

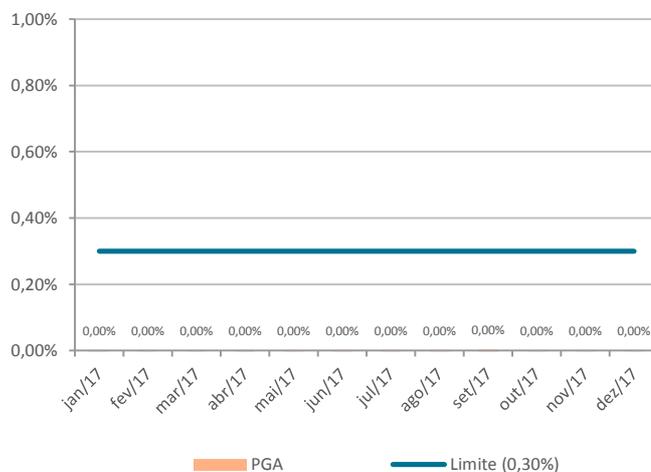
Segmentos de Aplicação	Alocação	Posição Atual	Limite Legal	Limite Inferior	Limite Superior	Status
Renda Fixa	718.482,16	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	OK
Renda Variável	-	0,00%	70,00%	0,00%	0,00%	OK
Investimentos Estruturados	-	0,00%	20,00%	0,00%	0,00%	OK
Investimentos no Exterior	-	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	OK
Imóveis	-	0,00%	8,00%	0,00%	0,00%	OK
Operações com Participantes	-	0,00%	15,00%	0,00%	0,00%	OK
Total dos Recursos Garantidores	718.482,16	100,00%				
Disponível	1.255,61					
Passivo Operacional	-					
Passivo Contingencial	-					

Subcategorias de Alocação	Posição Atual	Limite Legal	Limite Inferior	Limite Superior	Status
Renda Fixa					
Títulos da Dívida Pública Mobiliária Federal	10,47%	100,00%	0,00%	100,00%	OK
Fundo de índice de RF composto exclusivamente por títulos da dívida pública mobiliária federal	0,00%	100,00%	0,00%	100,00%	OK
Conjunto dos ativos de renda fixa, excluídos os títulos públicos federais e fundo de índice de RF	89,35%	80,00%	0,00%	80,00%	DESENG
Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais	0,00%	80,00%	0,00%	80,00%	OK
CDBs, RDBs e Letras Financeiras	87,71%	80,00%	0,00%	80,00%	DESENG
DPGEs	1,66%	80,00%	0,00%	80,00%	OK
Debêntures	0,00%	80,00%	0,00%	80,00%	OK
LH, LCI e LCA	0,00%	80,00%	0,00%	80,00%	OK
Certificado de Operações Estruturadas - COE	0,00%	80,00%	0,00%	80,00%	OK
FIDCs e FICs de FIDCs	0,00%	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
Caixa, provisões e despesas	-0,01%				
Cotas de Fundos de Renda Fixa	0,00%				
Operações a termo, opções de renda fixa e swaps	0,00%				
Disponível, passivo operacional e passivo contingencial	0,00%				
Renda Variável					
Ações da categoria Novo Mercado	0,00%	70,00%	0,00%	0,00%	OK
Ações da categoria Nível 2	0,00%	60,00%	0,00%	0,00%	OK
Ações da categoria Bovespa Mais	0,00%	50,00%	0,00%	0,00%	OK
Ações da categoria Nível 1	0,00%	45,00%	0,00%	0,00%	OK
ETFs e ações não classificadas	0,00%	35,00%	0,00%	0,00%	OK
Títulos de emissão de SPEs	0,00%	20,00%	0,00%	0,00%	OK
Debêntures com part. nos lucros, Ouro, Crédito de Carbono e CPAC	0,00%	3,00%	0,00%	0,00%	OK
Cotas de fundos de Renda Variável	0,00%				
Opções	0,00%				
Investimentos Estruturados					
Fundos de Participação (Private Equity) e FMIEE	0,00%	20,00%	0,00%	0,00%	OK
Fundos de Investimentos Imobiliário (FII)	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	OK
Fundos Multimercados Estruturados	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	OK
Investimentos no Exterior					
Ativos emitidos no exterior em fundos sediados no Brasil	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	OK
Fundos e FICs de Dívida Externa	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	OK
Cotas de fundos de índice do exterior admitidas a negociação no Brasil	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	OK
Brazilian Deposits Receipts (BDRs)	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	OK
Ações de Cias sediadas no Mercosul	0,00%	10,00%	0,00%	0,00%	OK

