

RBSPREV PLANO CV

Data-Base: 28-fev-18

| Segmentos de Aplicação | Alocação | | Limite | Status |
|--|-----------------------|----------------|---------|--------|
| Renda Fixa | 245.815.123,34 | 89,00% | 100,00% | OK |
| Renda Variável | 9.723.491,22 | 3,52% | 70,00% | OK |
| Investimentos Estruturados | 20.655.340,30 | 7,48% | 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 | 276.193.954,85 | 100,00% | | |
| Disponível (balancete) | 361,11 | | | |
| Passivo Operacional (balancete) | -217.215,39 | | | |
| Passivo Contingencial (balancete) | 0,00 | | | |

| Subcategorias de Alocação | Alocação | | Limite | Status |
|---|----------------|--------|---------|--------|
| Renda Fixa | | | | |
| Títulos da Dívida Pública Mobiliária Federal | 183.923.440,25 | 66,59% | 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 | 62.108.537,36 | 22,49% | 80,00% | OK |
| Títulos das dívidas públicas mobiliárias estaduais e municipais | 0,00 | 0,00% | 80,00% | OK |
| CDBs, RDBs e Letras Financeiras | 47.348.167,19 | 17,14% | 80,00% | OK |
| DPGEs | 38.118,56 | 0,01% | 80,00% | OK |
| Debêntures | 13.021.133,52 | 4,71% | 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 | 1.261.136,27 | 0,46% | 20,00% | OK |
| Notas Promissórias, CCBs e CCCBs | 21.541,11 | 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 | 341.827,48 | 0,12% | | |
| Cotas de Fundos de Renda Fixa | 0,00 | 0,00% | | |
| Operações a termo, opções de renda fixa e swaps | 76.613,23 | 0,03% | | |
| Disponível, passivo operacional e passivo contingencial (balancete) | -216.854,28 | -0,08% | | |
| Renda Variável | | | | |
| Ações da categoria Novo Mercado | 6.045.599,43 | 2,19% | 70,00% | OK |
| Ações da categoria Nível 2 | 423.402,73 | 0,15% | 60,00% | OK |
| Ações da categoria Bovespa Mais | 0,00 | 0,00% | 50,00% | OK |
| Ações da categoria Nível 1 | 2.458.844,60 | 0,89% | 45,00% | OK |
| ETFs e ações não classificadas | 795.644,46 | 0,29% | 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 | 20.655.340,30 | 7,48% | 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 | 4,99% | 15,00% | OK |
| Prêmio pago em opções | 0,22% | 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.