

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO CV 2016-02-29

29/02/2016

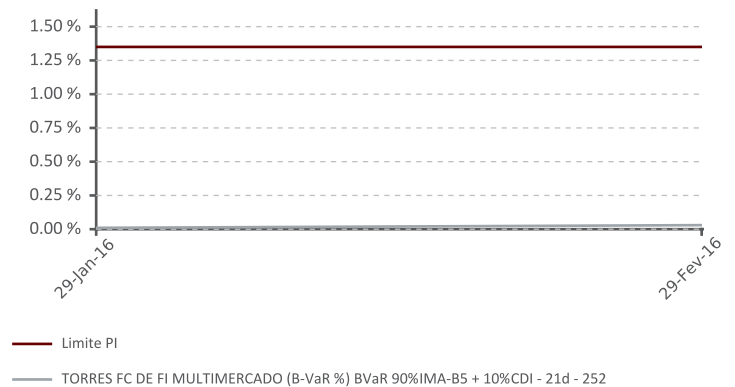
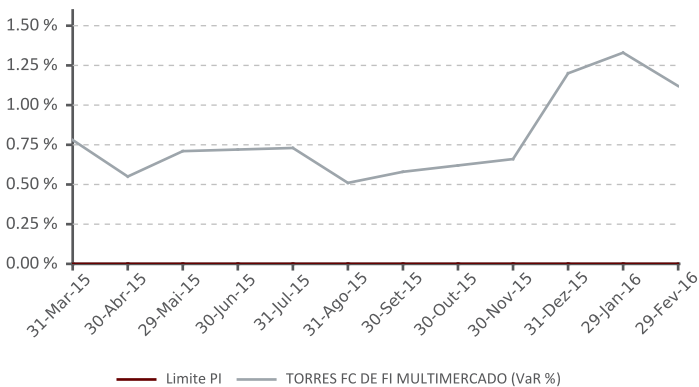
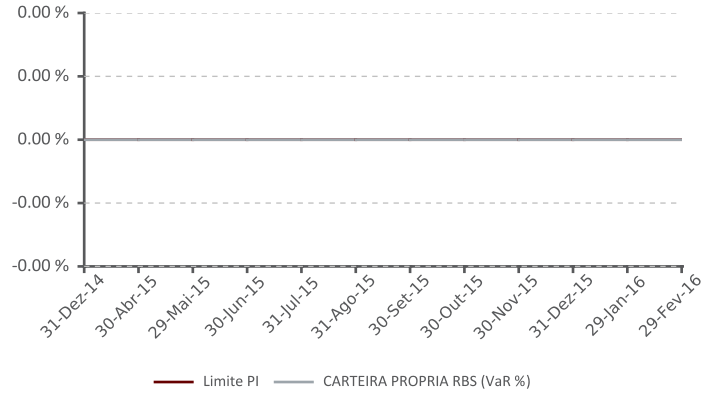
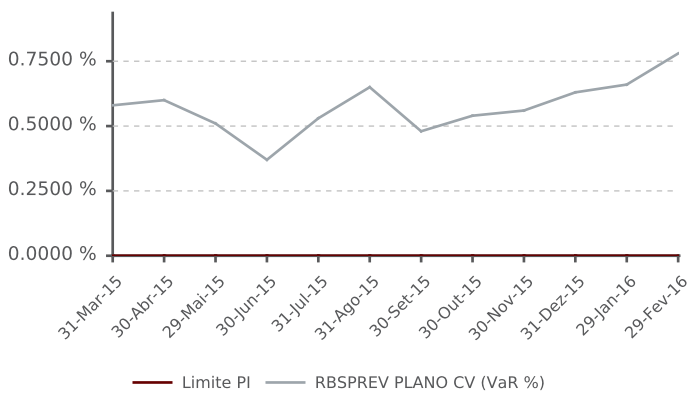
RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PLANO CV	256,006,081.38	256,095,401.82	0.78%	-	—	-	-	-	—	(1.90)%
CARTEIRA PROPRIA	(2,261.90)	(2,261.90)	0.00%	-	—	-	-	-	—	(0.00)%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO (PREV - 21D)	49,404,774.61	49,409,011.78	1.12%	-	—	-	-	-	—	(2.64)%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO (PREV - 21D -	49,432,372.42	49,448,687.65	1.26%	-	—	-	-	-	—	(2.60)%
BRASIL PLURAL MACRO FIC FI MULTI	3,738,700.64	3,738,700.24	0.00%	6.25%	✓	-	-	-	—	0.00%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	66,474,357.30	66,381,617.37	0.97%	3.00%	✓	-	-	-	—	(1.87)%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	69,945,259.51	70,093,889.79	0.59%	3.00%	✓	-	-	-	—	(1.07)%
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	6,534,606,096.40	6,543,439,694.37	0.00%	0.30%	✓	-	-	-	—	0.00%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	427,214,003.25	427,720,493.40	8.93%	-	—	-	91.41%	100.00%	✓	(14.04)%
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1,605,471,004.52	1,598,490,855.35	2.17%	6.25%	✓	-	-	-	—	1.43%
CARTEIRA ALM	5,840,472.03	5,841,059.01	0.52%	-	—	-	-	-	—	(1.47)%