Limites de concentração	Maior Observado	Limite Legal	Limite Plano	Status
Emissores				
Instituição financeira autorizada pelo Bacen	10,84%	20,00%	20,00%	OK
Debêntures de Infraestrutura	0,00%	15,00%	15,00%	OK
Tesouro estadual ou municipal	0,00%	10,00%	10,00%	OK
Cias abertas e securitizadoras	1,18%	10,00%	10,00%	OK
Patrocinador do plano de benefícios	10,84%	10,00%	10,00%	OK
Organismos multilaterais	0,00%	10,00%	10,00%	OK
Cias limitadas	0,00%	5,00%	5,00%	OK
Veículos				
Fundo de índice de renda fixa composto exclusivamente por títulos da dívida mobiliária federal interna	0,00%	20,00%	20,00%	OK
Private Equity	0,00%	10,00%	0,00%	OK
Fundo Imobiliário	0,00%	10,00%	0,00%	OK
FIDC	0,00%	10,00%	10,00%	OK
ETFs	0,00%	10,00%	0,00%	OK
Fundos Multimercados Estruturados	3,80%	10,00%	0,00%	OK
SPEs	0,00%	10,00%	0,00%	OK
Fundo de Investimento classificado como Dívida Externa	0,00%	10,00%	0,00%	OK
Fundo de Índice de renda fixa	0,00%	10,00%	10,00%	OK
Derivativos		Limite	Status	
Depósitos de margem para operações com derivativos		0,00%	15,00%	OK
Prêmio pago em opções		0,00%	5,00%	OK
Vedações			Status	
Short de ações			OK	
Opções a descoberto			OK	
Swaps 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 ativos sem ISIN			OK	
Aplicar em ações não integrantes das categorias Novo Mercado, Nível 2 e Bovespa Mais ¹			OK	
Fundos em desacordo com limite de derivativos			OK	
Operações day trade			OK	
Aplicar em ativos ou modalidades não previstas na Resolução CMN nº3.792 e alterações posteriores			OK	
Aplicar em ações não integrantes das categorias Novo Mercado, Nível 2 e Bovespa Mais ¹			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	
Restrições Específicas		Limite	Status	
Na compra de cotas de fundos condominiais por um FI ou FIC exclusivo, estes deverão observar a vedação de participação de recursos da RBSPREV em parcela superior a 7% do patrimônio do referido veículo no momento da aplicação.		7,00%	OK	
Para os títulos que possuem grau de investimento fica estabelecido o limite máximo de 3% de alocação por emissor		3,00%	OK	

Risco de Mercado

VaR - Renda Fixa



Risco de Crédito

Rating	(%) Observado	Limite	Status
Até AAA	89,37%	50,00%	DESENQ
Até AA+	83,05%	40,00%	DESENQ
Até A+	0,03%	20,00%	OK
Até BBB+	0,03%	10,00%	OK
Até BB- ou sem rating	0,00%	5,00%	OK

Serão utilizadas como parâmetro de seleção de risco de crédito, as classificações de rating divulgadas pelas seguintes agências de classificação: S&P, Moody's, Fitch, Atlantic Rating, SR Rating e Austing Rating.



Esse relatório contempla os artigos da Resolução CMN n° 3.792 e suas alterações posteriores. Os dados utilizados para a confecção desse relatório foram obtidos junto à Instituição à qual se refere tal relatório. Os valores aqui apresentados decorrem da utilização desses dados, de dados obtidos junto a fontes públicas e da interpretação da legislação aplicável. A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

Anexo

Desenquadramento 1: Resolução CMN nº 3.792, Capítulo VII, Seção I, Art.35, inciso II: "Os investimentos classificados no segmento de renda fixa devem observar, em relação aos recursos de cada plano, os seguintes limites: II - até oitenta por cento no conjunto dos ativos classificados no segmento de renda fixa, excluídos os títulos da dívida pública mobiliária federal, observados adicionalmente os limites estabelecidos no inciso III". No período, o plano possuía 89,35% dos recursos em ativos de Renda Fixa, exceto títulos da dívida pública mobiliária federal. Cabe ressaltar, que em setembro ocorreu a migração de alocação dos recursos do plano para o fundo VOT FI PREMIUM BANKS RF CRED PRIV.

Desenquadramento 2: Em relação a Política de Investimentos vigente, no que se refere à Risco de Crédito, o limite máximo estabelecido é de 40% para a faixa 2, que contempla ativos até AA+. Em linha, para a Faixa 1, que contempla ativos com ratings até AAA, o limite máximo estabelecido é de 50%. O plano extrapolou ambas as faixas por possuir 89,37% dos recursos na Faixa 1; e, 83,05% dos recursos na Faixa 2.

! Esse relatório contempla os artigos da Resolução CMN nº 3.792 e suas alterações posteriores. Os dados utilizados para a confecção desse relatório foram obtidos junto à Instituição à qual se refere tal relatório. Os valores aqui apresentados decorrem da utilização desses dados, de dados obtidos junto a fontes públicas e da interpretação da legislação aplicável. A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.