

Cliente: RBSPREV PLANO CV

Data-Base: 31-out-16

Segmentos de Aplicação	Alocação	
Renda Fixa	249.529.778,18	96,09%
Renda Variável	635.283,67	0,24%
Investimentos Estruturados	9.329.468,25	3,59%
Investimentos no Exterior	199.209,30	0,08%
Imóveis	0,00	0,00%
Operações com Participantes	0,00	0,00%
Total dos Recursos Garantidores	259.693.739,40	100,00%
Cotas de Fundos Multimercados Institucionais	0,00	0,00%
Disponível	12.799,88	0,00%
Passivo Operacional (Balancete)	-4.286,49	0,00%
Passivo Contingencial (Balancete)	0,00	0,00%

Subcategorias de Alocação	Posição Atual	Limite Legal	Limite Inferior	Limite Superior	Status
Renda Fixa	96,09%	100,00%	73,00%	100,00%	OK
Títulos da Dívida Pública Mobiliária Federal	77,52%	100,00%	0,00%	100,00%	OK
Conjunto dos ativos de renda fixa, excluídos os títulos públicos federais	18,55%	80,00%	0,00%	50,00%	OK
Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais	0,00%	80,00%	0,00%	50,00%	OK
CDBs, RDBs e Letras Financeiras	16,10%	80,00%	0,00%	50,00%	OK
DPGEs	0,00%	80,00%	0,00%	50,00%	OK
Debêntures	2,03%	80,00%	0,00%	50,00%	OK
LH, LCI e LCA	0,00%	80,00%	0,00%	50,00%	OK
Certificado de Operações Estruturadas - COE	0,00%	80,00%	0,00%	20,00%	OK
FIDCs e FICs de FIDCs	0,68%	20,00%	0,00%	20,00%	OK
Notas Promissórias, CCBs e CCCBs	0,00%	20,00%	0,00%	20,00%	OK
NCE e CCE	0,00%	20,00%	0,00%	20,00%	OK
Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRIs)	0,00%	20,00%	0,00%	20,00%	OK
Cédulas de Crédito Imobiliário (CCIs)	0,00%	20,00%	0,00%	20,00%	OK
Títulos do agronegócio (CPR, CRA, CDCA e WA)	0,00%	20,00%	0,00%	20,00%	OK
Demais títulos(exclui debêntures) de cias abertas(exclui securitizadoras)	0,00%	20,00%	0,00%	20,00%	OK
Cotas de Fundos de Renda Fixa	0,00%				
Operações a termo, opções de renda fixa e swaps	-0,26%				
Caixa, despesas, disponível, exigível contingencial, exigível operacional e provisões	0,02%				
Renda Variável	0,24%	70,00%	0,00%	10,00%	OK
Ações da categoria Novo Mercado	0,12%	70,00%	0,00%	10,00%	OK
Ações da categoria Nível 2	0,01%	60,00%	0,00%	10,00%	OK
Ações da categoria Bovespa Mais	0,00%	50,00%	0,00%	10,00%	OK
Ações da categoria Nível 1	0,09%	45,00%	0,00%	10,00%	OK
ETFs e ações não classificadas	0,03%	35,00%	0,00%	10,00%	OK
Títulos de emissão de SPEs	0,00%	20,00%	0,00%	10,00%	OK
Debêntures com part. nos lucros, Ouro, Crédito de Carbono e CPAC	0,00%	3,00%	0,00%	3,00%	OK
Cotas de fundos de Renda Variável	0,00%				
Opções	0,00%				
Investimentos Estruturados	3,59%	20,00%	0,00%	12,00%	OK
Fundos de Participação (Private Equity) e FMIEE	0,00%	20,00%	0,00%	12,00%	OK
Fundos de Investimentos Imobiliário (FII)	0,00%	10,00%	0,00%	10,00%	OK
Fundos Multimercados Estruturados	3,59%	10,00%	0,00%	10,00%	OK
Investimentos no Exterior	0,08%	10,00%	0,00%	5,00%	OK
Ativos emitidos no exterior em fundos sediados no Brasil	0,08%	10,00	0,00%	5,00%	OK
Fundos e FICs de Dívida Externa	0,00%	10,00	0,00%	5,00%	OK
Cotas de fundos de índice do exterior admitidas a negociação no Brasil	0,00%	10,00	0,00%	5,00%	OK
Brazilian Deposits Receipts (BDRs)	0,00%	10,00	0,00%	5,00%	OK
Ações de Cias sediadas no Mercosul	0,00%	10,00	0,00%	5,00%	OK

