

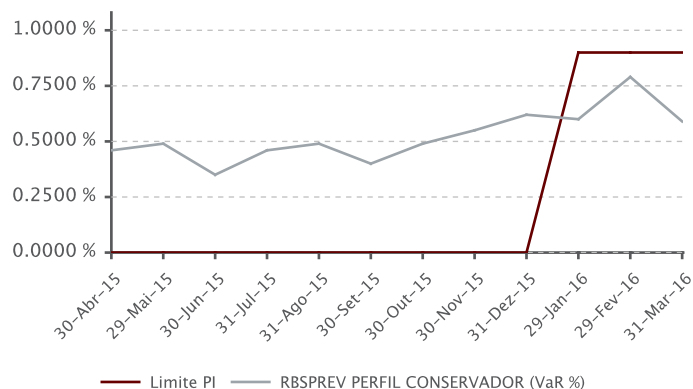


RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PERFIL CONSERVADOR	149,981,987.70	150,117,363.57	0.59%	0.90%	✓	-	-	-	-	(1.65)%

* 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 2016-03-31

31/03/2016

RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	34,466,080.31	100.00	22.96	50.00	✓
2 - Faixa AA+	32,515,746.02	94.34	21.66	40.00	✓
3 - Faixa A+	5,732,781.42	16.63	3.82	20.00	✓
4 - Faixa BBB+	959,223.78	2.78	0.64	10.00	✓
5 - Faixa BB-	0.00	0.00	0.00	5.00	✓
Outros (*)	-	(290,087.29)	(0.84)	(0.19)	

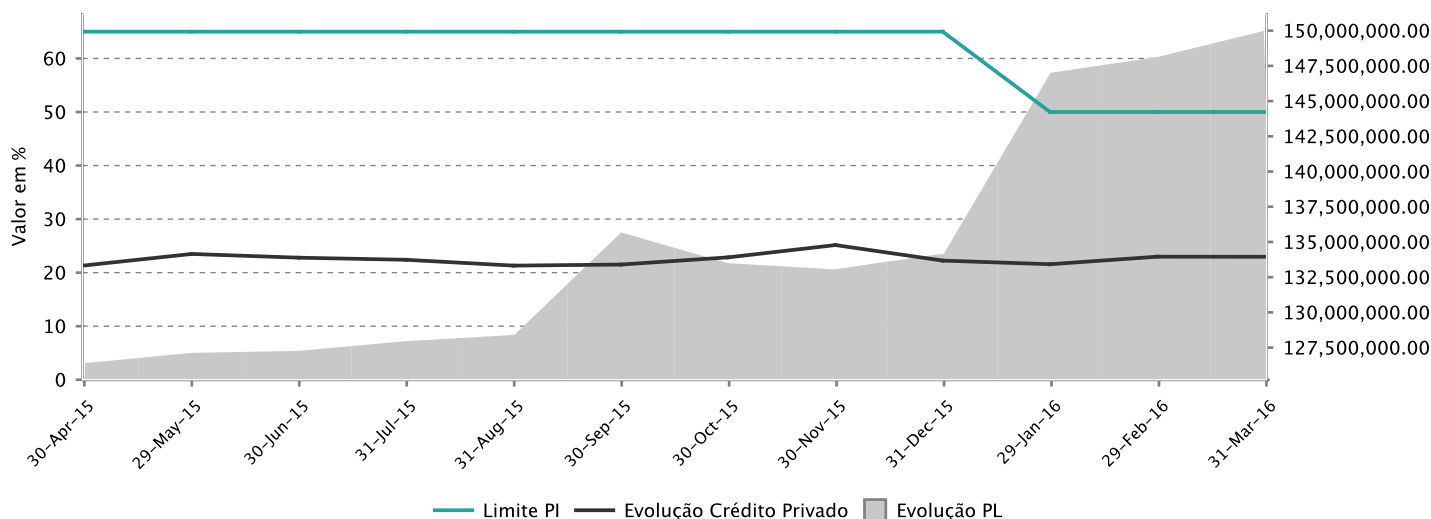
Total Crédito Privado 34,466,080.31

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	22.96	50.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	7,173,077.08	4.78%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	6,308,295.90	4.20%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	4,593,257.37	3.06%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	3,940,749.71	2.63%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	3,208,397.19	2.14%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	2,964,662.35	1.97%	20.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	959,223.78	0.64%	10.00%	✓
BNDES PARTICIPACOES SA BNDESPAR	791,022.77	0.53%	10.00%	✓
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	575,806.37	0.38%	10.00%	✓
FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS RCI BRASIL I	551,041.54	0.37%	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 2016-03-31

31/03/2016

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	1.21%	0.16%
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%	0.01%
RBSPREV PERFIL CONSERVADOR	0.00%	0.00%
ITAU RF JUROS OCEAN FI	0.00%	0.00%
ITAU VERSO J RF FI	0.00%	0.22%
Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*	0.48%	
Total do percentual gasto com compra de opções*	0.07%	

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	74.77%	74.77%	10.00%	✓
21	5.18%	79.95%	20.00%	✓
252	1.15%	81.10%	50.00%	✓
Longo	18.90%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	1,419,435.74	1,422,840,387.47	0.10%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	49,101,165.10	67,391,113.75	72.86%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	23,804,354.02	49,695,937.71	47.90%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	23,927,347.23	49,952,708.49	47.90%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	51,865,061.48	71,184,548.24	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%	✓

* 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.