

Ciente: RBSPREV PLANO CV

Data-Base: 30-dez-16

Segmentos de Aplicação	Alocação		Limite	Status
Renda Fixa	249.979.572,04	96,06%	100,00%	OK
Renda Variável	595.025,38	0,23%	70,00%	OK
Investimentos Estruturados	9.451.545,50	3,63%	20,00%	OK
Investimentos no Exterior	205.057,95	0,08%	10,00%	OK
Imóveis	0,00	0,00%	8,00%	OK
Operações com Participantes	0,00	0,00%	15,00%	OK
<b>Total dos Recursos Garantidores</b>	<b>260.231.200,87</b>	<b>100,00%</b>		
Cotas de Fundos Multimercados Institucionais	0,00	0,00%		
Disponível	19.177,31	0,01%		
Passivo Operacional (Balancete)	0,00	0,00%		
Passivo Contingencial (Balancete)	0,00	0,00%		

Subcategorias de Alocação	Alocação		Limite	Status
<b>Renda Fixa</b>				
Títulos da Dívida Pública Mobiliária Federal	199.255.078,09	76,57%	100,00%	OK
Conjunto dos ativos de renda fixa, excluídos os títulos públicos federais	49.204.400,01	18,91%	80,00%	OK
Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais	0,00	0,00%	80,00%	OK
CDBs, RDBs e Letras Financeiras	40.370.878,52	15,51%	80,00%	OK
DPGEs	0,00	0,00%	80,00%	OK
Debêntures	7.964.952,01	3,06%	80,00%	OK
LH, LCI e LCA	0,00	0,00%	80,00%	OK
Certificado de Operações Estruturadas - COE	0,00	0,00%	80,00%	OK
FIDCs e FICs de FIDCs	1.754.753,77	0,67%	20,00%	OK
Notas Promissórias, CCBs e CCCBs	11.050,98	0,00%	20,00%	OK
NCE e CCE	0,00	0,00%	20,00%	OK
Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRIs)	0,00	0,00%	20,00%	OK
Cédulas de Crédito Imobiliário (CCIs)	0,00	0,00%	20,00%	OK
Títulos do agronegócio (CPR, CRA, CDCA e WA)	0,00	0,00%	20,00%	OK
Demais títulos(exclui debêntures) de cias abertas(exclui securitizadoras)	0,00	0,00%	20,00%	OK
Cotas de Fundos de Renda Fixa	315,21	0,00%		
Operações a termo, opções de renda fixa e swaps	-897.550,49	-0,34%		
Caixa, despesas, disponível, exigível contingencial, exigível operacional e provisões	1.520.093,95	0,58%		
<b>Renda Variável</b>				
Ações da categoria Novo Mercado	277.412,45	0,11%	70,00%	OK
Ações da categoria Nível 2	40.641,76	0,02%	60,00%	OK
Ações da categoria Bovespa Mais	0,00	0,00%	50,00%	OK
Ações da categoria Nível 1	177.690,73	0,07%	45,00%	OK
ETFs e ações não classificadas	99.215,37	0,04%	35,00%	OK
Títulos de emissão de SPEs	0,00	0,00%	20,00%	OK
Debêntures com part. nos lucros, Ouro, Crédito de Carbono e CPAC	0,00	0,00%	3,00%	OK
Cotas de fundos de Renda Variável	0,00	0,00%		
Opções	65,07	0,00%		
<b>Investimentos Estruturados</b>				
Fundos de Participação (Private Equity) e FMIEE	0,00	0,00%	20,00%	OK
Fundos de Investimentos Imobiliário (FII)	0,00	0,00%	10,00%	OK
Fundos Multimercados Estruturados	9.451.545,50	3,63%	10,00%	OK
<b>Investimentos no Exterior</b>				
Ativos emitidos no exterior em fundos sediados no Brasil	205.057,95	0,08%	10,00%	OK
Fundos e FICs de Dívida Externa	0,00	0,00%	10,00%	OK
Cotas de fundos de índice do exterior admitidas a negociação no Brasil	0,00	0,00%	10,00%	OK
Brazilian Deposits Receipts (BDRs)	0,00	0,00%	10,00%	OK
Ações de Cias sediadas no Mercosul	0,00	0,00%	10,00%	OK

**Cliente:** RBSPREV PLANO CV

**Data-Base:** 30-dez-16

Vedações	Status
Short de ações	OK
Opções a descoberto	OK
Swaps sem garantia	OK
Aplicar em veículos que gerem possibilidade de perda superior ao PL	OK
Aplicar em títulos de cias sem registro na CVM	OK
Aplicar em ativos sem ISIN	OK
Aplicar em ações não integrantes das categorias Novo Mercado, Nível 2 e Bovespa Mais <sup>1</sup>	OK
Fundos em desacordo com limite de derivativos	OK

Derivativos	Limite	Status	
Dépósitos de margem para operações com derivativos	3,64%	15,00%	OK
Prêmio pago em opções	0,00%	5,00%	OK

Limites de concentração	Limite	Status
<b>Emissores</b>		
Instituição financeira autorizada pelo Bacen	20,00%	OK
Tesouro estadual ou municipal	10,00%	OK
Cias abertas e securitizadoras	10,00%	OK
Patrocinador do plano de benefícios	10,00%	OK
Organismos multilaterais	10,00%	OK
Cias limitadas	5,00%	OK
<b>Veículos</b>		
Private Equity	10,00%	OK
Fundo Imobiliário	10,00%	OK
FIDC	10,00%	OK
ETFs	10,00%	OK
Fundos Multimercados Estruturados	10,00%	OK
SPEs	10,00%	OK
Fundo de Investimento classificado como Dívida Externa	10,00%	OK

Limites de concentração por EFPC	Limite	Status
<b>Veículos de Investimento</b>		
Participação no capital total de uma mesma companhia aberta ou de uma mesma SPE	25,00%	OK
Participação no capital votante de uma mesma companhia aberta	25,00%	OK
Participação no patrimônio líquido de uma mesma instituição financeira autorizada a funcionar pelo Bacen	25,00%	OK
Participação em fundo de índice referenciado em cesta de ações de companhias abertas	25,00%	OK
Participação em fundo de investimento classificado no segmento de investimentos estruturados	25,00%	OK
Participação em fundo de investimento no Brasil que tenha ativos classificados no segmento de investimento no exterior	25,00%	OK
Participação em fundo de índice do exterior admitido à negociação em bolsa de valores do Brasil	25,00%	OK
Participação em fundo de investimento classificado como dívida externa no segmento investimentos no exterior	25,00%	OK
Participação no patrimônio separado constituído nas emissões de certificado de recebíveis com regime fiduciário	25,00%	OK
Aplicação em uma mesma série de títulos ou valores mobiliários	25,00%	OK
Aplicação em uma mesma classe ou série de cotas de FIDCs	25,00%	OK
Aplicações em um mesmo empreendimento imobiliário	25,00%	OK

! Esse relatório contempla os artigos da Resolução CMN n° 3.792 e suas alterações posteriores. Os dados utilizados para a confecção desse relatório foram obtidos junto à Instituição à qual se refere tal relatório. Os valores aqui apresentados decorrem da utilização desses dados, de dados obtidos junto a fontes públicas e da interpretação da legislação aplicável. A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.