BVAR						
Mandato	PL Calculado	PL Informado	Benchmark	BVaR	Limite	Status
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	49,404,774.61	49,409,011.78	90%IMA-B5 + 10%CDI	0.03%	1.35%	✓
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	49,432,372.42	49,448,687.65	90%IMA-B5 + 10%CDI	0.39%	1.35%	✓

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

EVOLUÇÃO GRÁFICA



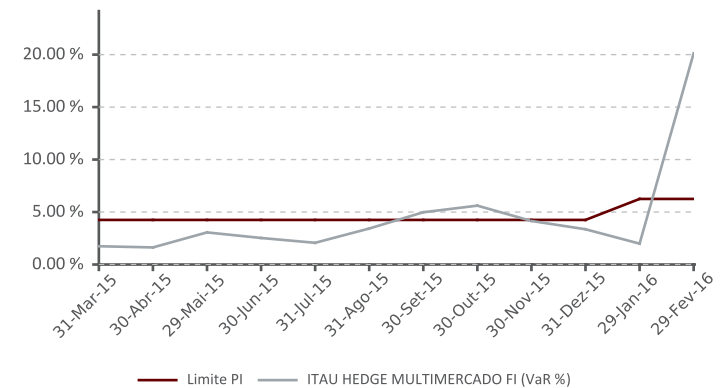
