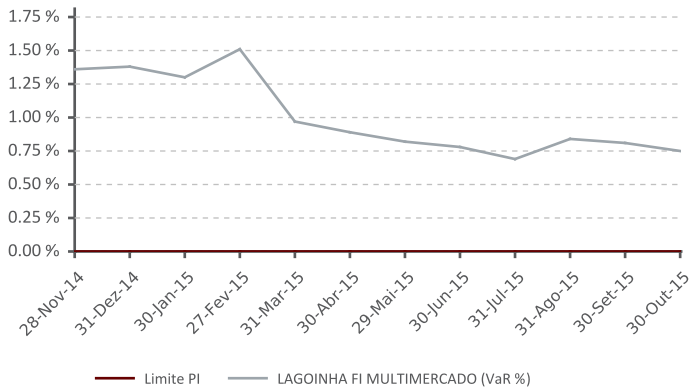


Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO CV 2015-10-30

30/10/2015



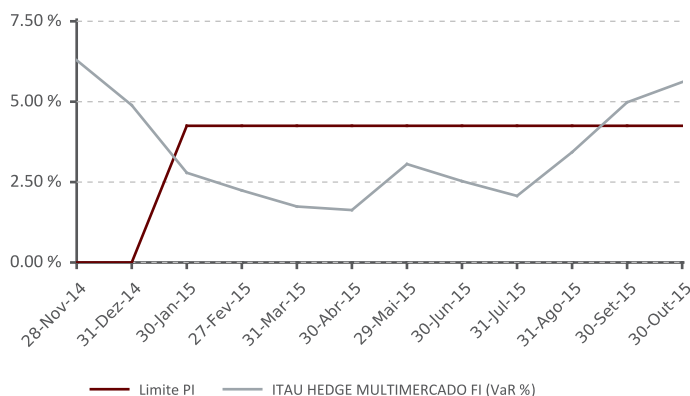
1. Este documento é de propriedade exclusiva da Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
 2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 PLANO CV 2015-10-30

30/10/2015



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.
Faixa 1	<= AAA	54,416,832.54	100.00	22.65
Faixa 2	<= AA+	37,564,580.25	69.03	15.64
Faixa 3	<= A+	3,455,165.52	6.35	1.44
Faixa 4	<= BBB+	2,771,304.53	5.09	1.15
Faixa 5	<= BB+	5,935.27	0.01	0.00
-	Sem Nota	3,864.76	0.01	0.00
Outros (*)	-	512,591.43	0.94	0.21
Total Crédito Privado		54,416,832.54		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	22.65	65.00	✓
Grau Especulativo	0.00	6.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
CAIXA	2.59	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL FC FI ACOES
CAIXA	374.79	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI ACOES
CAIXA	2.04	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX OVER FI CURTO PRAZO
CAIXA	3,472.06	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX ACOES FIC FI ACOES INSTITUCIONAL
CAIXA	3.64	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX MASTER FI DE ACOES INSTITUCIONAL
CAIXA	0.50	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	1.11	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP II
CAIXA	1.11	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP III
CAIXA	0.93	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IV
CAIXA	1.02	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IX
CAIXA	1.01	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP V
CAIXA	0.94	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP VI
CAIXA	0.96	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	1.02	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP X
CAIXA	1.03	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUID FI REF DI LP VIII
CDB_cdi	2,070.51	BCO INDUSVAL SA	RETIRADO	MOODY	BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM

