



Risco de Mercado

Patrimônio Líquido

PL Calculado	135.675.406,73
PL Informado	135.689.119,96
PL Calculado a Mercado	135.675.406,73

Value At Risk

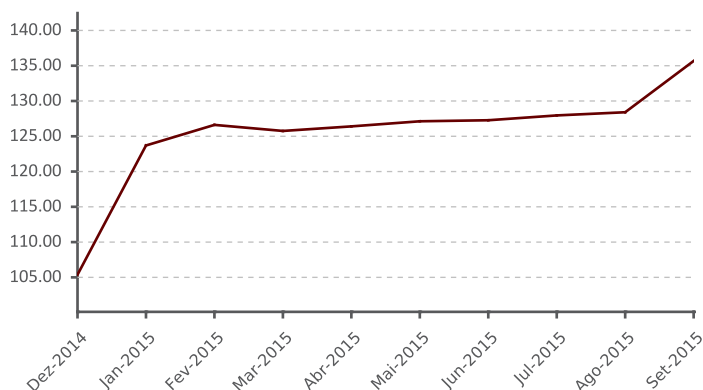
Value-at-Risk	548.809,61
Value-at-Risk (%)	0,4045

Parâmetros Para Cálculo Do VaR

Modelo	Non-Parametric
Nível de Confiança	95%
Horizonte de Tempo	21

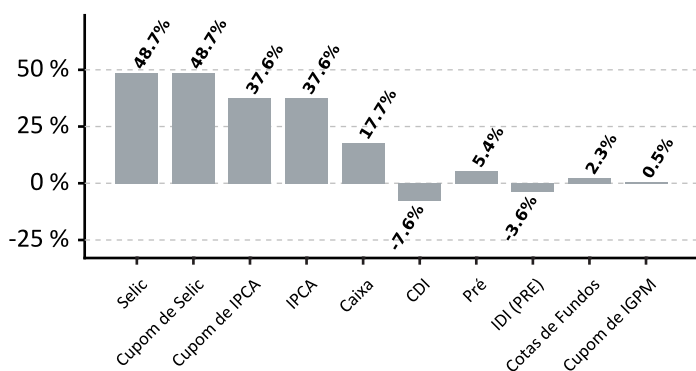
Evolução do PL

(em milhões)

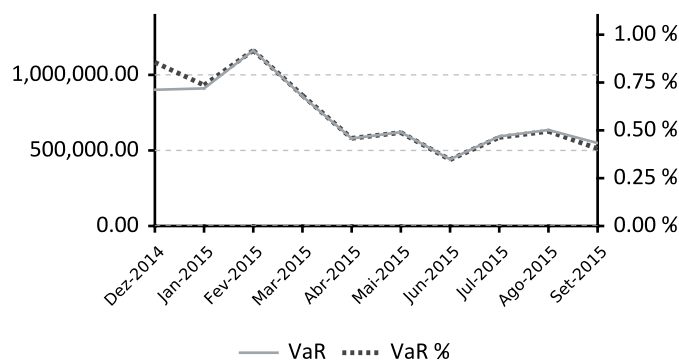


Distribuição Percentual da Carteira por Fator de Risco

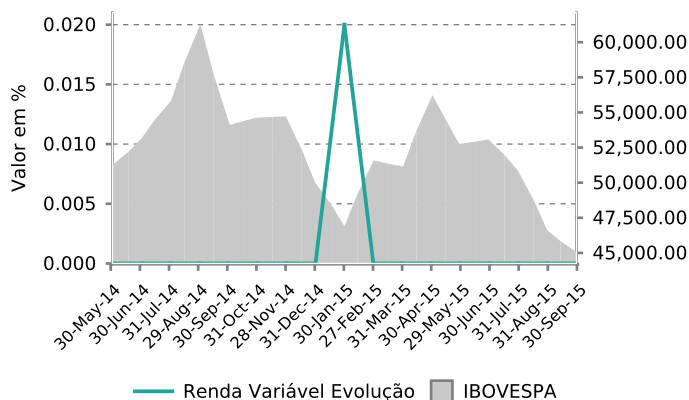
(% sobre PL Calculado)