Limites de concentração	Limite Legal	Limite Plano	Status
Emissores			
Instituição financeira autorizada pelo Bacen	20,00%	20,00%	OK
Tesouro estadual ou municipal	10,00%	10,00%	OK
Cias abertas e securitizadoras	10,00%	10,00%	OK
Patrocinador do plano de benefícios	10,00%	10,00%	OK
Organismos multilaterais	10,00%	10,00%	OK
Cias limitadas	5,00%	5,00%	OK
Veículos			
Private Equity	10,00%	10,00%	OK
Fundo Imobiliário	10,00%	10,00%	OK
FIDC	10,00%	10,00%	OK
ETFs	10,00%	10,00%	OK
Fundos Multimercados Estruturados	10,00%	10,00%	OK
SPEs	10,00%	10,00%	OK
Fundo de Investimento classificado como Dívida Externa	10,00%	10,00%	OK

Limites de concentração por EFPC	Limite Legal	Limite Plano	Status
Veículos de Investimento			
Participação no capital total de uma mesma companhia aberta ou de uma mesma SPE	25,00%	25,00%	OK
Participação no capital votante de uma mesma companhia aberta	25,00%	25,00%	OK
Participação no patrimônio líquido de uma mesma instituição financeira autorizada a funcionar pelo Bacen	25,00%	25,00%	OK
Participação em fundo de índice referenciado em cesta de ações de companhias abertas	25,00%	25,00%	OK
Participação em fundo de investimento classificado no segmento de investimentos estruturados	25,00%	25,00%	OK
Participação em fundo de investimento no Brasil que tenha ativos classificados no seg. de inv. no exterior	25,00%	25,00%	OK
Participação em fundo de índice do exterior admitido à negociação em bolsa de valores do Brasil	25,00%	25,00%	OK
Participação em fundo de investimento classificado como dívida externa no seg. inv. no exterior	25,00%	25,00%	OK
Participação no patrimônio separado constituído nas emissões de cert. de recebíveis com regime fiduciário	25,00%	25,00%	OK
Aplicação em uma mesma série de títulos ou valores mobiliários	25,00%	25,00%	OK
Aplicação em uma mesma classe ou série de cotas de FIDCs	25,00%	25,00%	OK
Aplicações em um mesmo empreendimento imobiliário	25,00%	25,00%	OK

Derivativos	Limite	Status
Depósitos de margem para operações com derivativos	1,50%	15,00% OK
Prêmio pago em opções	0,00%	5,00% OK

Vedações	Status
Short de ações	OK
Derivativos a descoberto	OK
Derivativos sem garantia	OK
Aplicar em veículos que gerem possibilidade de perda superior ao PL	OK
Aplicar em títulos de cias sem registro na CVM	OK
Aplicar em ações não integrantes das categorias Novo Mercado, Nível 2 e Bovespa Mais ¹	OK
Operações day trade	OK
Aplicar em ativos ou modalidades não previstas na Resolução CMN nº3.792 e alterações posteriores	OK
Aplicar recursos no exterior por meio da carteira própria ou administrada	OK
Realizar operações com ações fora de bolsa de valores ou mercado de balcão	OK
Adquirir ou manter terrenos, exceto aqueles destinados a realização de empreendimentos imob. ou construção de imóveis para aluguel ou uso próprio	OK
Aplicar em ativos sem ISIN	OK



