

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR 2016-04-29

29/04/2016

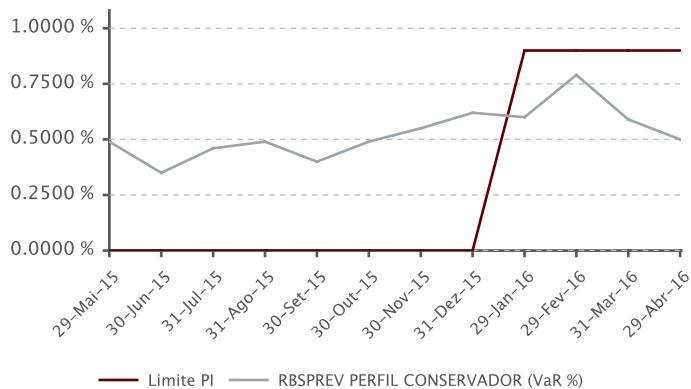
RISCO DE MERCADO

VAR

Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PERFIL CONSERVADOR	151,305,676.21	151,425,167.16	0.50%	0.90%	✓	-	-	-	-	(1.50)%

* VaR Rel. representa o % de valor em risco (VaR), em relação ao risco da carteira teórica (IBOVESPA, IBX, IBX50 e outros).

EVOLUÇÃO GRÁFICA



Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR 2016-04-29

29/04/2016

RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	34,078,803.21	100.00	22.51	50.00	✓
2 - Faixa AA+	32,303,479.66	94.79	21.33	40.00	✓
3 - Faixa A+	5,130,483.63	15.05	3.39	20.00	✓
4 - Faixa BBB+	341,418.14	1.00	0.23	10.00	✓
5 - Faixa BB-	0.00	0.00	0.00	5.00	✓
Outros (*)	-	(383,022.01)	(1.12)	(0.25)	

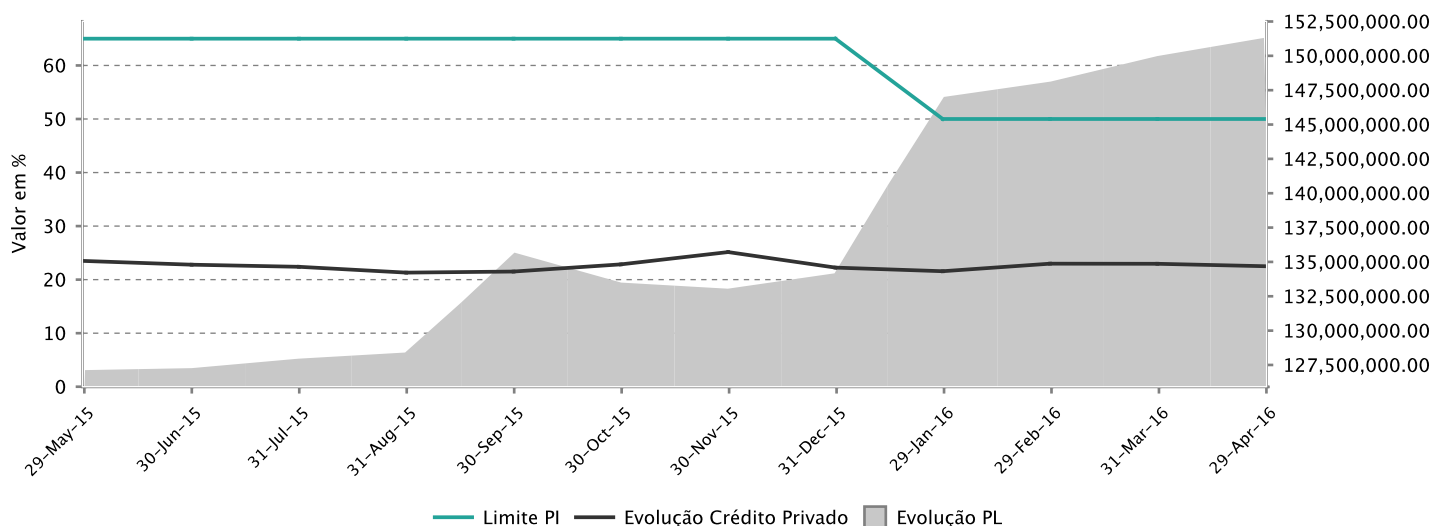
Total Crédito Privado 34,078,803.21

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	22.51	50.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	7,263,719.38	4.80%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	6,377,037.46	4.21%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	4,725,308.66	3.12%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	3,985,840.97	2.63%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	3,244,290.99	2.14%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	2,997,511.18	1.98%	20.00%	✓
BNDES PARTICIPACOES SA BNDESPAR	797,423.01	0.53%	10.00%	✓
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	582,328.64	0.38%	10.00%	✓
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS RCI BRASIL I	550,413.02	0.36%	10.00%	✓
BR MALLS PARTICIPACOES SA	501,576.15	0.33%	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.

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR 2016-04-29

29/04/2016

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	1.22%	0.15%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5	0.00%	0.00%
SUL AMERICA RENDA FIXA ATIVO FI	0.00%	0.00%
SANT FIC FI IMA B 5 TIT PUBL RF	0.00%	0.00%
SANT FI IMA B 5 TITULOS PUBLICOS	0.00%	0.00%
ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION	0.00%	0.00%
SUL AMERICA INDICES FI RENDA FIXA	0.00%	0.00%
ITAU CAIXA RENDA FIXA LONGO	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%	0.21%
Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*	0.48%	
Total do percentual gasto com compra de opções*	0.06%	

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	74.55%	74.55%	10.00%	✓
21	5.75%	80.30%	20.00%	✓
252	0.70%	81.00%	50.00%	✓
Longo	19.00%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1,447,257.76	1,350,637,070.64	0.11%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	49,253,344.67	67,599,979.39	72.86%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	24,179,963.53	50,480,091.12	47.90%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	24,155,057.94	50,428,097.52	47.90%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	52,389,543.26	71,904,396.46	72.86%

ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.04%	96.00%	100.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.96%	0.00%	4.00%	✓

* Os valores percentuais de alocação por segmento são calculados com base na abertura dos fundos em nível de ativos (salvas exceções previstas na legislação vigente para fundos de investimento no exterior e fundos de investimento enquadrados no segmento de investimentos estruturados). Desta forma, não são consideradas as classificações dos fundos em si.

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.