

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR 2016-05-31

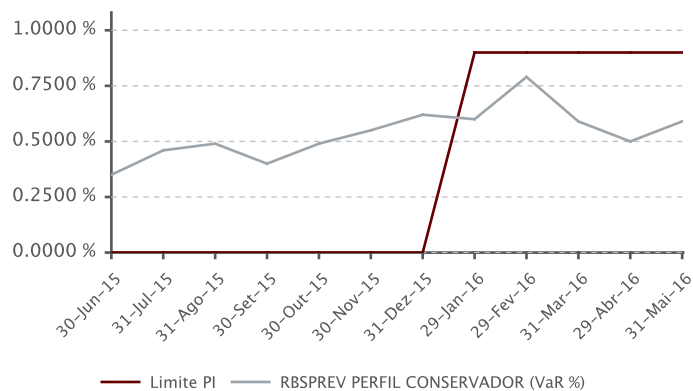
31/05/2016

RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PERFIL CONSERVADOR	147,133,729.84	147,216,955.57	0.59%	0.90%	✓	-	-	-	-	(1.48)%

* 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 2016-05-31

31/05/2016

RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	33,585,428.17	100.00	22.81	50.00	✓
2 - Faixa AA+	28,505,409.29	84.87	19.36	40.00	✓
3 - Faixa A+	3,295,670.66	9.81	2.24	20.00	✓
4 - Faixa BBB+	62,051.89	0.18	0.04	10.00	✓
5 - Faixa BB-	0.00	0.00	0.00	5.00	✓
Outros (*)	-	(368,094.32)	(1.10)	(0.25)	

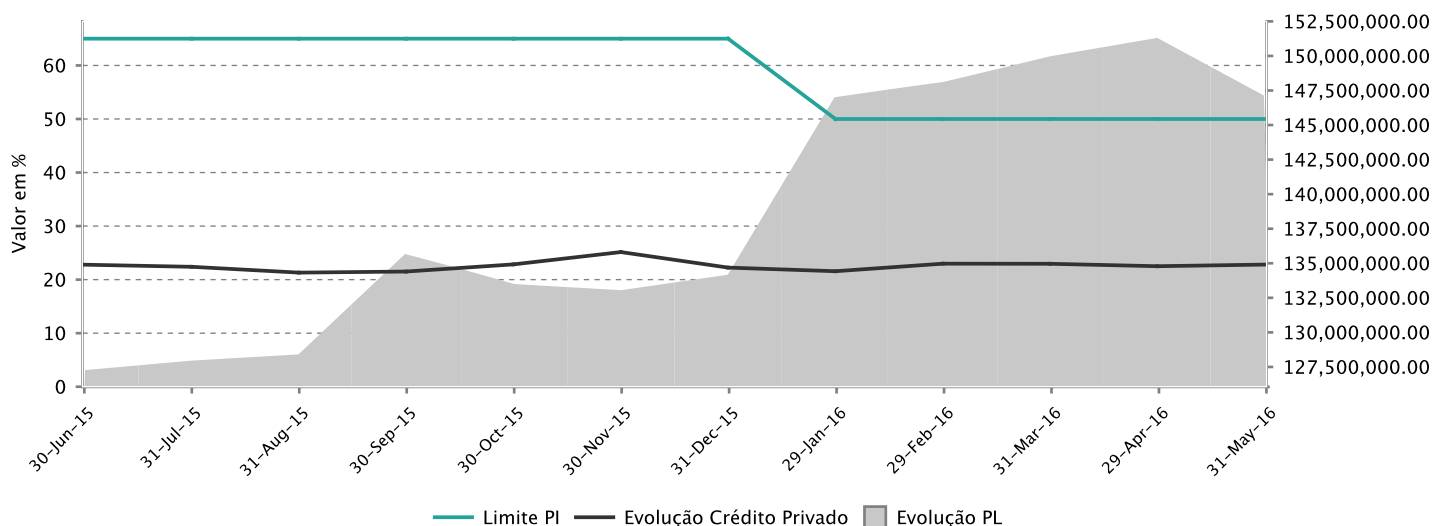
Total Crédito Privado 33,585,428.17

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	22.81	50.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	6,765,475.42	4.60%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	6,460,815.16	4.39%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	4,755,631.88	3.23%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	4,035,717.24	2.74%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	3,282,908.49	2.23%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	3,033,039.66	2.06%	20.00%	✓
BNDES PARTICIPACOES SA BNDESPAR	807,012.09	0.55%	10.00%	✓
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	589,256.53	0.40%	10.00%	✓
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS RCI BRASIL I	550,727.18	0.37%	10.00%	✓
BR MALLS PARTICIPACOES SA	508,555.08	0.35%	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 2016-05-31

31/05/2016

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	1.26%	0.16%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5	0.00%	0.00%
SUL AMERICA RENDA FIXA ATIVO FI	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%	0.20%
Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*	0.49%	
Total do percentual gasto com compra de opções*	0.06%	

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	75.22%	75.22%	10.00%	✓
21	4.26%	79.48%	20.00%	✓
252	2.66%	82.14%	50.00%	✓
Longo	17.86%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1,452,980.96	1,326,056,227.89	0.11%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	48,058,119.66	65,959,539.22	72.86%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	23,313,601.18	48,671,401.94	47.90%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	23,236,009.31	48,509,415.91	47.90%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	51,156,244.47	70,211,701.19	72.86%

ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.01%	96.00%	100.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.99%	0.00%	4.00%	✓

* Os valores percentuais de alocação por segmento são calculados com base na abertura dos fundos em nível de ativos (salvas exceções previstas na legislação vigente para fundos de investimento no exterior e fundos de investimento enquadrados no segmento de investimentos estruturados). Desta forma, não são consideradas as classificações dos fundos em si.

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.