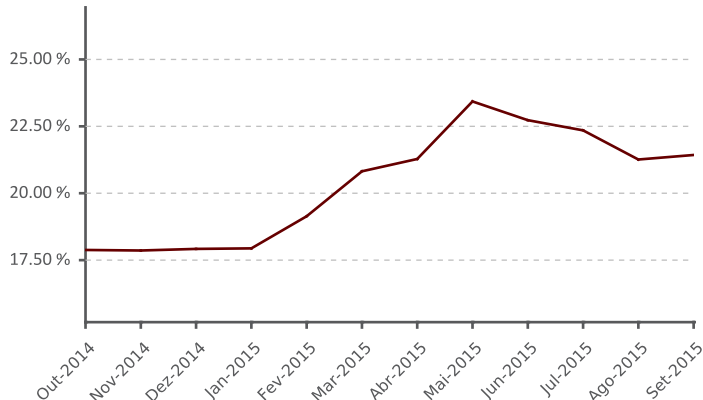
Evolução do VaR



Alocação em Renda Variável



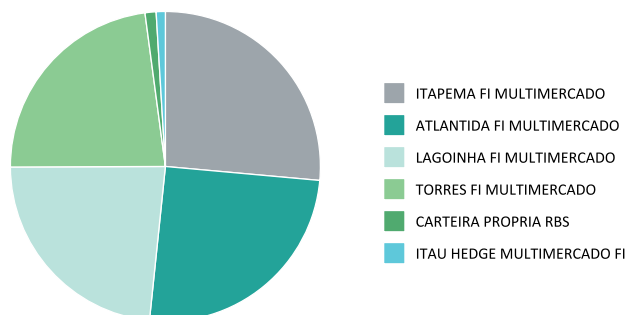
Evolução de Crédito Privado





Composição do Plano

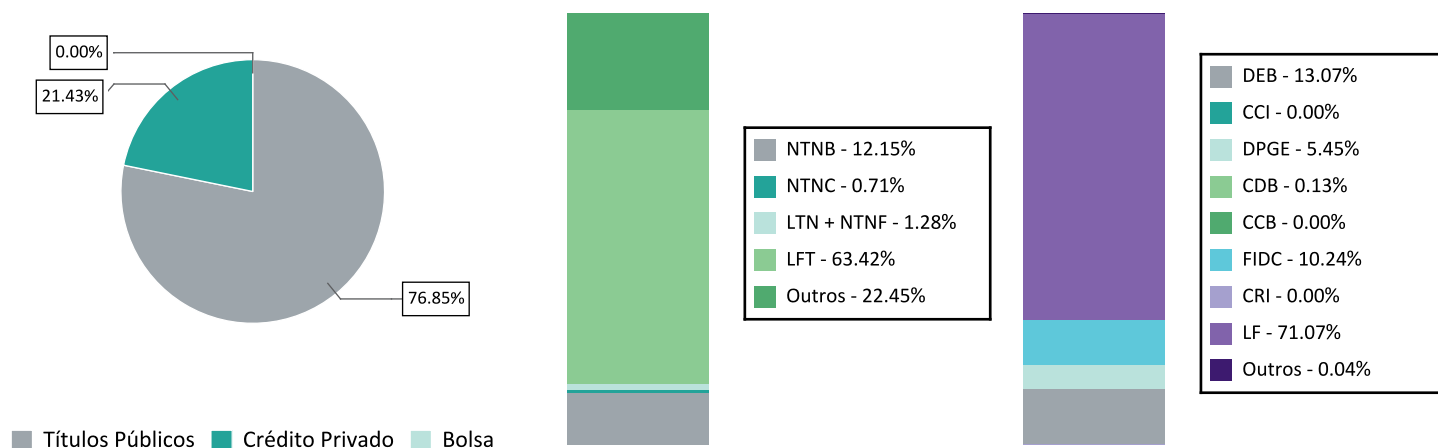
Book	Valor
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	35.871.700,75
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	34.205.782,39
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	31.614.207,50
TORRES FI MULTIMERCADO	31.137.019,51
CARTEIRA PROPRIA RBS	1.566.627,25
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1.293.781,96