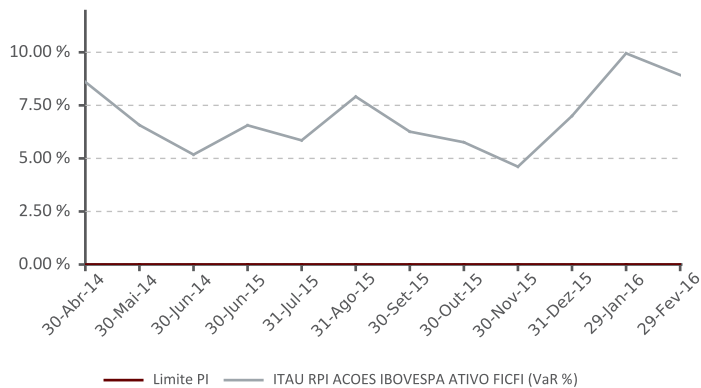
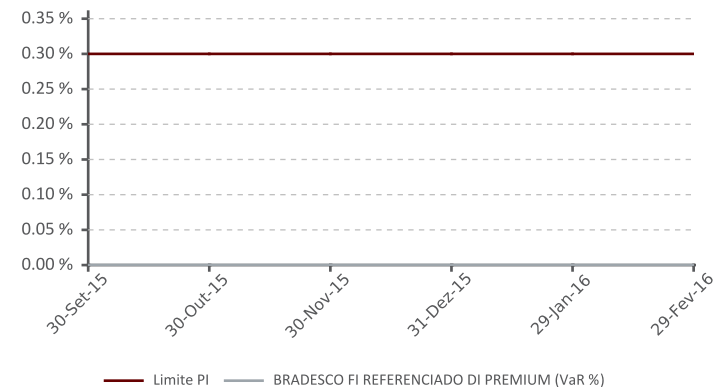
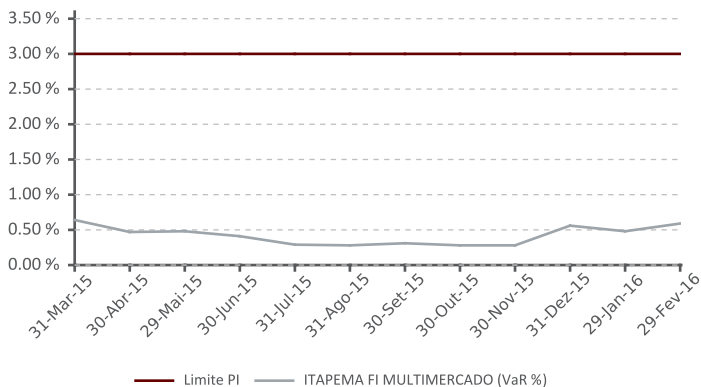
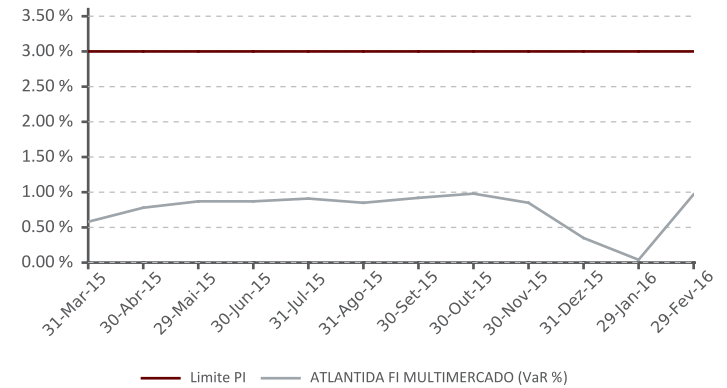
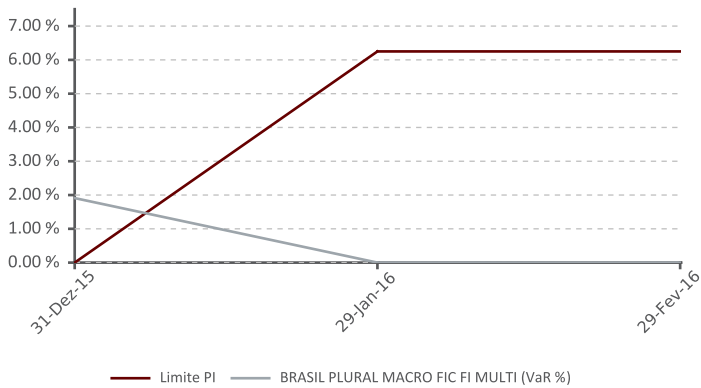
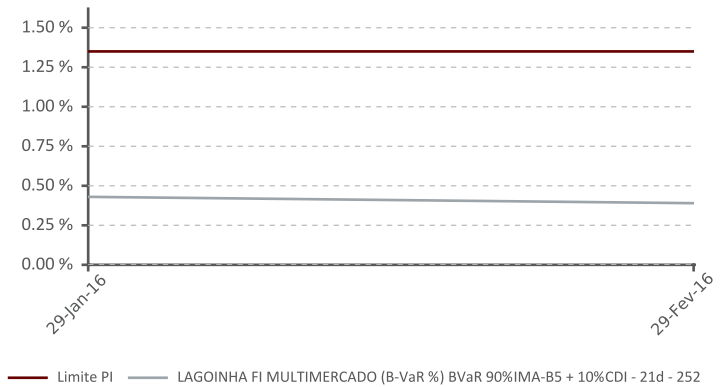
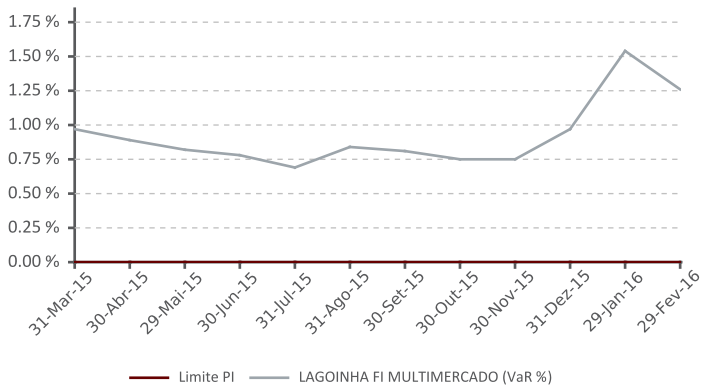
1. Este documento é de propriedade exclusiva da Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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

