

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL MODERADO 2016-05-31

31/05/2016

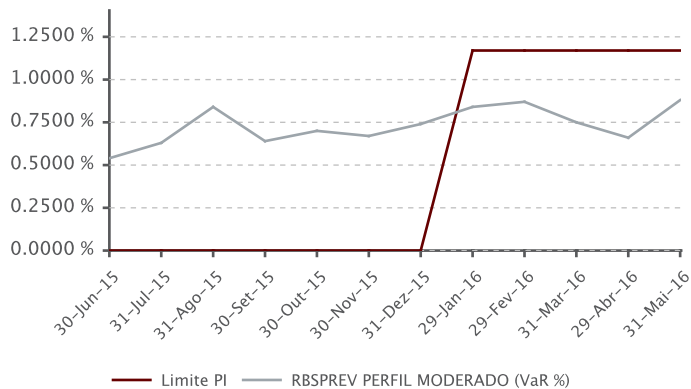
RISCO DE MERCADO

VAR

Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PERFIL MODERADO	96,946,432.46	97,049,959.88	0.88%	1.17%	✓	-	-	-	-	(2.05)%

* 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 PERFIL MODERADO 2016-05-31

31/05/2016

RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	14,601,288.72	100.00	15.05	50.00	✓
2 - Faixa AA+	12,646,959.53	86.62	13.03	40.00	✓
3 - Faixa A+	1,298,349.30	8.89	1.34	20.00	✓
4 - Faixa BBB+	69,753.18	0.48	0.07	10.00	✓
5 - Faixa BB-	672.32	0.00	0.00	5.00	✓
Outros (*)	-	(137,113.37)	(0.94)	(0.14)	

Total Crédito Privado 14,601,288.72

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	15.05	50.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
CAIXA	41.50	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	PACIFICO RV FIC FI ACOES
CAIXA	0.10	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	PACIFICO ACOES MASTER FI ACOES
CAIXA	0.63	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX OVER FI CURTO PRAZO
CAIXA	0.91	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	PACIFICO RV MASTER FI ACOES
CAIXA	4.49	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL FC FI ACOES
CAIXA	9.42	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI ACOES
CAIXA	489.61	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX ACOES FIC FI ACOES INSTITUCIONAL I
CAIXA	0.42	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	APEX MASTER FI DE ACOES INSTITUCIONAL
CAIXA	0.03	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI RF REF DI LP
CAIXA	0.15	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP II
CAIXA	0.13	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP III
CAIXA	0.14	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IV
CAIXA	0.15	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP IX
CAIXA	0.15	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP V
CAIXA	0.14	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP VI
CAIXA	0.15	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP
CAIXA	0.15	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI LP X
CAIXA	0.16	BNY MELLON BANCO S.A	-	-	BNY MELLON ARX LIQUID FI REF DI LP VIII
DEB_PDG	123.88	PDG REALTY SA EMPREENDIMENTOS	brSD	SP	BTG PACTUAL EQUITY HEDGE FI

