

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO CV 2016-01-29

29/01/2016

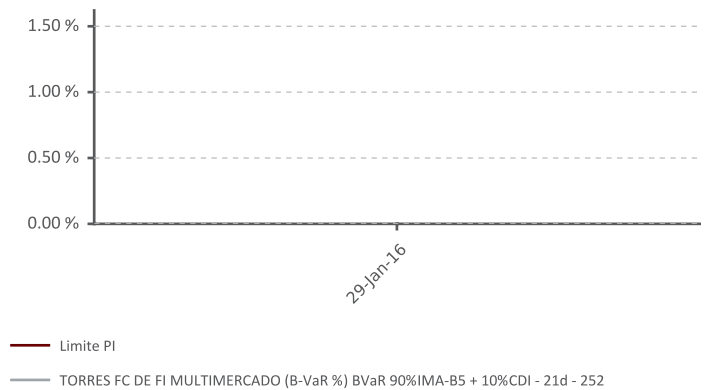
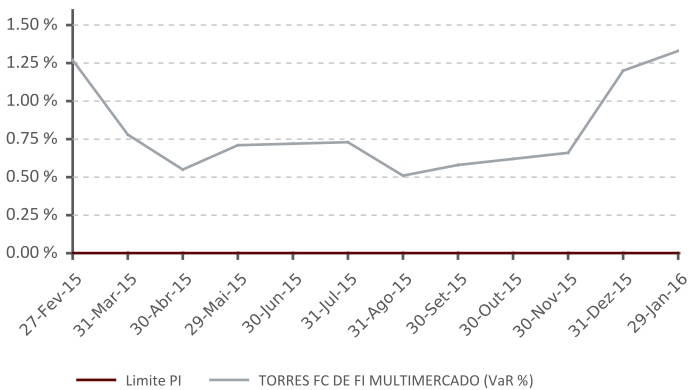
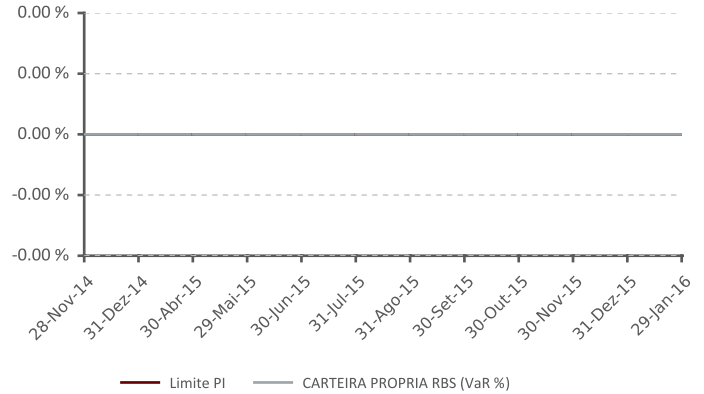
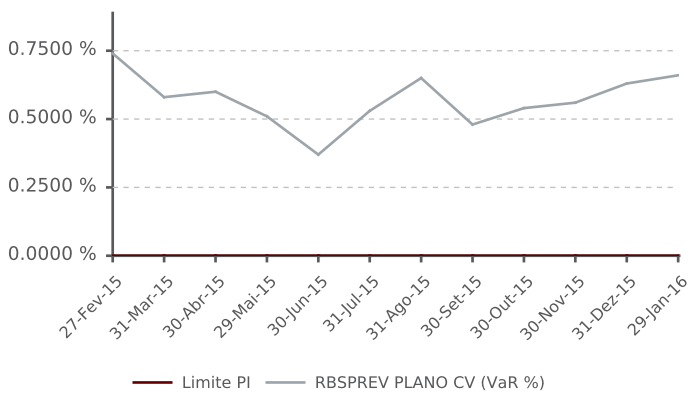
RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PLANO CV	253,575,601.44	253,812,251.43	0.66%	-	—	-	-	-	—	(1.35)%
CARTEIRA PROPRIA	(2,367.49)	(2,367.49)	0.00%	-	—	-	-	-	—	(0.00)%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO (PREV - 21D)	49,316,483.86	49,340,611.04	1.33%	-	—	-	-	-	—	(2.66)%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO (PREV - 21D -	49,460,286.37	49,490,317.91	1.54%	-	—	-	-	-	—	(2.76)%
BRASIL PLURAL MACRO FIC FI MULTI	1,018,024.61	1,018,023.99	0.00%	6.25%	✓	-	-	-	—	0.00%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	65,820,553.99	65,838,860.94	0.04%	3.00%	✓	-	-	-	—	(0.08)%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	69,099,351.00	69,248,084.39	0.48%	3.00%	✓	-	-	-	—	(0.73)%
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	6,490,382,051.72	6,500,223,272.15	0.00%	0.30%	✓	-	-	-	—	0.00%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	410,877,070.06	411,497,965.04	9.95%	-	—	-	107.14%	100.00%	✗	(14.51)%
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1,600,230,258.01	1,590,553,670.74	1.99%	6.25%	✓	-	-	-	—	2.04%
CARTEIRA ALM	5,789,860.30	5,792,568.30	0.02%	-	—	-	-	-	—	0.00%

