

RBSPREV PGA
Data-Base: 29-dez-17

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

Subcategorias de Alocação	Alocação		Limite	Status
Renda Fixa				
Títulos da Dívida Pública Mobiliária Federal	75.245,28	10,47%	100,00%	OK
Fundo de índice de RF composto exclusivamente por títulos da dívida pública mobiliária federal	0,00	0,00%	100,00%	OK
Conjunto dos ativos de renda fixa, excluídos os títulos públicos federais e fundo de índice de RF	641.981,27	89,35%	80,00%	DESENQ
Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais	0,00	0,00%	80,00%	OK
CDBs, RDBs e Letras Financeiras	630.180,79	87,71%	80,00%	DESENQ
DPGEs	11.906,07	1,66%	80,00%	OK
Debêntures	0,00	0,00%	80,00%	OK
LH, LCI e LCA	0,00	0,00%	80,00%	OK
Certificado de Operações Estruturadas - COE	0,00	0,00%	80,00%	OK
FIDCs e FICs de FIDCs	0,00	0,00%	20,00%	OK
Notas Promissórias, CCBs e CCCBs	0,00	0,00%	20,00%	OK
NCE e CCE	0,00	0,00%	20,00%	OK
Certificados de Recebíveis Imobiliários (CRIs)	0,00	0,00%	20,00%	OK
Cédulas de Crédito Imobiliário (CCIs)	0,00	0,00%	20,00%	OK
Títulos do agronegócio (CPR, CRA, CDCA e WA)	0,00	0,00%	20,00%	OK
Demais títulos(exclui debêntures) de cias abertas(exclui securitizadoras)	0,00	0,00%	20,00%	OK
Caixa, provisões e despesas	-105,60	-0,01%		
Cotas de Fundos de Renda Fixa	0,00	0,00%		
Operações a termo, opções de renda fixa e swaps	0,00	0,00%		
Disponível, passivo operacional e passivo contingencial	1.255,61	0,17%		
Renda Variável				
Ações da categoria Novo Mercado	0,00	0,00%	70,00%	OK
Ações da categoria Nível 2	0,00	0,00%	60,00%	OK
Ações da categoria Bovespa Mais	0,00	0,00%	50,00%	OK
Ações da categoria Nível 1	0,00	0,00%	45,00%	OK
ETFs e ações não classificadas	0,00	0,00%	35,00%	OK
Títulos de emissão de SPEs	0,00	0,00%	20,00%	OK
Debêntures com part. nos lucros, Ouro, Crédito de Carbono e CPAC	0,00	0,00%	3,00%	OK
Cotas de fundos de Renda Variável	0,00	0,00%		
Opções	0,00	0,00%		
Investimentos Estruturados				
Fundos de Participação (Private Equity)	0,00	0,00%	20,00%	OK
Fundos Mútuos de Investimentos em Empresas Emergentes (FMIEE)	0,00	0,00%	20,00%	OK
Fundos de Investimentos Imobiliário (FII)	0,00	0,00%	10,00%	OK
Fundos Multimercados Estruturados	0,00	0,00%	10,00%	OK
Investimentos no Exterior				
Ativos emitidos no exterior em fundos sediados no Brasil	0,00	0,00%	10,00%	OK
Fundos e FICs de Dívida Externa	0,00	0,00%	10,00%	OK
Cotas de fundos de índice do exterior admitidas a negociação no Brasil	0,00	0,00%	10,00%	OK
Brazilian Deposits Receipts (BDRs)	0,00	0,00%	10,00%	OK
Ações de Cias sediadas no Mercosul	0,00	0,00%	10,00%	OK

RBSPREV PGA
Data-Base: 29-dez-17

Limites de concentração

	Limite	Status
Emissores		
Instituição financeira autorizada pelo Bacen	20,00%	OK
Debêntures de Infraestrutura	15,00%	OK
Tesouro estadual ou municipal	10,00%	OK
Cias abertas e securitizadoras	10,00%	OK
Patrocinador do plano de benefícios	10,00%	OK
Organismos multilaterais	10,00%	OK
Cias limitadas	5,00%	OK
Veículos		
Fundo de Índice de renda fixa composto exclusivamente por títulos da dívida mobiliária federal interna	20,00%	OK
Private Equity	10,00%	OK
Fundo Imobiliário	10,00%	OK
FIDCs e FICs de FIDCs	10,00%	OK
ETFs	10,00%	OK
Fundos Multimercados Estruturados	10,00%	OK
SPEs	10,00%	OK
Fundo de Investimento classificado como Dívida Externa	10,00%	OK
Fundo de Índice de renda fixa	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 ¹	OK
Aplicar em títulos de cias sem registro na CVM ²	OK
Aplicar em ativos sem ISIN	OK
Aplicar em ações não integrantes das categorias Novo Mercado, Nível 2 e Bovespa Mais ³	OK
Fundos em desacordo com limite de derivativos	OK
Operações day-trade ⁴	OK
Realizar operações com ações fora de bolsa de valores ou mercado de balcão ⁵	OK
Aplicar em fundos não institucionais (exceto estruturados)	OK

¹ Tal conferência deve ser realizada pelo administrador de cada um dos fundos, portanto, consideraremos enquadrados nesse quesito os fundos que possuem vedação a esse tipo de operação em seu regulamento;

² Exceto os títulos que tenham coobrigação de instituição financeira autorizada a funcionar pelo Bacen, que tenham cobertura de seguro ou com emissão de armazém certificado, no caso de warrant agropecuário (Art. 18, § 1º);

³ Salvo se estas tiverem realizado sua primeira distribuição pública em data anterior a 29 de maio de 2001;

⁴ Através dos arquivos que recebemos, não é possível identificar se houve, ou não, operações de day trade. Tal conferência deve ser realizada pelo administrador de cada um dos fundos, portanto, consideraremos enquadrados nesse quesito os fundos que possuem vedação a esse tipo de operação em seu regulamento;

⁵ Exceto nos casos de distribuição pública, exercício do direito de preferência, conversão de debêntures em ações, exercício do bônus de subscrição, casos previstos em regulamentação estabelecida pela SPC e demais casos expressamente previstos na Resolução CMN nº 3.792 e alterações posteriores.



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.

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.



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.