

RBSPREV PLANO CV

Data-Base: 31-jan-17

Segmentos de Aplicação	Alocação		Limite Legal	Limite Inferior	Limite Superior	Status
Renda Fixa	253.591.293,69	96,48%	100,00%	73,00%	100,00%	OK
Renda Variável	641.655,08	0,24%	70,00%	0,00%	10,00%	OK
Investimentos Estruturados	8.415.707,75	3,20%	20,00%	0,00%	12,00%	OK
Investimentos no Exterior	204.803,75	0,08%	10,00%	0,00%	5,00%	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	262.853.460,27	100,00%				
Disponível	11.438,62					
Passivo Operacional	-	334,94				
Passivo Contingencial	-					

Subcategorias de Alocação	Posição Atual	Limite Legal	Limite Inferior	Limite Superior	Status
Renda Fixa					
Títulos da Dívida Pública Mobiliária Federal	73,98%	100,00%	0,00%	100,00%	OK
Cotas de 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	22,49%	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	18,81%	80,00%	0,00%	50,00%	OK
DPGEs	0,00%	80,00%	0,00%	50,00%	OK
Debêntures	2,58%	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%	50,00%	OK
FIDCs e FICs de FIDCs	0,66%	20,00%	0,00%	20,00%	OK
Notas Promissórias, CCBs e CCCBs	0,01%	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	-0,04%				
Caixa, provisões e despesas	0,47%				
Disponível, passivo operacional e passivo contingencial	0,00%				
Renda Variável					
Ações da categoria Novo Mercado	0,11%	70,00%	0,00%	10,00%	OK
Ações da categoria Nível 2	0,02%	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	0,07%	45,00%	0,00%	10,00%	OK
ETFs e ações não classificadas	0,05%	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					
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%	7,00%	OK
Fundos Multimercados Estruturados	3,20%	10,00%	0,00%	10,00%	OK
Investimentos no Exterior					
Ativos emitidos no exterior em fundos sediados no Brasil	0,00%	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	0,08%	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

RBSPREV PLANO CV

Data-Base: 31-jan-17

Limites de concentração	Limite Legal	Limite Plano	Status
Emissores			
Instituição financeira autorizada pelo Bacen	20,00%	20,00%	OK
Fundo de índice de renda fixa composto exclusivamente por títulos da dívida mobiliária federal interna	20,00%	20,00%	OK
Debêntures de Infraestrutura	15,00%	15,00%	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	Limite Legal	Limite Plano	Status
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
Fundo de Índice de renda fixa	10,00%	10,00%	OK

Derivativos	Limite Legal	Limite Plano	Status
Depósitos de margem para operações com derivativos	2,71%	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 fundos não institucionais (exceto estruturados)	OK
Aplicar em veículos que gerem possibilidade de perda superior ao PL	OK
Aplicar em títulos de cias sem registro na CVM ¹	OK
Aplicar em ativos sem ISIN	OK
Aplicar em ações não integrantes das categorias Novo Mercado, Nível 2 e Bovespa Mais ²	OK
Fundos em desacordo com limite de derivativos	OK
Aplicar em ativos ou modalidades não previstas na Resolução CMN n° 3.792 e alterações posteriores	OK
Aplicar em veículos de investimento que alavancam mais de uma vez o patrimônio líquido ³	OK
Operações day trade ⁴	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 ⁵	OK
Adquirir ou manter terrenos, exceto aqueles destinados a realização de empreendimentos imobiliários ou construção de imóveis para aluguel ou uso próprio	OK

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

² Salvo se estas tiverem realizado sua primeira distribuição pública em data anterior a 29 de maio de 2001.

³ 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.

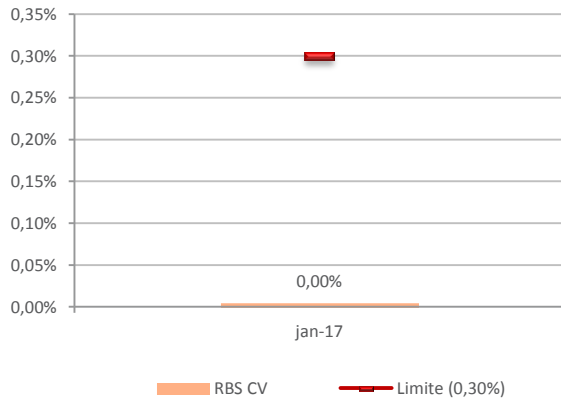
⁴ Através dos arquivos que recebemos, não foi possível identificar se houve, ou não, operações de day trade. Tal conferência deve ser realizada pelo administrador de cada um dos fundos, portanto, consideraremos enquadrados nesse quesito os fundos que possuem vedação a esse tipo de operação em seu regulamento.

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 n° 3.792 e alterações posteriores.