BVAR						
Mandato	PL Calculado	PL Informado	Benchmark	BVaR	Limite	Status
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	49,316,483.86	49,340,611.04	90%IMA-B5 + 10%CDI	0.01%	1.35%	✓
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	49,460,286.37	49,490,317.91	90%IMA-B5 + 10%CDI	0.43%	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



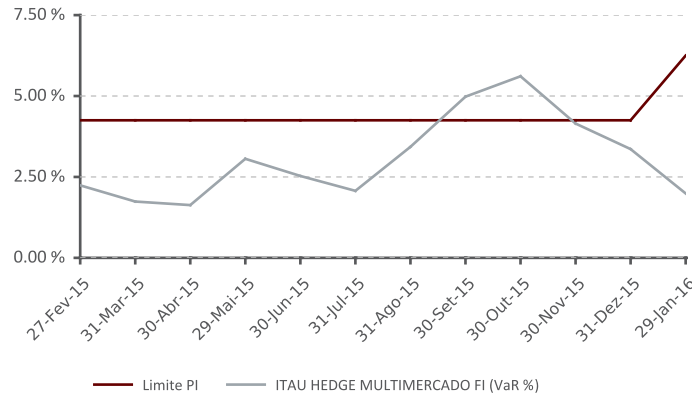
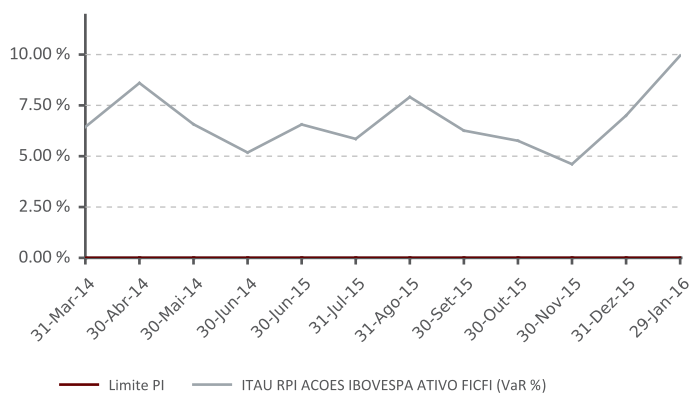
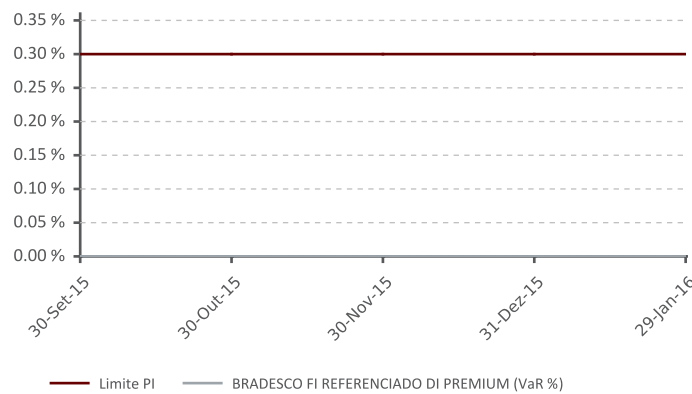
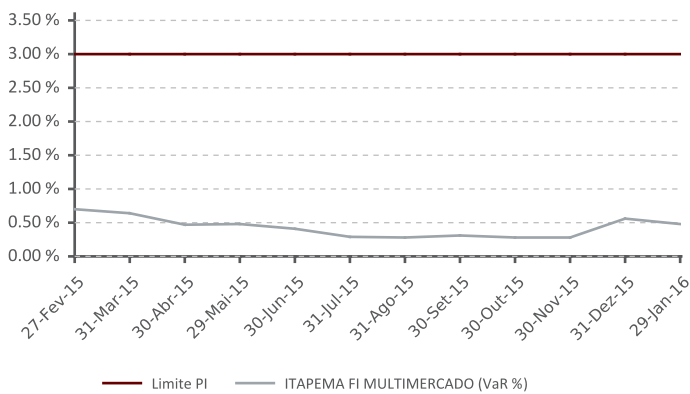