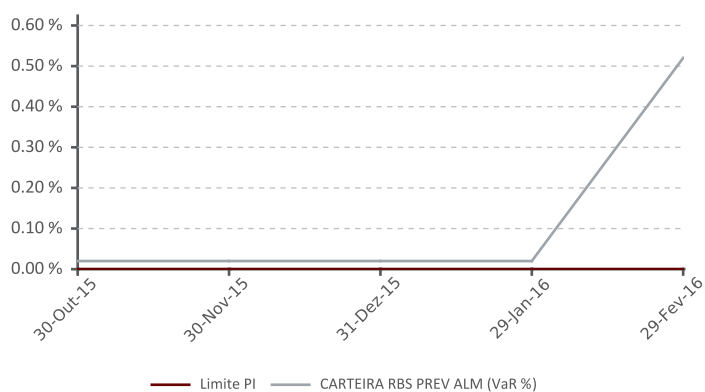


RBSPREV PLANO CV 2016-02-29

29/02/2016



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.





RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	51,307,856.16	99.94	20.03	50.00	✓
2 - Faixa AA+	48,377,345.93	94.23	18.89	40.00	✓
3 - Faixa A+	1,222,415.88	2.38	0.48	20.00	✓
4 - Faixa BBB+	23,743.31	0.05	0.01	10.00	✓
5 - Faixa BB-	0.00	0.00	0.00	5.00	✓
Outros (*)	-	(155,704.94)	(0.30)	(0.06)	

