

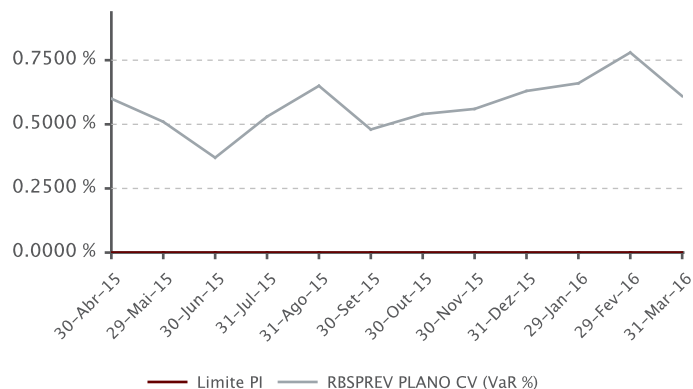


RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PLANO CV	258,075,871.93	258,265,976.23	0.61%	-	-	-	-	-	-	(1.68)%

* 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 PLANO CV 2016-03-31

31/03/2016

RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	51,962,672.53	99.95	20.12	50.00	✓
2 - Faixa AA+	49,038,762.22	94.33	18.99	40.00	✓
3 - Faixa A+	8,305,793.87	15.98	3.22	20.00	✓
4 - Faixa BBB+	1,607,626.09	3.09	0.62	10.00	✓
5 - Faixa BB-	8,193.33	0.02	0.00	5.00	✓
Outros (*)	-	(398,143.42)	(0.77)	(0.15)	

Total Crédito Privado 51,987,356.11

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

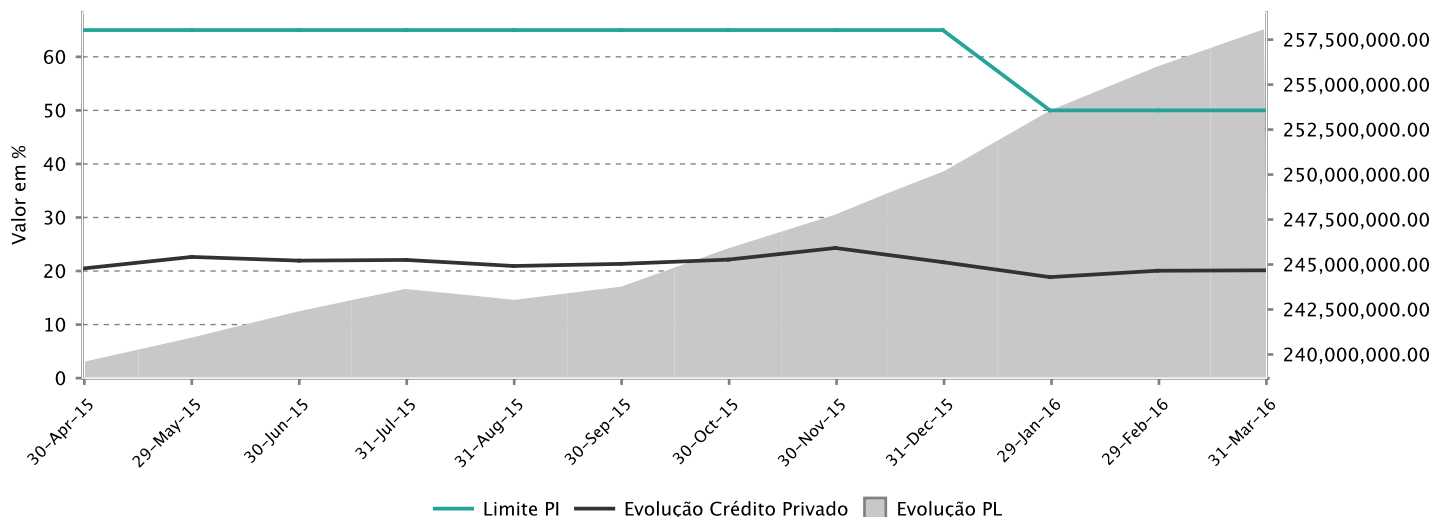
LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	20.13	50.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
LF CDI	4,728.20	CIA CREDITO FINANC INVEST RCI BRASIL	-	-	BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM
LF CDI	3,465.13	CIA CREDITO FINANC INVEST RCI BRASIL	-	-	BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO





RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	12,433,421.13	4.81%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	8,848,204.65	3.43%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	6,704,521.61	2.60%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	5,450,287.74	2.11%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	4,740,203.08	1.84%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	4,238,535.39	1.64%	20.00%	✓
FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS MULTISSETORIAL SILVERADO	1,574,614.80	0.61%	10.00%	✓
BNDES PARTICIPACOES SA BNDESPAR	1,295,599.09	0.50%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	807,912.41	0.31%	10.00%	✓
CHEMICAL IX FIDC INDUSTRIA PETROQUIMICA	790,291.47	0.31%	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 PLANO CV 2016-03-31

31/03/2016

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%
BRADESCO FI REFERENCIADO DI	0.11%	0.00%
ITAU CAIXA ACOES FI	13.14%	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	1.21%	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%	0.56%
ITAU INSTITUCIONAL BOLSA INDEX	0.49%	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%	1.20%
APEX ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	0.79%
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 2016-03-31

31/03/2016

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%	0.58%
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%	0.01%
OCEANA VALOR MASTER FIA	0.00%	0.10%
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%	0.22%
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*	0.38%	
Total do percentual gasto com compra de opções*	0.05%	

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	63.33%	63.33%	1.00%	✓
21	16.94%	80.27%	20.00%	✓
252	1.89%	82.15%	50.00%	✓
Longo	17.85%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	7,939,402.10	6,402,341,873.63	0.12%
ITAU HEDGE MULTIMERCADO FI	2,365,726.23	1,422,840,387.47	0.17%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	560,368.10	451,203,118.84	0.12%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	67,391,113.23	67,391,113.75	100.00%
TORRES FC DE FI MULTIMERCADO	49,695,937.42	49,695,937.71	100.00%
BRASIL PLURAL MACRO FIC FI MULTI	3,311,712.40	105,172,469.89	3.15%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	49,952,708.20	49,952,708.49	100.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	71,184,547.73	71,184,548.24	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	98.89%	73.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.19%	0.00%	10.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.92%	0.00%	12.00%	✓

* 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.