

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR 2016-04-29

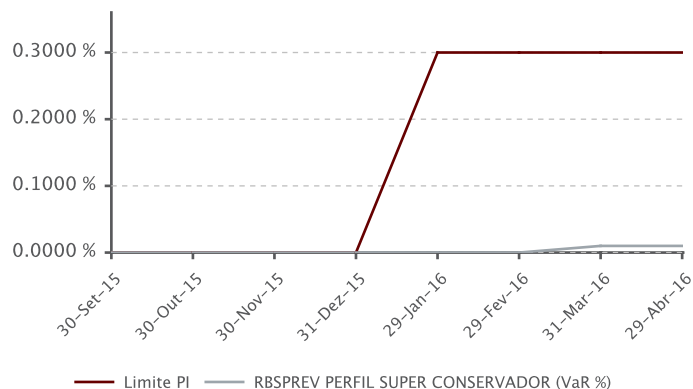
29/04/2016

RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PERFIL SUPER CONSERVADOR	8,000,697.93	8,010,106.51	0.01%	0.30%	✓	-	-	-	-	(0.00)%

* 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 SUPER CONSERVADOR 2016-04-29

29/04/2016

RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	3,032,448.79	100.00	37.86	50.00	✓
2 - Faixa AA+	2,775,488.68	91.53	34.65	40.00	✓
3 - Faixa A+	181,844.97	6.00	2.27	20.00	✓
4 - Faixa BBB+	30,617.41	1.01	0.38	10.00	✓
5 - Faixa BB-	4,672.11	0.15	0.06	5.00	✓
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00	

Total Crédito Privado 3,032,448.79

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

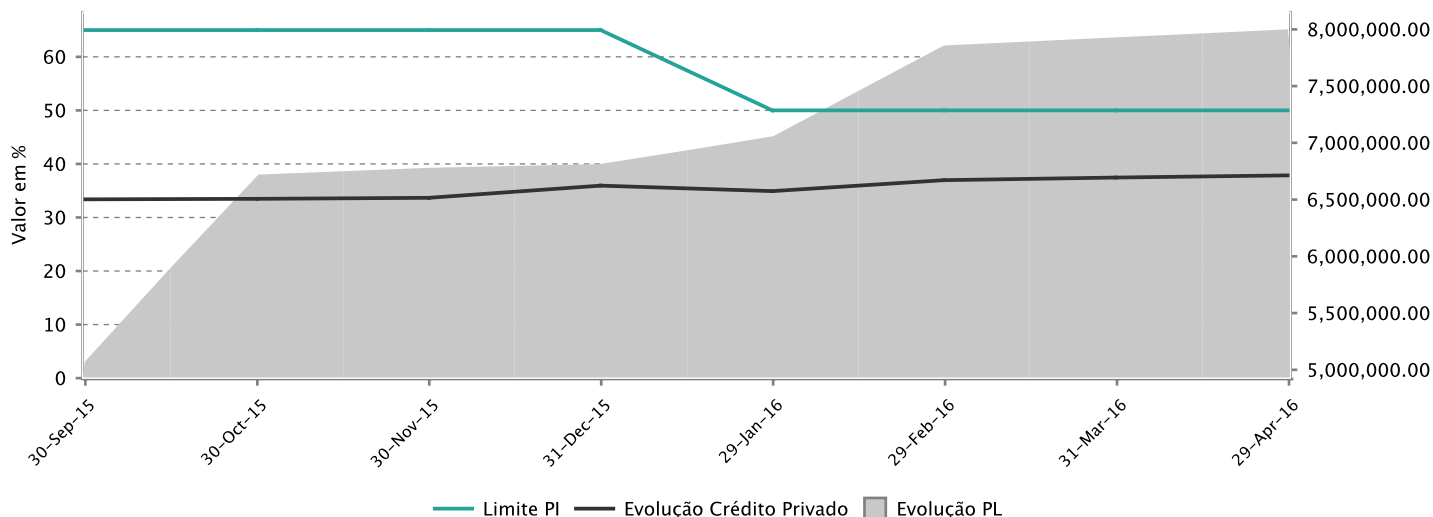
LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	37.86	50.00	✓
Grau Especulativo	0.06	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
LF CDI	1,167.63	CIA CREDITO FINANC INVEST RCI BRASIL	-	-	BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI	3,504.48	CIA CREDITO FINANC INVEST RCI BRASIL	-	-	BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR 2016-04-29

29/04/2016

RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	1,517,463.58	18.94%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	346,127.25	4.32%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	275,994.70	3.45%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	247,541.78	3.09%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	196,135.94	2.45%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	177,034.92	2.21%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	43,455.62	0.54%	20.00%	✓
AES TIETE ENERGIA SA	32,814.14	0.41%	10.00%	✓
TERMOPERNAMBUCO SA	31,318.09	0.39%	10.00%	✓
BCO BTG PACTUAL SA	25,945.30	0.32%	20.00%	✓

DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
BRADESCO FI REFERENCIADO DI	0.12%	0.00%
RBSPREV PERFIL SUPER	0.00%	0.00%

Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia* 0.12%

Total do percentual gasto com compra de opções* 0.00%

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	65.96%	65.96%	10.00%	✓
21	0.11%	66.07%	20.00%	✓
252	17.70%	83.77%	50.00%	✓
Longo	16.23%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	8,010,106.51	6,254,880,112.52	0.13%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	100.00%	100.00%	100.00%	✓

* 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.