

RBSPREV PLANO CV

Data-Base: 30-abr-18

Segmentos de Aplicação	Alocação		Limite	Status
Renda Fixa	233.584.148,14	87,38%	100,00%	OK
Renda Variável	10.150.237,25	3,80%	70,00%	OK
Investimentos Estruturados	23.597.904,55	8,83%	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	267.332.289,94	100,00%		
Disponível (balancete)	3.048,31			
Passivo Operacional (balancete)	-145.258,90			
Passivo Contingencial (balancete)	0,00			

Subcategorias de Alocação	Alocação		Limite	Status
Renda Fixa				
Títulos da Dívida Pública Mobiliária Federal	171.159.221,08	64,02%	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	62.567.137,65	23,40%	80,00%	OK
Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais	0,00	0,00%	80,00%	OK
CDBs, RDBs e Letras Financeiras	46.237.948,39	17,30%	80,00%	OK
DPGEs	54.745,37	0,02%	80,00%	OK
Debêntures	14.781.866,11	5,53%	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	1.326.654,20	0,50%	20,00%	OK
Notas Promissórias, CCBs e CCCBs	113.973,18	0,04%	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	-186.045,31	-0,07%		
Cotas de Fundos de Renda Fixa	0,00	0,00%		
Operações a termo, opções de renda fixa e swaps	237.995,71	0,09%		
Disponível, passivo operacional e passivo contingencial (balancete)	-142.210,59	-0,05%		
Renda Variável				
Ações da categoria Novo Mercado	5.989.724,97	2,24%	70,00%	OK
Ações da categoria Nível 2	391.171,51	0,15%	60,00%	OK
Ações da categoria Bovespa Mais	0,00	0,00%	50,00%	OK
Ações da categoria Nível 1	2.735.701,96	1,02%	45,00%	OK
ETFs e ações não classificadas	1.023.741,85	0,38%	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	9.896,96	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	23.597.904,55	8,83%	10,00%	OK
Investimentos no Exterior				
Cotas de fundos com sufixo "Investimento no Exterior" (Inciso I do Art. 21 da Resolução 4.626)	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
Cotas de fundos com sufixo "Investimento no Exterior" (Inciso VI do Art. 21 da Resolução 4.626)	0,00	0,00%	10,00%	OK

Limites de concentração		Limite	Status
Emissores			
Tesouro Nacional		100,00%	OK
Instituição financeira autorizada pelo Bacen		20,00%	OK
Debêntures de Infraestrutura		15,00%	OK
Tesouro estadual ou municipal		10,00%	OK
Cias abertas		10,00%	OK
Securizadoras		10,00%	OK
Patrocinador do plano de benefícios		10,00%	OK
Organismos multilaterais		10,00%	OK
Demais Emissores		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	3,70%	15,00%	OK
Prêmio pago em opções	0,32%	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 ativos ou modalidades não previstas na Resolução nº 3.792 e alterações posteriores		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.