Participação por Classe de Ativos

Fatores de Risco	(%)			Dur. Ativa (du)			Dur. Passiva (du)		
	30/09/2015	31/08/2015	31/07/2015	30/09/2015	31/08/2015	31/07/2015	30/09/2015	31/08/2015	31/07/2015
CDI	(7,56)%	(5,48)%	(3,56)%	-	-	-	-	-	-
Caixa	17,70%	17,82%	14,91%	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos	2,34%	2,26%	3,08%	-	-	-	-	-	-
Cupom de IGPM	0,55%	0,53%	0,54%	1.155,88	1.178,80	1.202,85	0,00	0,00	0,00
Cupom de IPCA	37,62%	36,29%	39,49%	515,04	536,40	635,14	0,00	0,00	0,00
Cupom de Selic	48,73%	49,20%	48,12%	1.016,01	840,23	844,01	0,00	0,00	0,00
IDI (PRE)	(3,55)%	(2,63)%	(0,99)%	-	-	-	-	-	-
IGPM	0,55%	0,53%	0,54%	-	-	-	-	-	-
IPCA	37,62%	36,29%	39,49%	-	-	-	-	-	-
Pré	5,39%	3,14%	(0,17)%	362,25	315,79	104,87	182,26	163,75	42,97
Selic	48,73%	49,20%	48,12%	-	-	-	-	-	-

Alocação em Títulos Públicos e Privados





RBSPREV PERFIL CONSERVADOR

30/Set/2015

Maiores Exposições Consolidado 10+

Contraparte	MtM Info	MtM Info (%)
SECRETARIA TESOUREIRO NACIONAL	80.858.206,66	59,59
BCO BRADESCO SA	6.527.943,62	4,81
BCO BRASIL SA	4.017.691,07	2,96
ITAUSA INVESTS ITAU SA	3.757.169,99	2,77
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	2.257.019,11	1,66
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	2.202.880,00	1,62
BCO BMG SA	1.586.143,09	1,17
BCO VOTORANTIM SA	1.577.376,06	1,16
FUNDO INVEST DIREITOS	1.120.019,96	0,83
SONAE SIERRA BRASIL SA	946.418,82	0,70

Basiléia Emissores

Contraparte	Basiléia	MtM Info
BCO BMG SA	26,70	1.586.143,09
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	17,50	2.202.880,00
ITAUSA INVESTS ITAU SA	16,90	3.757.169,99
BCO BRADESCO SA	16,50	6.527.943,62
BCO BRASIL SA	16,10	4.017.691,07
BCO VOTORANTIM SA	15,00	1.577.376,06
BCO GMAC SA	14,20	184.493,88
BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	13,60	257.902,73
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	13,10	2.257.019,11



Aquisições durante o Mês

Títulos Públicos

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	7.920,62	7,23	7,32	15/05/2055	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	29.536,82	7,35	7,33	15/08/2050	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	17.216,68	7,26	7,36	15/05/2045	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	9.681,10	7,26	7,37	15/08/2040	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	12.981,99	7,32	7,39	15/05/2035	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	8.479,65	7,37	7,39	15/08/2030	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	12.848,49	7,37	7,44	15/08/2024	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	22.598,15	7,46	7,45	15/05/2023	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	24.329,75	7,40	7,46	15/08/2022	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 + FI
NTNB	10.282,81	7,43	7,48	15/08/2020	SUL AMERICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP
NTNB	35.225,65	7,43	7,48	15/08/2020	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI
NTNB	46.950,45	7,30	7,49	15/05/2019	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI
NTNB	36.541,94	7,22	7,45	15/08/2018	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI
NTNB	33.482,38	6,85	6,80	15/05/2017	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI
NTNB	59.201,43	7,20	6,73	15/08/2016	ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION 5 FI

Alterações de Ratings

Títulos Privados

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	LAGOINHA FI MULTIMERCADO
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	ITAPEMA FI MULTIMERCADO
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
LF CDI - ZXSZ	BCO VOTORANTIM SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	LAGOINHA FI MULTIMERCADO
LF CDI - ZXSZ	BCO VOTORANTIM SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	ITAPEMA FI MULTIMERCADO
LF CDI - ZXSZ	BCO VOTORANTIM SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
LF IPCA - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	LAGOINHA FI MULTIMERCADO
LF IPCA - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	ITAPEMA FI MULTIMERCADO

Debêntures

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
ECCR22	ECORODOVIAS CONCESSOES	SP	brAAA	brAA+	Emissão	ITAPEMA FI MULTIMERCADO