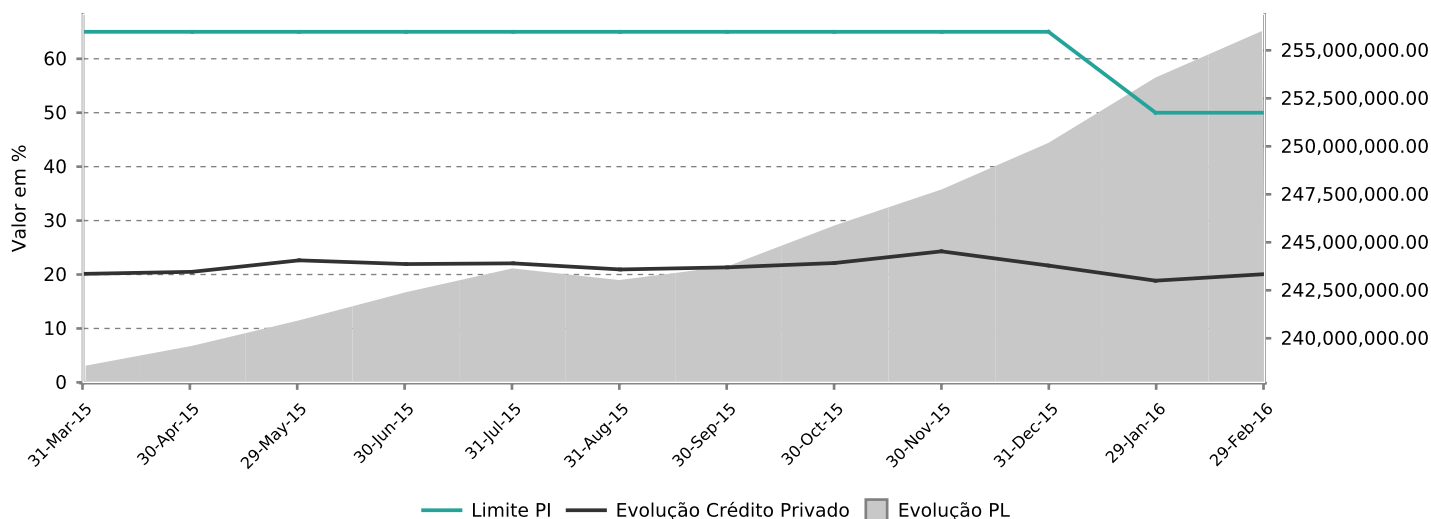
Total Crédito Privado 51,336,946.62

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	20.05	50.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	12,241,961.39	4.78%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	8,740,028.15	3.41%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	6,578,034.15	2.57%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	5,383,064.12	2.10%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	4,669,485.82	1.82%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	4,179,080.58	1.63%	20.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	1,551,173.62	0.61%	10.00%	✓
BNDES PARTICIPACOES SA BNDESPAR	1,283,105.28	0.50%	10.00%	✓
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	836,564.91	0.33%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	797,350.03	0.31%	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.



DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
BNY MELLON ARX CASH FI CURTO	0.00%	0.00%
BRADESCO FI REFERENCIADO DI	0.11%	0.00%
ITAU CAIXA ACOES FI	11.23%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO	0.00%	0.00%
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%
BNY MELLON ARX CASH V FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX CASH IV FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX CASH II FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX CASH III FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5	0.00%	0.00%
JGP INSTITUCIONAL FIA	0.00%	0.30%
ITAU INSTITUCIONAL BOLSA INDEX	0.39%	0.00%
IBIUNA EQUITIES MASTER FI EM	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%
PACIFICO ACOES MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION	0.00%	0.00%
CARTEIRA PROPRIA RBS	0.00%	0.00%
ITAU INST ACOES FOF MULTIGESTOR	0.00%	0.00%
APEX MASTER FI DE ACOES	0.00%	1.57%
APEX ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	0.69%
SUL AMERICA INDICES FI RENDA FIXA	0.00%	0.00%
ITAU CAIXA RENDA FIXA LONGO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX OVER FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
PACIFICO RV FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
PACIFICO RV MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
ITAU VERTICE IBOVESPA INDEX FICFI	0.00%	0.00%

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 PLANO CV 2016-02-29

29/02/2016

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
VERTRA INSTITUCIONAL FC FI ACOES	0.00%	0.00%
VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI	0.00%	3.31%
ITAU FOF RPI MASTER ACOES IBOV	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUID FI REF DI LP	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
INDIE INSTITUCIONAL FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
INDIE INSTITUCIONAL MASTER FI	0.00%	0.00%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
OCEANA VALOR MASTER FIA	0.00%	0.00%
RBSPREV PLANO CV	0.00%	0.00%
BRASIL PLURAL FI DE ACOES	0.00%	0.00%
BRASIL PLURAL FC FI DE ACOES	0.00%	0.00%
OCEANA VALOR A FIC FI DE ACOES	0.00%	0.00%
ITAU RF JUROS OCEAN FI	0.00%	0.00%
ITAU VERSO J RF FI	0.00%	0.18%
IBIUNA EQUITIES A FC DE FI EM	0.00%	0.00%
NORMANDIE MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
NORMANDIE FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
CARTEIRA RBS PREV ALM	0.00%	0.00%

Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia* 0.38%

Total do percentual gasto com compra de opções* 0.05%

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	61.96%	61.96%	1.00%	✓
21	18.53%	80.49%	20.00%	✓
252	1.76%	82.25%	50.00%	✓
Longo	17.75%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	7,868,575.73	6,543,439,694.39	0.12%
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	2,310,323.15	1,513,473,736.56	0.15%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	1,408,755.55	427,720,493.40	0.33%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	66,381,617.28	66,381,617.37	100.00%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	49,409,010.93	49,409,011.78	100.00%
BRASIL PLURAL MACRO FIC FI MULTI	3,335,746.72	95,237,064.77	3.50%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	49,448,686.39	49,448,687.64	100.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	70,093,888.96	70,093,889.78	100.00%

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.



ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	98.63%	73.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.47%	0.00%	10.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.90%	0.00%	12.00%	✓