



Risco de Mercado

Patrimônio Líquido

PL Calculado	5.073.216,21
PL Informado	5.083.392,89
PL Calculado a Mercado	5.073.216,21

Value At Risk

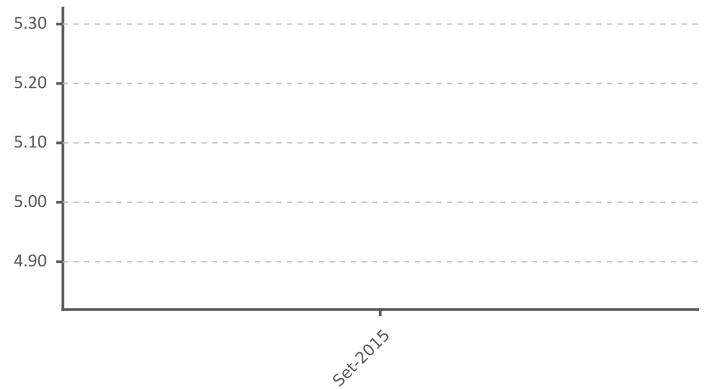
Value-at-Risk	148,48
Value-at-Risk (%)	0,0029

Parâmetros Para Cálculo Do VaR

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

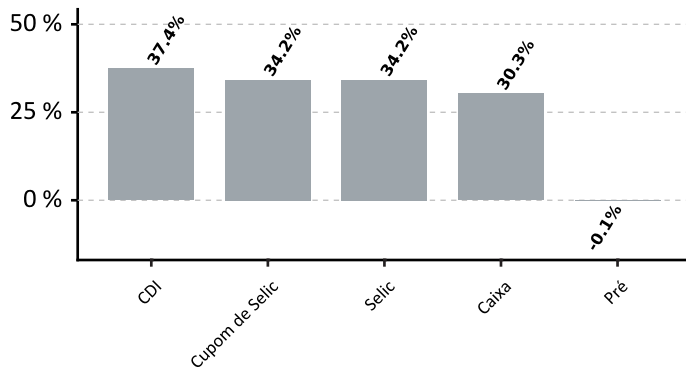
Evolução do PL

(em milhões)

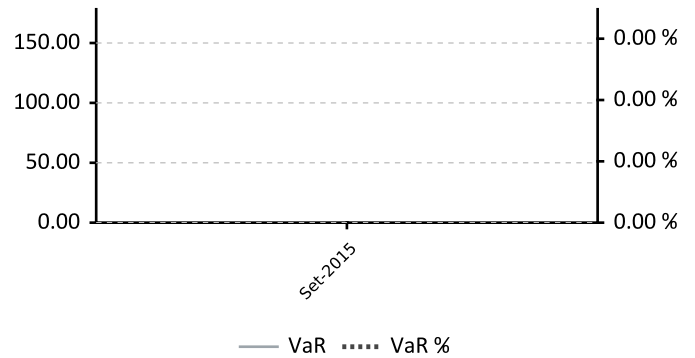


Distribuição Percentual da Carteira por Fator de Risco

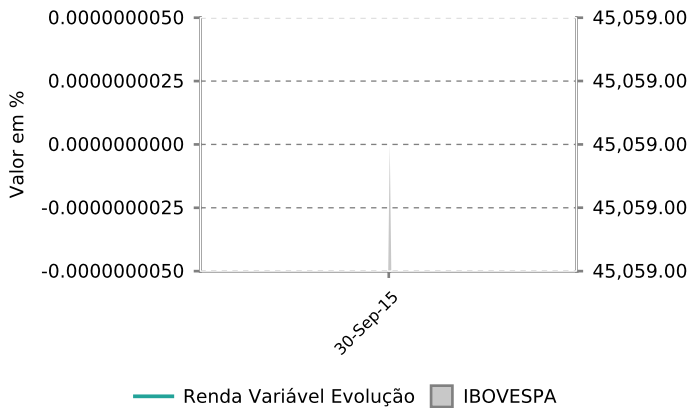
(% sobre PL Calculado)