ADITUS

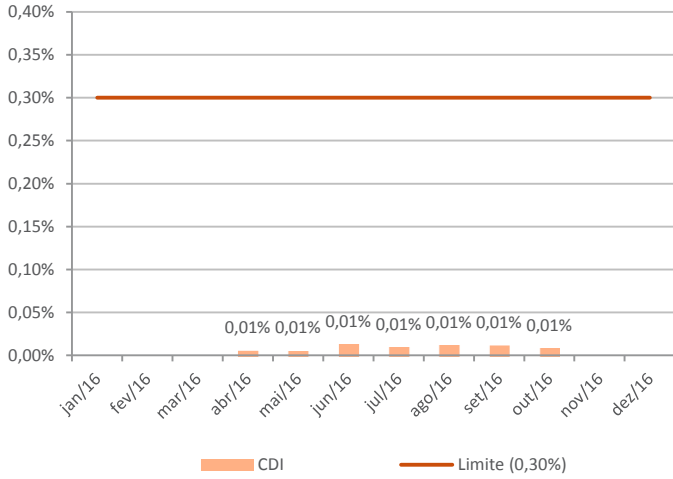
Relatório de Acompanhamento da Política de Investimentos

Cliente: RBSPREV PLANO CV

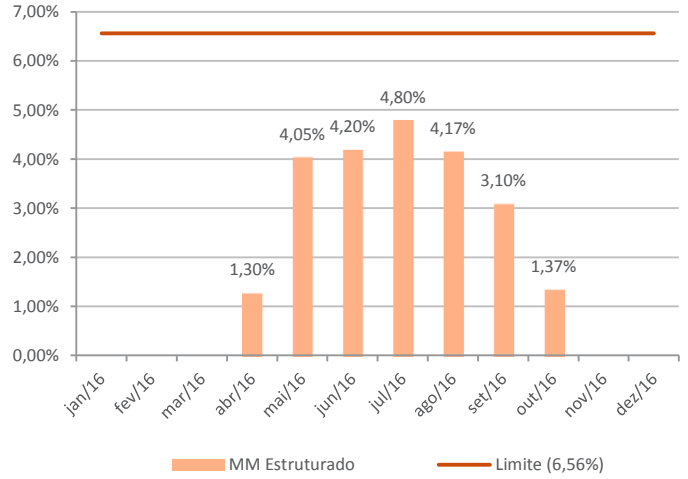
Data-Base: 31-out-16

Risco de Mercado

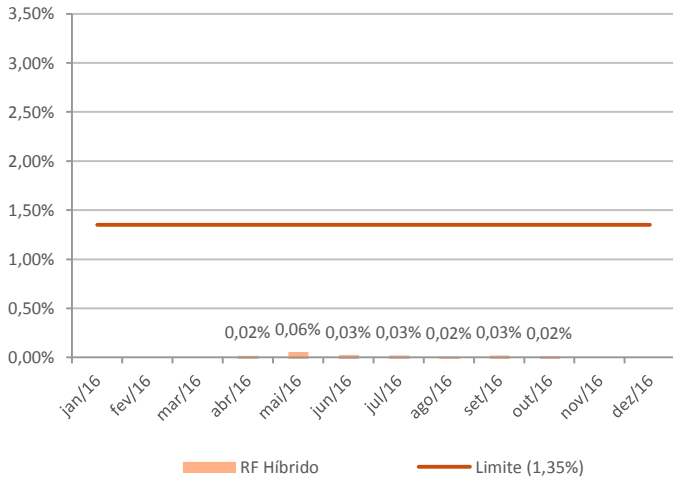
VaR - Mandato CDI



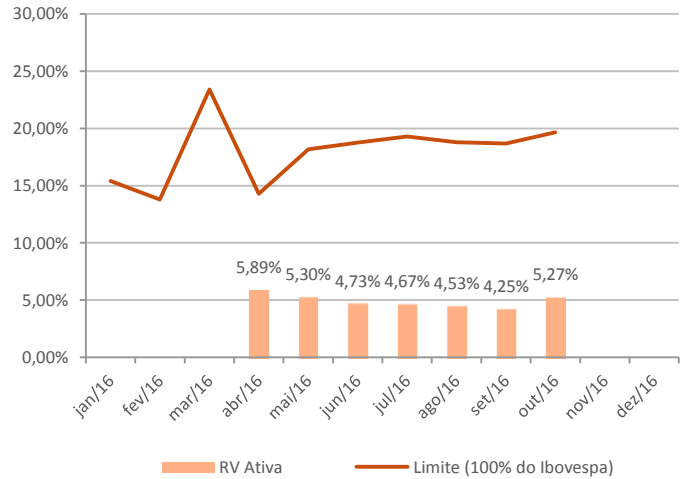
VaR - MM Estruturado



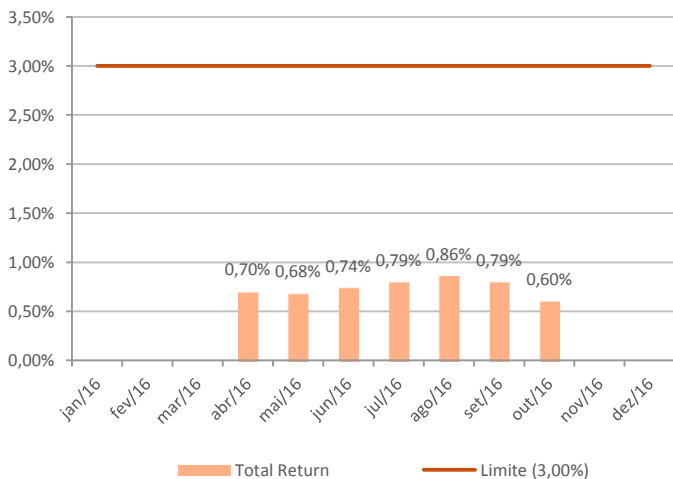
B- VaR - Mandato RF Híbrido



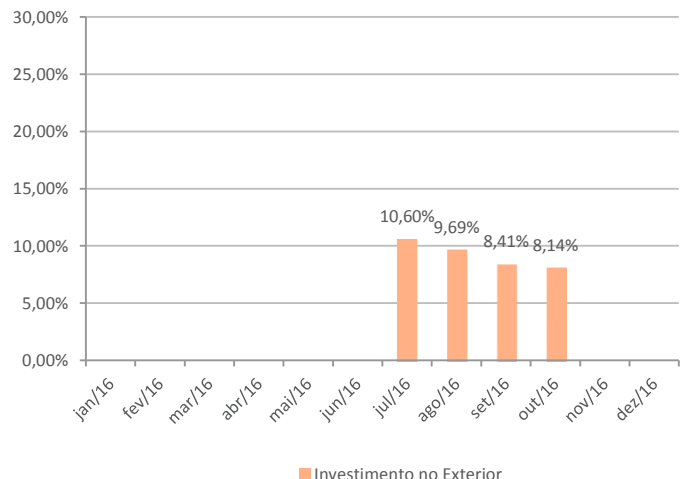
VaR - RV Ativa



VaR - Mandato Total Return



VaR - Mandato Investimento no Exterior



Cliente: RBSPREV PLANO CV

Data-Base: 31-out-16

Risco de Crédito	(%) Observado	Limite	Status
Até AAA	18,81%	50,00%	OK
Até AA+	17,86%	40,00%	OK
Até A+	2,44%	20,00%	OK
Até BBB+	0,04%	10,00%	OK
Até BB- ou sem rating	0,04%	5,00%	OK

Risco de Liquidez	(%) Observado	Limite Mínimo	Status
1 (um) dia útil	75,60%	1,00%	OK
21 (vinte e um) dias úteis	77,19%	20,00%	OK
1 (um) ano	84,82%	50,00%	OK