

RBSPREV PLANO CV

Data-Base: 31-mar-17

Segmentos de Aplicação	Alocação		Limite	Status
Renda Fixa	257.473.363,83	96,06%	100,00%	OK
Renda Variável	1.832.595,69	0,68%	70,00%	OK
Investimentos Estruturados	8.739.284,25	3,26%	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	268.045.243,77	100,00%		
Disponível	12.001,54			
Passivo Operacional	0,00			
Passivo Contingencial	0,00			

Subcategorias de Alocação	Alocação		Limite	Status
Renda Fixa				
Títulos da Dívida Pública Mobiliária Federal	200.267.189,33	74,71%	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	57.194.172,96	21,34%	80,00%	OK
Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais	0,00	0,00%	80,00%	OK
CDBs, RDBs e Letras Financeiras	50.095.093,24	18,69%	80,00%	OK
DPGEs	17.164,07	0,01%	80,00%	OK
Debêntures	5.626.488,62	2,10%	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	1.670.281,95	0,62%	20,00%	OK
Notas Promissórias, CCBs e CCCBs	26.766,55	0,01%	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	102.303,11	0,04%		
Cotas de Fundos de Renda Fixa	382,94	0,00%		
Operações a termo, opções de renda fixa e swaps	-344.307,53	-0,13%		
Disponível, passivo operacional e passivo contingencial	12.001,54	0,00%		
Renda Variável				
Ações da categoria Novo Mercado	904.614,37	0,34%	70,00%	OK
Ações da categoria Nível 2	52.433,24	0,02%	60,00%	OK
Ações da categoria Bovespa Mais	0,00	0,00%	50,00%	OK
Ações da categoria Nível 1	486.496,26	0,18%	45,00%	OK
ETFs e ações não classificadas	388.109,45	0,14%	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	942,36	0,00%		
Investimentos Estruturados				
Fundos de Participação (Private Equity) e FMIEE	0,00	0,00%	20,00%	OK
Fundos de Investimentos Imobiliário (FII)	0,00	0,00%	10,00%	OK
Fundos Multimercados Estruturados	8.739.284,25	3,26%	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 PLANO CV
Data-Base: 31-mar-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	2,17%	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

! 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.