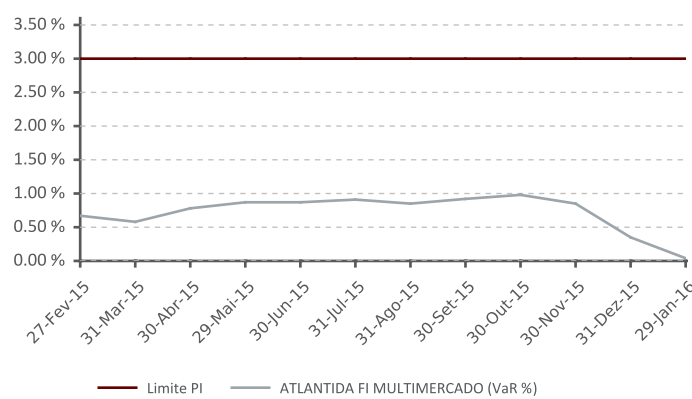
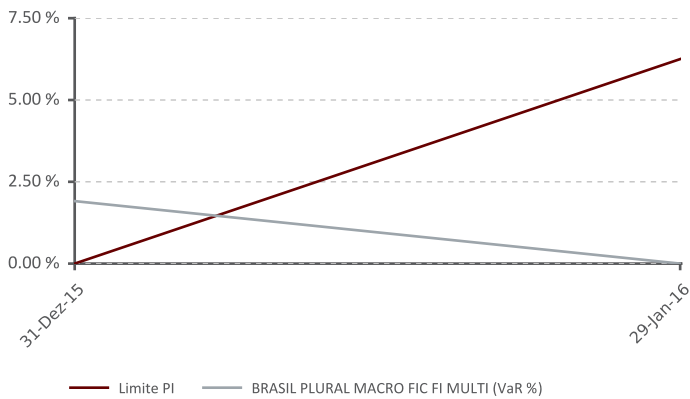
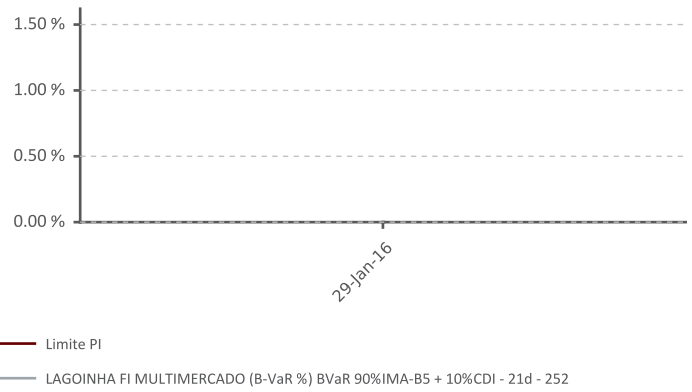
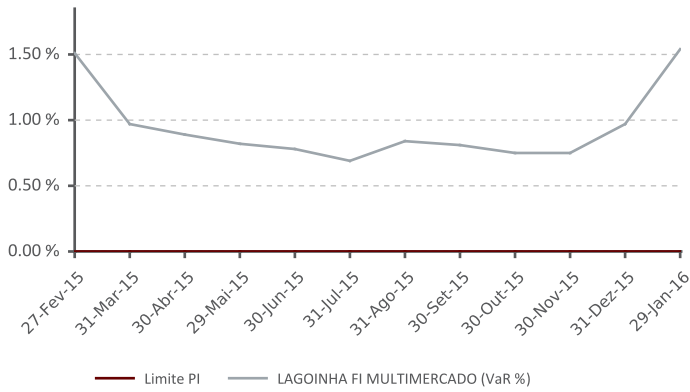
1. Este documento é de propriedade exclusiva da Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2016-01-29

29/01/2016



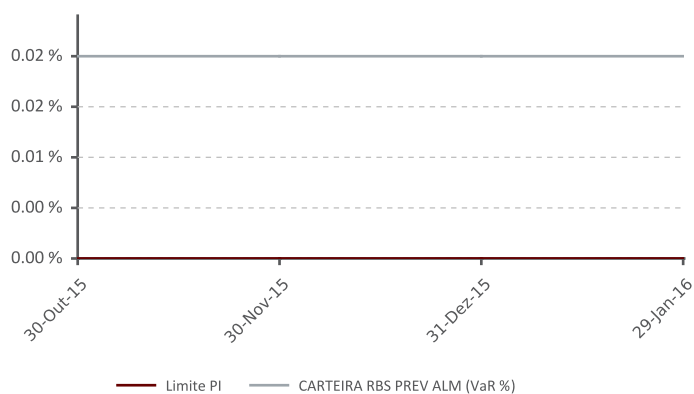
1. Este documento é de propriedade exclusiva da Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
 2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou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

