

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR 2016-02-29

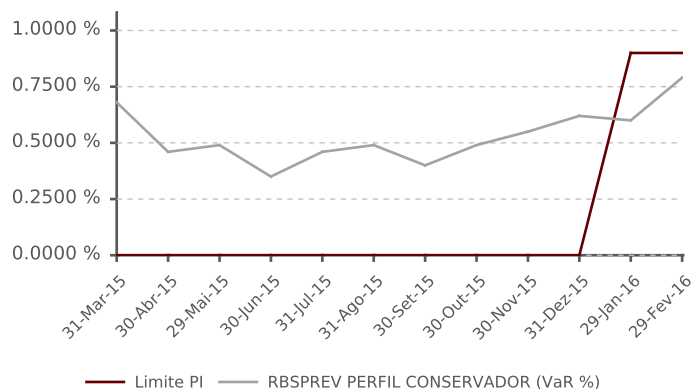
29/02/2016

## RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PERFIL CONSERVADOR	148,124,518.45	148,175,084.75	0.79%	0.90%	✓	-	-	-	-	(1.82)%

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

## EVOLUÇÃO GRÁFICA





## RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	34,055,076.07	100.00	22.98	50.00	✓
2 - Faixa AA+	32,082,005.75	94.21	21.65	40.00	✓
3 - Faixa A+	781,854.52	2.30	0.53	20.00	✓
4 - Faixa BBB+	0.00	0.00	0.00	10.00	✓
5 - Faixa BB-	0.00	0.00	0.00	5.00	✓
Outros (*)	-	(113,446.62)	(0.33)	(0.08)	

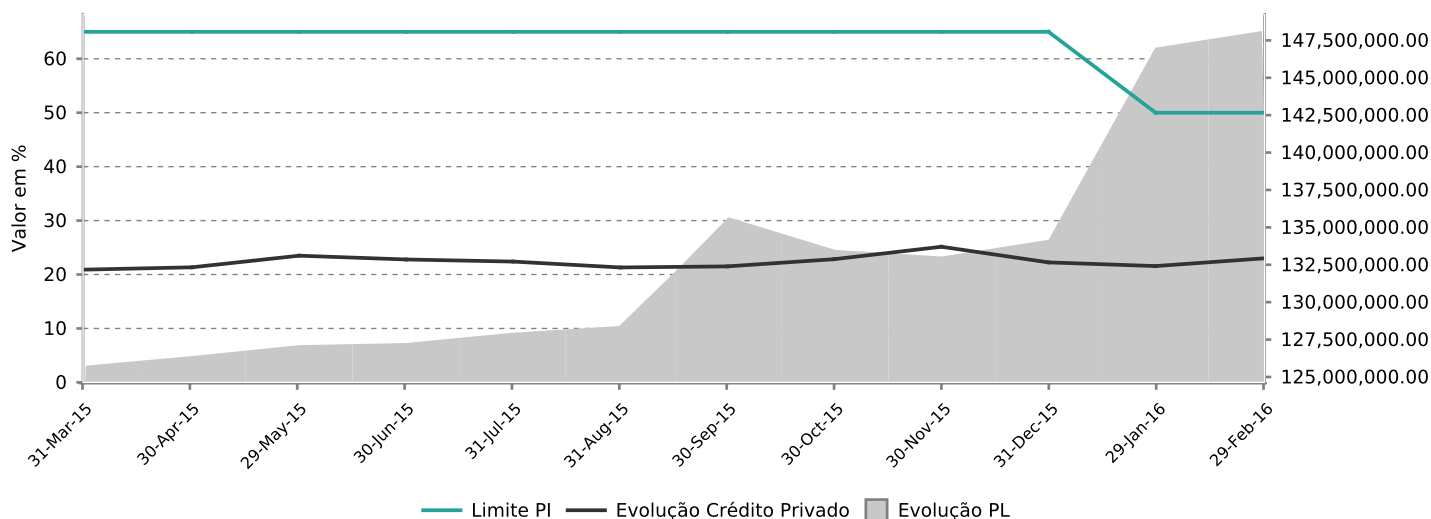
**Total Crédito Privado 34,055,076.07**

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

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	22.98	50.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	7,071,491.78	4.77%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	6,233,720.80	4.21%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	4,470,750.90	3.02%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	3,893,037.66	2.63%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	3,167,185.09	2.14%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	2,926,575.78	1.98%	20.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	944,943.89	0.64%	10.00%	✓
BNDES PARTICIPACOES SA BNDESPAR	783,394.73	0.53%	10.00%	✓
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	609,521.20	0.41%	10.00%	✓
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS RCI BRASIL I	550,099.02	0.37%	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 2016-02-29

29/02/2016

## 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%	0.16%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5	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%	0.18%
Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*	0.48%	
Total do percentual gasto com compra de opções*	0.07%	

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

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	75.59%	75.59%	10.00%	✓
21	4.19%	79.79%	20.00%	✓
252	1.16%	80.95%	50.00%	✓
Longo	19.05%	100.00%	-	-

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1,386,193.89	1,513,473,736.56	0.09%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	48,365,646.35	66,381,617.37	72.86%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	23,666,916.24	49,409,011.78	47.90%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	23,685,920.78	49,448,687.64	47.90%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	51,070,407.50	70,093,889.78	72.86%

## ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.06%	96.00%	100.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.94%	0.00%	4.00%	✓

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.

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.