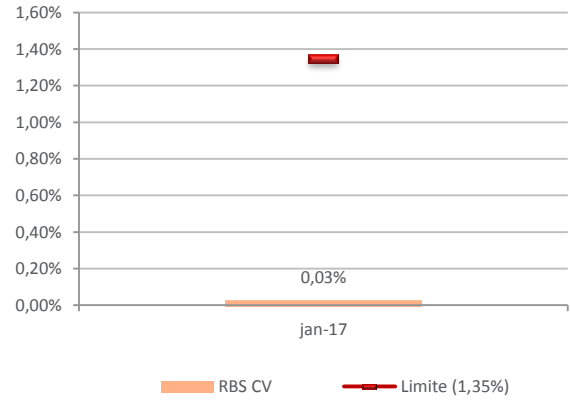
Restrições Específicas	Limite	Status
Na compra de cotas de fundos condominiais por um FI ou FIC exclusivo, estes deverão observar a vedação de participação de recursos da RBSPREV em parcela superior a 7% do patrimônio do referido veículo no momento da aplicação.	7,00%	OK
Para os títulos que possuírem grau de investimento fica estabelecido o limite máximo de 3% de alocação por emissor	3,00%	OK

Risco de Mercado

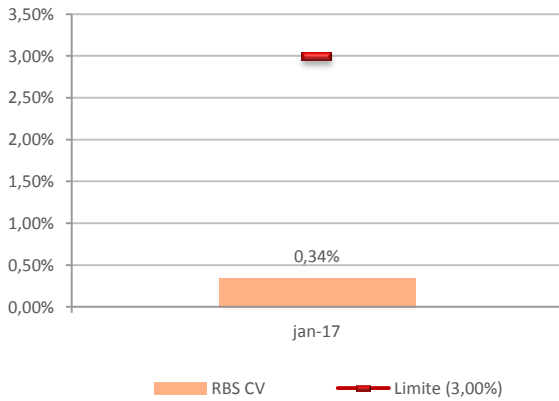
B-VaR - Renda Fixa CDI



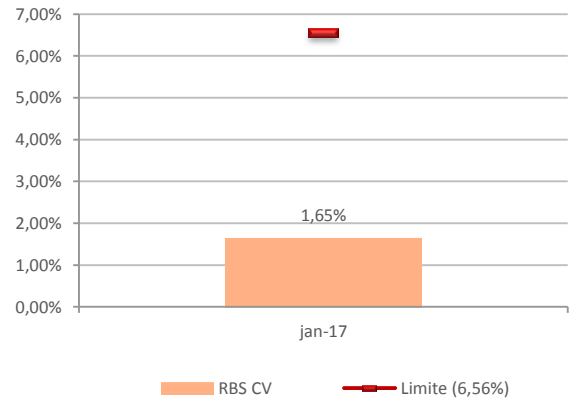
B-VaR - Renda Fixa Híbrido



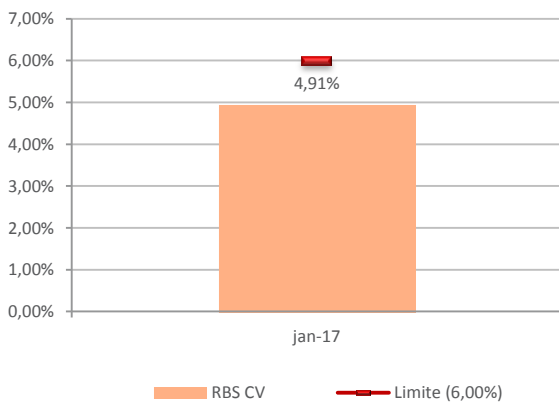
B-VaR - Total Return



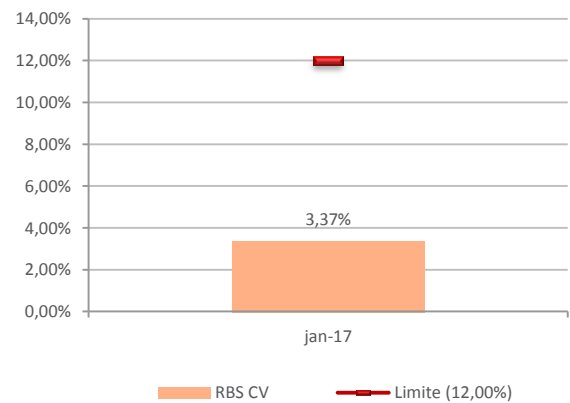
B-VaR - Multimercado Estruturado



B-VaR - Investimento no Exterior



B-VaR - Renda Variável Ativa



RBSPREV PLANO CV

Data-Base: 31-jan-17

Risco de Crédito	(%) Observado	Limite	Status
Até AAA	1,99%	50,00%	OK
Até AA+	19,55%	40,00%	OK
Até A+	0,80%	20,00%	OK
Até BBB+	0,00%	10,00%	OK
Até BB- ou sem rating	0,15%	5,00%	OK

! 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.