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO CV 2016-01-29

29/01/2016



Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO CV 2016-01-29

29/01/2016

RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	47,826,632.72	99.94	18.84	50.00	✓
2 - Faixa AA+	34,624,015.66	72.35	13.64	40.00	✓
3 - Faixa A+	1,216,128.77	2.54	0.48	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	

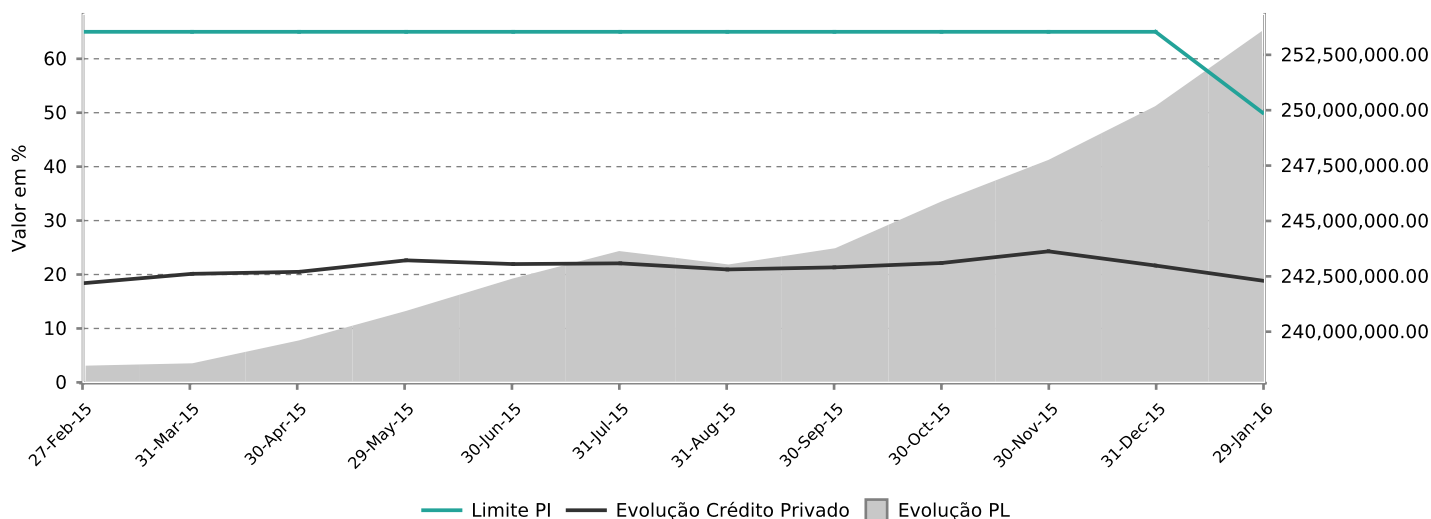
Total Crédito Privado 47,856,887.39

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	18.86	50.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	11,943,127.27	4.71%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	6,360,756.15	2.51%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	4,773,710.58	1.88%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	4,095,110.61	1.61%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	3,514,636.71	1.38%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	3,445,662.54	1.36%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	2,895,596.30	1.14%	20.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	1,703,987.42	0.67%	10.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	1,531,210.04	0.60%	10.00%	✓
BR MALLS PARTICIPACOES SA	1,433,820.06	0.56%	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%
BRABESCO FI REFERENCIADO DI	0.11%	0.00%
ITAU CAIXA ACOES FI	13.65%	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%	0.05%
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%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL BOLSA INDEX	0.34%	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%	0.89%
APEX ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	2.79%
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 2016-01-29

29/01/2016

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%	2.22%
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%	0.01%
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%	0.07%
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*	0.36%	
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	65.33%	65.33%	1.00%	✓
21	18.16%	83.49%	20.00%	✓
252	1.54%	85.03%	50.00%	✓
Longo	14.97%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	7,068,781.87	6,500,223,272.15	0.11%
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	2,320,214.36	1,600,005,494.09	0.15%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	1,352,625.67	411,497,965.04	0.33%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	65,838,860.94	65,838,860.94	100.00%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	49,340,611.04	49,340,611.04	100.00%
BRASIL PLURAL MACRO FIC FI MULTI	3,362,554.44	79,727,036.49	4.22%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	49,490,317.91	49,490,317.90	100.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	69,248,084.39	69,248,084.37	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	98.62%	73.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.46%	0.00%	10.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.91%	0.00%	12.00%	✓

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.