1. Este documento é de propriedade exclusiva da Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;

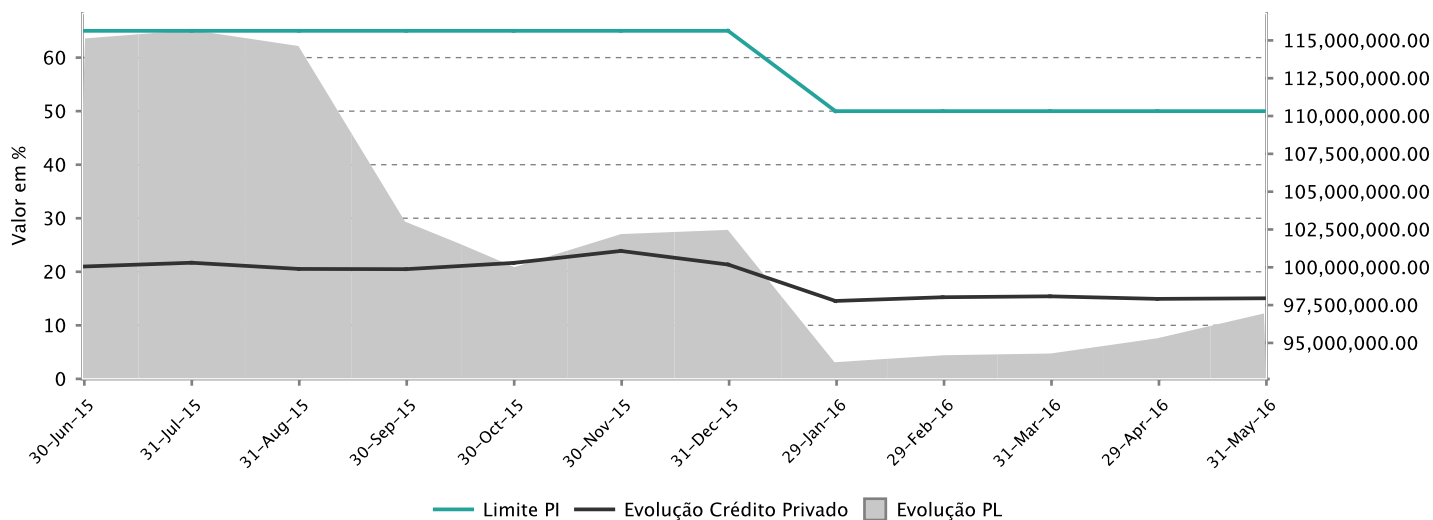
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;

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.



EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	3,833,624.12	3.95%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	2,506,229.55	2.58%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	2,392,656.72	2.47%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	1,541,138.61	1.59%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	1,340,726.61	1.38%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	1,189,914.25	1.23%	20.00%	✓
CIELO SA	864,370.19	0.89%	10.00%	✓
BNDES PARTICIPACOES SA BNDESPAR	514,775.55	0.53%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	329,001.35	0.34%	10.00%	✓
BM&FBOVESPA SA BOLSA DE VALORES MERCADORIAS E FUTUROS	230,358.92	0.24%	10.00%	✓

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL MODERADO 2016-05-31

31/05/2016

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%
ITAU INSTITUCIONAL RF	0.00%	0.00%
ITAU CAIXA ACOES FI	14.36%	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	1.26%	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%
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO 5	0.00%	0.00%
JGP INSTITUCIONAL FI EM ACOES	0.00%	0.79%
BTG PACTUAL EQUITY HEDGE FI	8.35%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL BOLSA INDEX	0.46%	0.00%
IBIUNA EQUITIES MASTER FI EM	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%
PACIFICO ACOES MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
ITAU RENDA FIXA VERTICE INFLATION	0.00%	0.00%
ITAU INST ACOES FOF MULTIGESTOR	0.00%	0.00%
APEX MASTER FI DE ACOES	0.00%	1.62%
APEX ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	0.65%
SUL AMERICA INDICES FI RENDA FIXA	0.00%	0.00%
ITAU CAIXA RENDA FIXA LONGO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI RF REF	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%

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 MODERADO 2016-05-31

31/05/2016

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
ITAU VERTICE IBOVESPA INDEX FICFI	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%
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%	0.00%
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%	0.14%
RBSPREV PERFIL MODERADO	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%	0.20%
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%

Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia* 0.56%

Total do percentual gasto com compra de opções* 0.04%

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	80.32%	80.32%	10.00%	✓
21	6.27%	86.59%	20.00%	✓
252	1.79%	88.38%	50.00%	✓
Longo	11.62%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI FI	1,536,460.54	1,361,868,574.80	0.11%
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	968,653.97	1,326,056,227.89	0.07%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	562,335.21	446,376,375.43	0.13%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	17,901,418.71	65,959,539.22	27.14%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	25,357,800.03	48,671,401.94	52.10%
BTG PACTUAL EQUITY HEDGE FI MULTIMERCADO	3,398,809.41	80,215,147.24	4.24%
GARDE D ARTAGNAN FIC FI MULT	3,000,871.22	1,498,610,522.50	0.20%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	25,273,404.69	48,509,415.91	52.10%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	19,055,455.32	70,211,701.19	27.14%

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	92.98%	70.00%	100.00%	✓
Renda Variável	2.34%	0.00%	10.00%	✓
Investimentos Estruturados	4.09%	0.00%	15.00%	✓
Investimentos no Exterior	0.59%	0.00%	5.00%	✓

* 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.