

RBSPREV PGA

Data-Base: 31-mar-17

Segmentos de Aplicação	Alocação		Limite	Status
Renda Fixa	785.782,57	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
<b>Total dos Recursos Garantidores</b>	<b>785.782,57</b>	<b>100,00%</b>		
Disponível	0,00			
Passivo Operacional	0,00			
Passivo Contingencial	0,00			

Subcategorias de Alocação	Alocação		Limite	Status
<b>Renda Fixa</b>				
Títulos da Dívida Pública Mobiliária Federal	552.440,19	70,30%	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	233.342,39	29,70%	80,00%	OK
Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais				
CDBs, RDBs e Letras Financeiras	232.235,84	29,55%	80,00%	OK
DPGEs	0,00	0,00%	80,00%	OK
Debêntures	1.132,52	0,14%	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	-25,97	0,00%		
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	0,00	0,00%		
<b>Renda Variável</b>				
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%		
<b>Investimentos Estruturados</b>				
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	0,00	0,00%	10,00%	OK
<b>Investimentos no Exterior</b>				
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:** 31-mar-17

Limites de concentração		Limite	Status
<b>Emissores</b>			
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
<b>Veículos</b>			
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
<b>Derivativos</b>		<b>Limite</b>	<b>Status</b>
Depósitos de margem para operações com derivativos	0,00%	15,00%	OK
Prêmio pago em opções	0,00%	5,00%	OK
<b>Vedações</b>			<b>Status</b>
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 <sup>1</sup>			OK
Fundos em desacordo com limite de derivativos			OK

! 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.