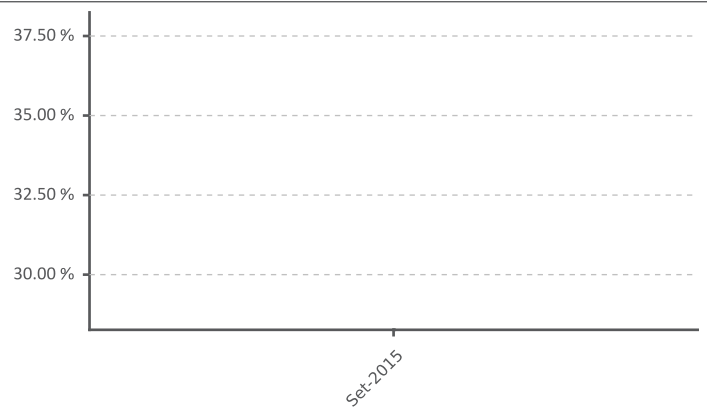
Evolução do VaR



Alocação em Renda Variável



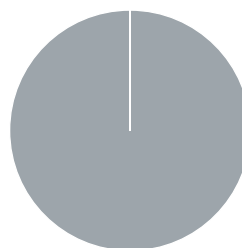
Evolução de Crédito Privado





Composição do Plano

Book	Valor
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	5.083.392,89

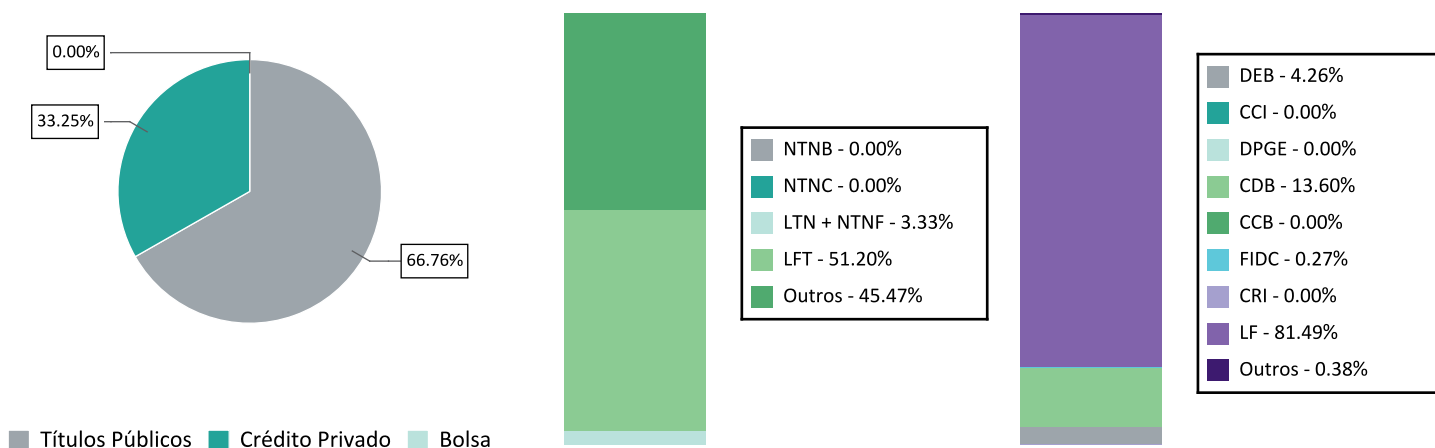


■ BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM

Participação por Classe de Ativos

Fatores de Risco	30/09/2015 (%)			Dur. Ativa (du)			Dur. Passiva (du)		
	30/09/2015	-	-	30/09/2015	-	-	30/09/2015	-	-
CDI	37,35%	-	-	-	-	-	-	-	-
Caixa	30,34%	-	-	-	-	-	-	-	-
Cupom de Selic	34,18%	-	-	1.383,00	-	-	0,00	-	-
Pré	(0,06)%	-	-	106,07	-	-	109,09	-	-
Selic	34,18%	-	-	-	-	-	-	-	-

