

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR 2016-03-31

31/03/2016

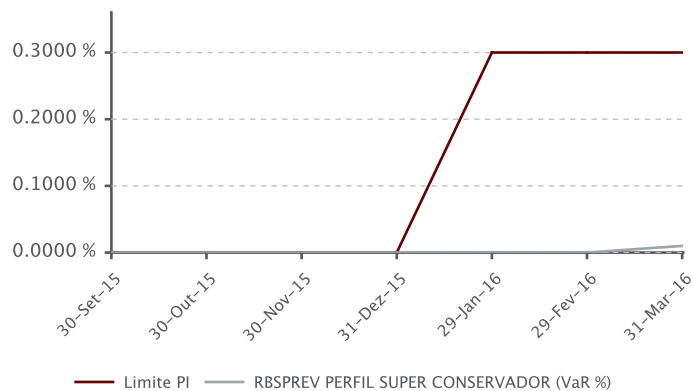
RISCO DE MERCADO

VAR

Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PERFIL SUPER CONSERVADOR	7,928,623.56	7,939,402.10	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



Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL SUPER CONSERVADOR 2016-03-31

31/03/2016

RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	2,974,061.43	100.00	37.46	50.00	✓
2 - Faixa AA+	2,726,975.56	91.69	34.35	40.00	✓
3 - Faixa A+	179,494.14	6.04	2.26	20.00	✓
4 - Faixa BBB+	33,011.30	1.11	0.42	10.00	✓
5 - Faixa BB-	8,193.33	0.28	0.10	5.00	✓
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00	

Total Crédito Privado 2,974,061.43

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

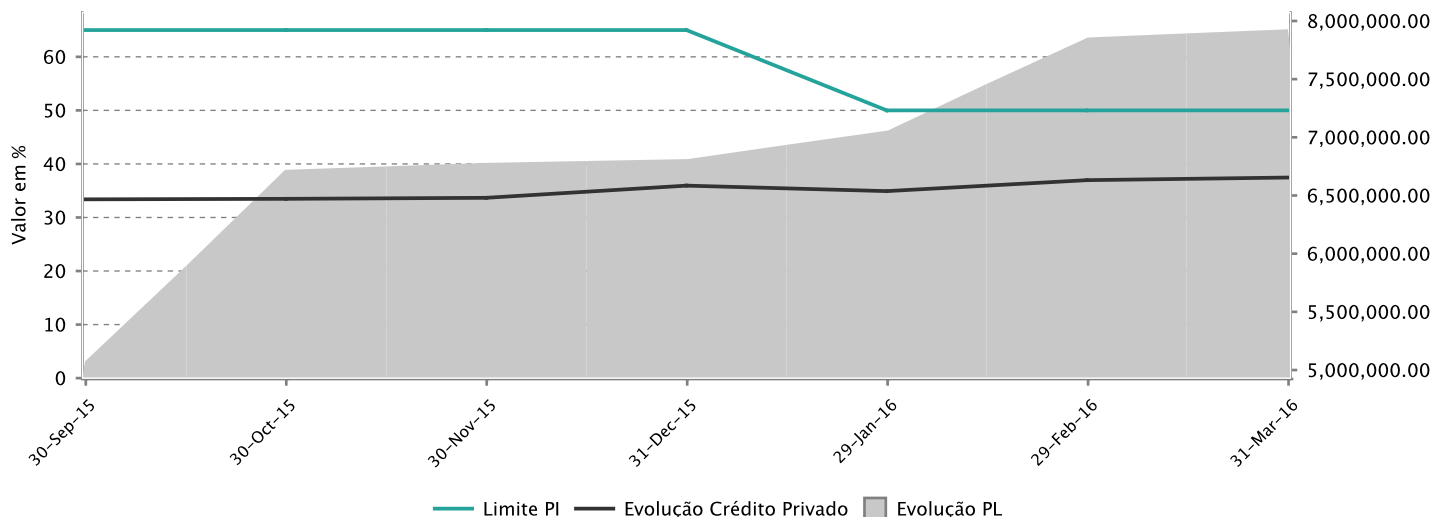
LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	37.46	50.00	✓
Grau Especulativo	0.10	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

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

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO





RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	1,451,720.73	18.29%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	341,257.27	4.30%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	336,424.38	4.24%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	237,141.02	2.99%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	187,847.32	2.37%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	169,550.56	2.14%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	41,627.69	0.52%	20.00%	✓
AES TIETE ENERGIA SA	31,410.76	0.40%	10.00%	✓
TERMOPERNAMBUCO SA	29,985.95	0.38%	10.00%	✓
BCO BTG PACTUAL SA	24,817.96	0.31%	20.00%	✓

DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
BRADESCO FI REFERENCIADO DI	0.11%	0.00%
RBSPREV PERFIL SUPER	0.00%	0.00%

Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia* 0.11%

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	66.32%	66.32%	10.00%	✓
21	0.92%	67.25%	20.00%	✓
252	16.91%	84.15%	50.00%	✓
Longo	15.85%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	7,939,402.10	6,402,341,873.63	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.