

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR 2016-01-29

29/01/2016

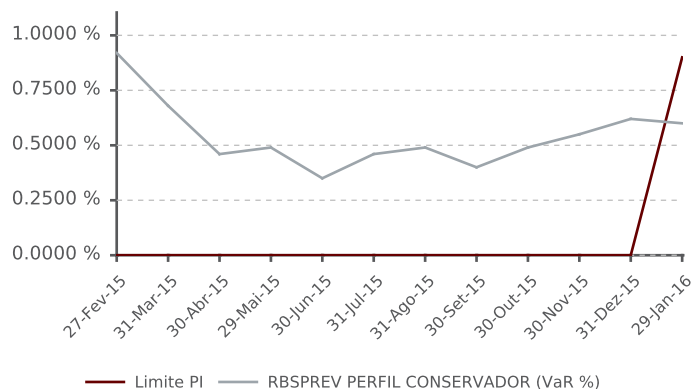
## RISCO DE MERCADO

### VAR

Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PERFIL CONSERVADOR	147,008,844.34	147,156,491.95	0.60%	0.90%	✓	-	-	-	-	(1.15)%

\* 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 CONSERVADOR 2016-01-29

29/01/2016

## RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	31,740,607.28	100.00	21.57	50.00	✓
2 - Faixa AA+	22,555,941.48	71.06	15.33	40.00	✓
3 - Faixa A+	794,508.86	2.50	0.54	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 (*)	-	0.00	0.00	0.00	

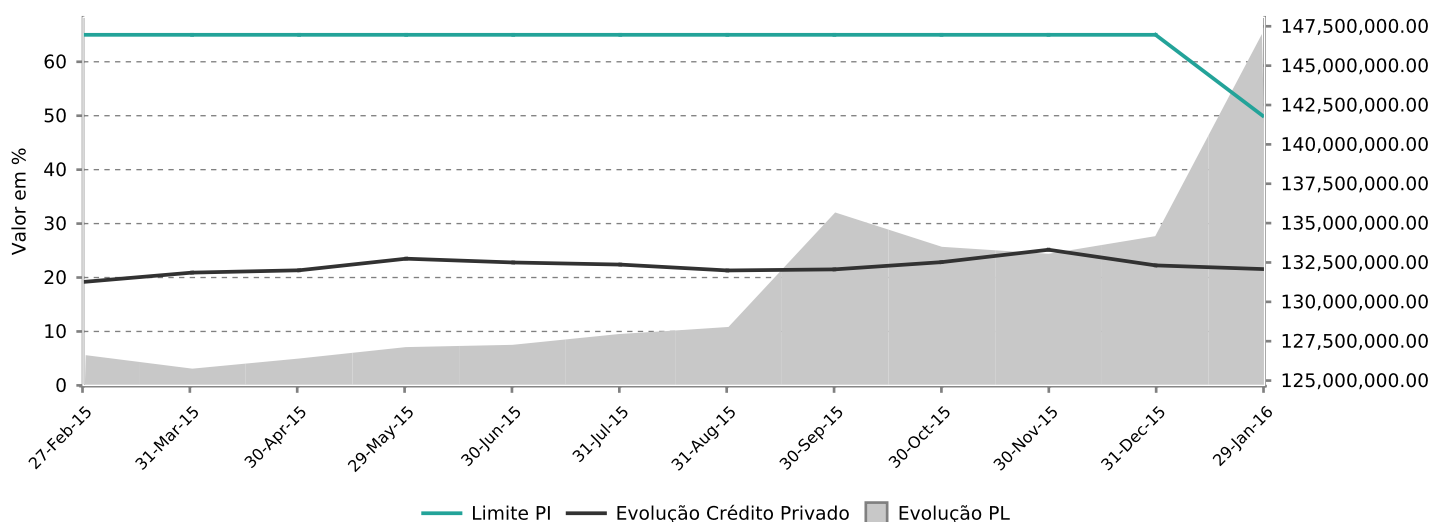
**Total Crédito Privado 31,740,607.28**

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

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	21.57	50.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	6,983,861.44	4.75%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	4,370,418.84	2.97%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	3,357,559.55	2.28%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	2,895,437.62	1.97%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	2,368,237.54	1.61%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	2,323,059.12	1.58%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	2,083,720.66	1.42%	20.00%	✓
BR MALLS PARTICIPACOES SA	1,040,552.04	0.71%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	1,028,867.60	0.70%	10.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	932,782.48	0.63%	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 2016-01-29

29/01/2016

## 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%	0.05%
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%	0.07%
Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*	0.45%	
Total do percentual gasto com compra de opções*	0.02%	

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

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	78.35%	78.35%	10.00%	✓
21	5.15%	83.50%	20.00%	✓
252	1.15%	84.64%	50.00%	✓
Longo	15.36%	100.00%	-	-

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1,392,128.62	1,600,005,494.09	0.09%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	47,970,194.08	65,838,860.94	72.86%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	23,634,152.69	49,340,611.04	47.90%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	23,705,862.28	49,490,317.90	47.90%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	50,454,154.29	69,248,084.37	72.86%

## ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.05%	96.00%	100.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.95%	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.