Alocação em Títulos Públicos e Privados





RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

30/Set/2015

Maiores Exposições Consolidado 10+

Contraparte	MtM Info	MtM Info (%)
SECRETARIA TESOUREO NACIONAL	1.846.980,74	36,33
BCO BRADESCO SA	839.366,74	16,51
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	174.821,14	3,44
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	167.795,13	3,30
ITAUSA INVESTS ITAU SA	147.178,55	2,90
BCO BRASIL SA	100.632,19	1,98
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	79.360,58	1,56
BCO SAFRA SA	25.799,09	0,51
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	22.069,18	0,43
ELETROPAULO METROPOLITANA	19.937,82	0,39

Basiléia Emissores

Contraparte	Basiléia	MtM Info
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL	19,80	14.245,42
BCO CNH CAPITAL SA	18,20	1.412,62
BCO DAYCOVAL SA	17,80	5.979,37
BCO DESENVOLVIMENTO MINAS	17,60	3.270,02
BCO BTG PACTUAL SA	17,50	14.508,87
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	17,50	167.795,13
ITAUSA INVESTS ITAU SA	16,90	147.178,55
BCO TRIANGULO SA	16,80	2.144,21
BCO BRADESCO SA	16,50	839.366,74
BCO BRASIL SA	16,10	100.632,19
BCO FIDIS INVEST SA (EX BCO FIAT	16,10	3.892,12
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	16,10	174.821,14
BCO VOLKSWAGEN SA	14,90	7.212,72
BCO GMAC SA	14,20	6.352,50
BCO SAFRA SA	14,00	25.799,09
BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	13,10	22.069,18
BCO INDUSVAL SA	13,10	1.537,16
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	13,10	79.360,58



Aquisições durante o Mês

Títulos Privados

Produto	Emissor	Inf.	Taxa	(%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
CDB_cdi - BBDC	BBDC	0,95	0,00	101.25	29/10/2015	brA-1	SP	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
CDB_cdi - BITA	BITA	993,51	0,00	113.00	18/01/2016	brA-1	SP	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BBDC	1.693,02	0,00	106.25	05/08/2016	brA-1	SP	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BBDC	5.267,18	0,00	106.25	05/08/2016	brA-1	SP	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BBDC	745,74	0,00	106.25	12/09/2016	brA-1	SP	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BBDC	71.849,15	0,00	106.25	06/09/2018	brAA+	SP	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBNP	BBNP	377,25	0,00	107.00	26/01/2016	brAA+	SP	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BCEF	BCEF	372,53	0,00	107.00	14/03/2016	brA-1	SP	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BRIV	BRIV	189,80	0,00	108.00	07/01/2016	F1+(bra)	FR	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - SANB	SANB	668,01	0,00	107.00	11/09/2017	brAA+	SP	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM

Alterações de Ratings



Títulos Privados

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
CDB_cdi - BSAF	BCO SAFRA SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
CDB_cdi - BSAF	BCO SAFRA SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
CDB_cdi - BSAF	BCO SAFRA SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
CDB_cdi - IDVL	BCO INDUSVAL SA	MOODY	BR-4	-	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
CDB_cdi - IDVL	BCO INDUSVAL SA	SP	brA-2	brA-3	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
CDB_cdi - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
CDB_cdi - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBDC	BCO BRADESCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBNP	BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBNP	BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BBNP	BCO BNP PARIBAS BRASIL SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BDMG	BCO DESENVOLVIMENTO MINAS	SP	brAA+	brAA	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BDMG	BCO DESENVOLVIMENTO MINAS	SP	brAA+	brAA	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BITA	ITAU UNIBANCO SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BPAC	BCO BTG PACTUAL SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BPAC	BCO BTG PACTUAL SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BPAC	BCO BTG PACTUAL SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BPAC	BCO BTG PACTUAL SA	SP	brAA	brAA-	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BSAF	BCO SAFRA SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BSAF	BCO SAFRA SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BVKW	BCO VOLKSWAGEN SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - BVKW	BCO VOLKSWAGEN SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM



RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR

30/Set/2015

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI - SANB	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	SP	brAAA	brAA+	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM

Debêntures

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
TERP24	TERMOPERNAMBUCO SA	SP	brAA+	brAA	Emissão	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM