

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR 2016-05-31

31/05/2016

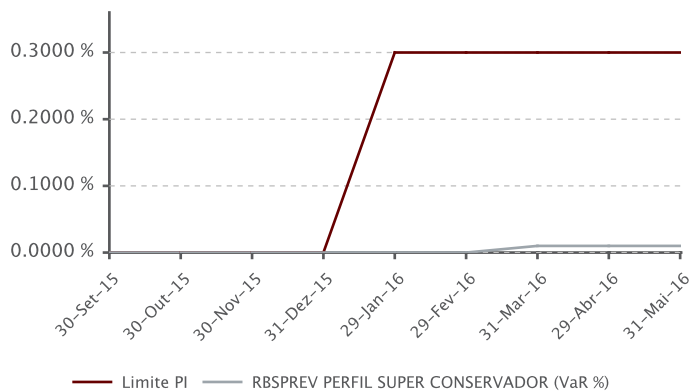
RISCO DE MERCADO

VAR

Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PERFIL SUPER CONSERVADOR	8,077,289.62	8,086,298.63	0.01%	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



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 2016-05-31

31/05/2016

RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	2,963,995.31	100.00	36.65	50.00	✓
2 - Faixa AA+	2,642,112.08	89.14	32.67	40.00	✓
3 - Faixa A+	168,515.63	5.69	2.08	20.00	✓
4 - Faixa BBB+	29,942.99	1.01	0.37	10.00	✓
5 - Faixa BB-	4,567.62	0.15	0.06	5.00	✓
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00	

Total Crédito Privado 2,963,995.31

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

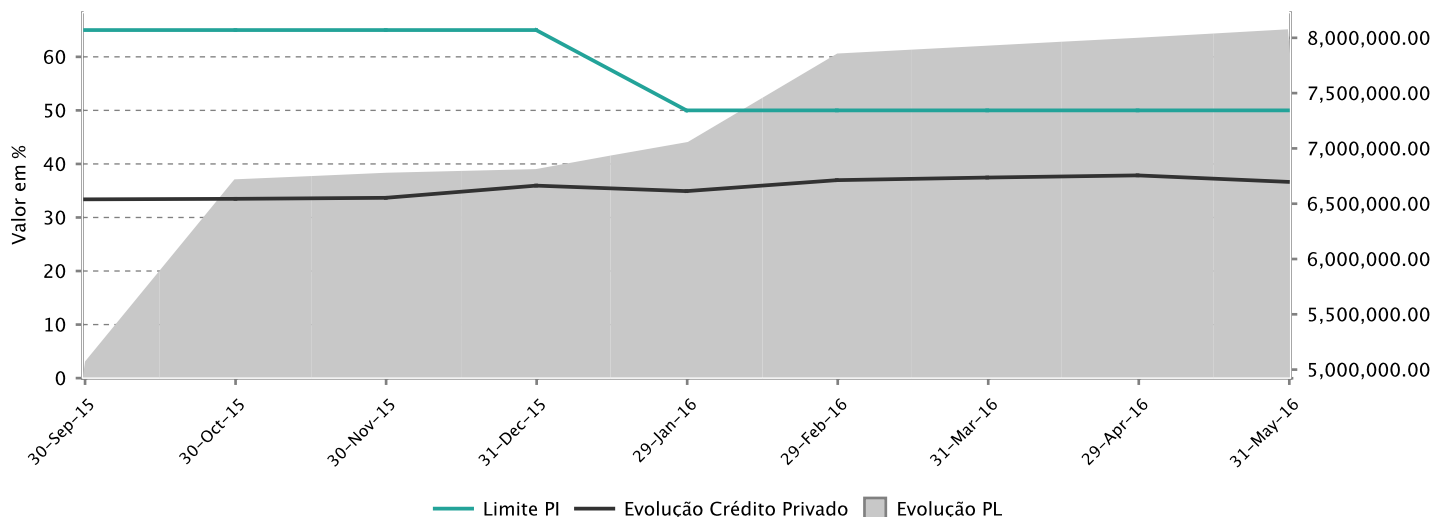
LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	36.65	50.00	✓
Grau Especulativo	0.06	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
LF CDI	1,141.36	CIA CREDITO FINANC INVEST RCI BRASIL	-	-	BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI	3,426.26	CIA CREDITO FINANC INVEST RCI BRASIL	-	-	BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



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 2016-05-31

31/05/2016

RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	1,499,509.33	18.54%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	338,150.54	4.18%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	265,630.46	3.28%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	241,777.81	2.99%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	191,610.42	2.37%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	172,981.26	2.14%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	42,445.46	0.52%	20.00%	✓
TERMOPERNAMBUCO SA	30,613.35	0.38%	10.00%	✓
AES TIETE ENERGIA SA	29,908.84	0.37%	10.00%	✓
BCO BTG PACTUAL SA	25,375.37	0.31%	20.00%	✓

DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
BRADESCO FI REFERENCIADO DI	0.13%	0.00%
RBSPREV PERFIL SUPER	0.00%	0.00%

Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia* 0.13%

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	67.00%	67.00%	10.00%	✓
21	0.27%	67.28%	20.00%	✓
252	18.07%	85.35%	50.00%	✓
Longo	14.65%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	8,086,298.63	6,538,328,087.85	0.12%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

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

* 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.