

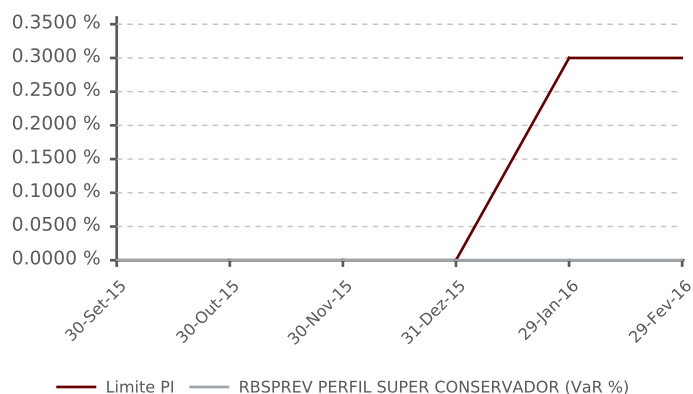


RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PERFIL SUPER CONSERVADOR	7,857,953.21	7,868,575.73	0.00%	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





RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	2,909,345.44	100.00	36.97	50.00	✓
2 - Faixa AA+	2,686,864.74	92.35	34.15	40.00	✓
3 - Faixa A+	149,324.31	5.13	1.90	20.00	✓
4 - Faixa BBB+	23,743.31	0.82	0.30	10.00	✓
5 - Faixa BB-	0.00	0.00	0.00	5.00	✓
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00	

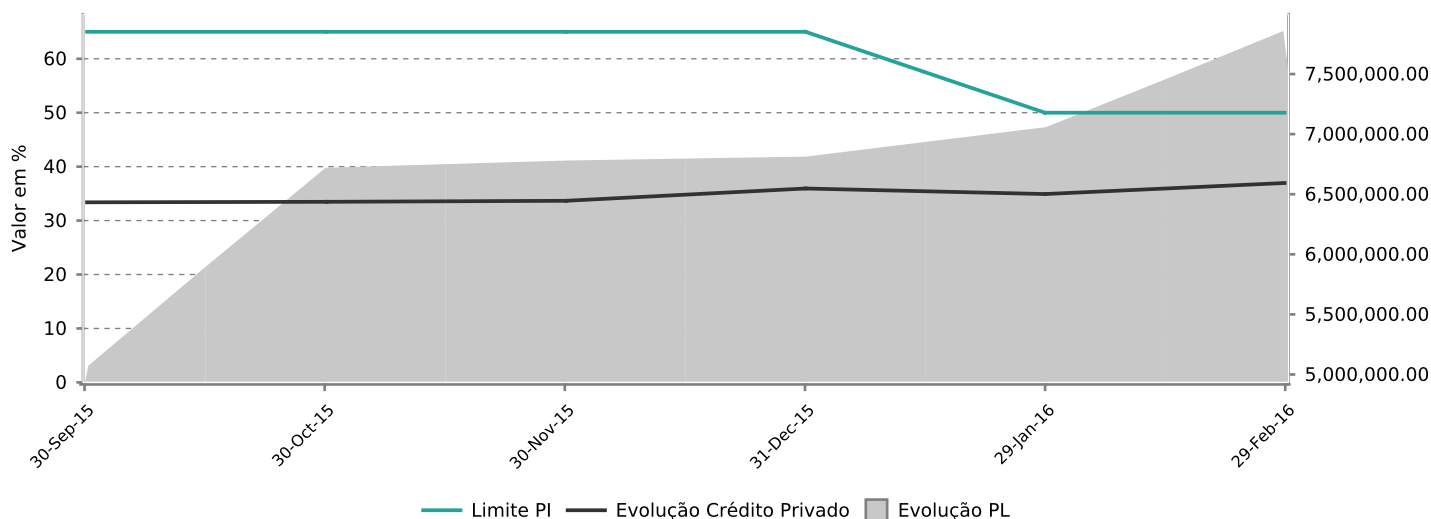
Total Crédito Privado **2,909,345.44**

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	36.97	50.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	1,373,292.51	17.45%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	329,092.30	4.18%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	321,769.91	4.09%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	300,647.28	3.82%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	179,959.09	2.29%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	162,369.38	2.06%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	39,888.64	0.51%	20.00%	✓
AES TIETE ENERGIA SA	30,091.98	0.38%	10.00%	✓
TERMOPERNAMBUCO SA	28,680.97	0.36%	10.00%	✓
BCO BTG PACTUAL SA	23,743.31	0.30%	20.00%	✓

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 SUPER CONSERVADOR 2016-02-29

29/02/2016

DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
BRABESCO FI REFERENCIADO DI	0.11%	0.00%
RBSPREV PERFIL SUPER	0.00%	0.00%
Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*	0.11%	
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	66.44%	66.44%	10.00%	✓
21	0.93%	67.37%	20.00%	✓
252	17.15%	84.53%	50.00%	✓
Longo	15.47%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
BRABESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	7,868,575.73	6,543,439,694.39	0.12%

ALOCÇÃO POR SEGMENTO

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

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.