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

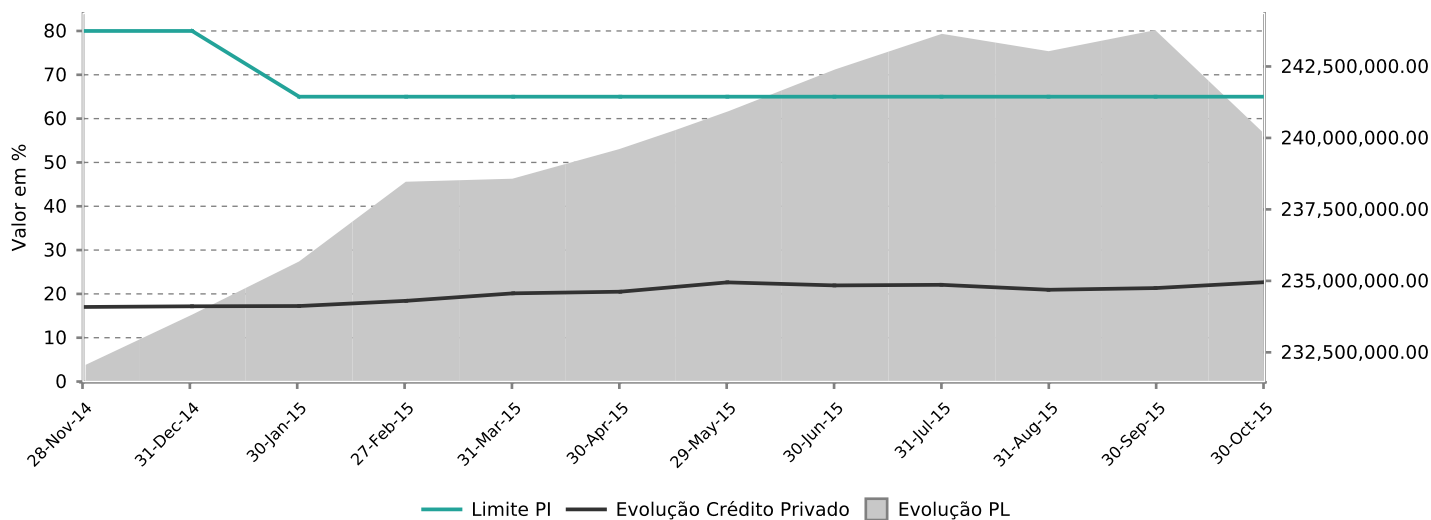
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;

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	12,356,437.50	5.14%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	9,673,187.49	4.03%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	7,168,007.73	2.98%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	4,043,713.32	1.68%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	3,349,407.90	1.39%	20.00%	✓
BCO BMG SA	2,765,369.26	1.15%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	2,752,798.50	1.15%	20.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	1,957,064.43	0.81%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	1,649,344.66	0.69%	10.00%	✓
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	1,527,877.94	0.64%	10.00%	✓

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO CV 2015-10-30

30/10/2015

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%
BRADESCO FI REFERENCIADO DI	0.09%	0.00%
ITAU CAIXA ACOES FI	6.58%	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	1.36%	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%
JGP INSTITUCIONAL FIA	0.00%	0.00%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL BOLSA INDEX	0.60%	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%
CARTEIRA PROPRIA RBS	0.00%	0.00%
ITAU INST ACOES FOF MULTIGESTOR	0.00%	0.00%
APEX MASTER FI DE ACOES	0.00%	0.75%
APEX ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	2.73%
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%

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 PLANO CV 2015-10-30

30/10/2015

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%
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%	2.49%
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%	0.00%
RBSPREV PLANO CV	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*	0.40%	
Total do percentual gasto com compra de opções*	0.01%	

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	80.44%	80.44%	10.00%	✓
21	0.95%	81.39%	20.00%	✓
Longo	18.61%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
BRABESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	6,732,421.19	6,566,406,853.04	0.10%
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	2,240,948.51	1,589,487,546.95	0.14%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	3,890,805.33	448,431,067.92	0.87%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	58,177,993.74	58,177,993.74	100.00%
TORRES FI MULTIMERCADO	52,823,870.39	52,823,870.39	100.00%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FI ACOES	1,483,404.06	1,452,422,146.28	0.10%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	53,588,720.79	53,588,720.78	100.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	61,314,411.79	61,314,411.78	100.00%

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.



ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	97.15%	90.00%	99.00%	✓
Renda Variável	1.92%	1.00%	5.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.93%	0.00%	2.00%	✓