

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos

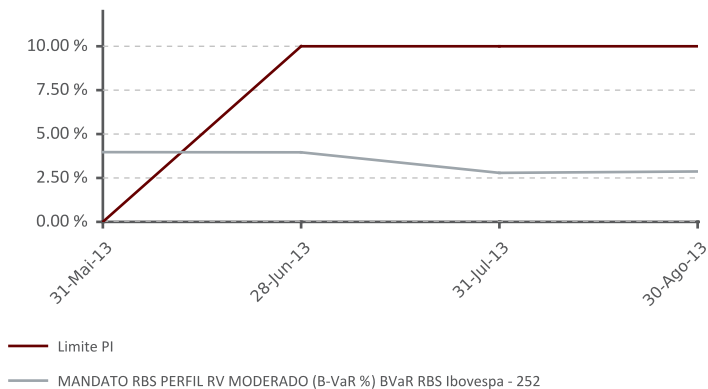
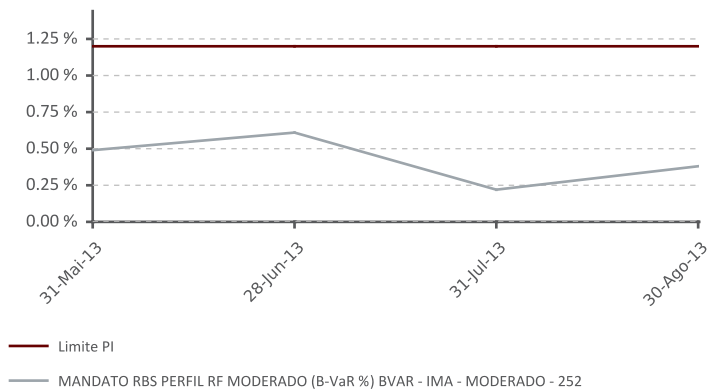
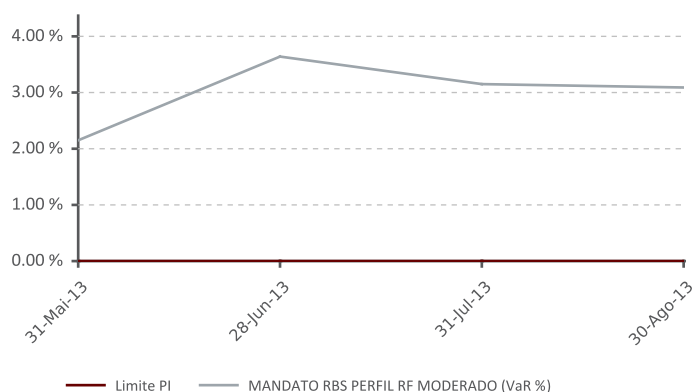
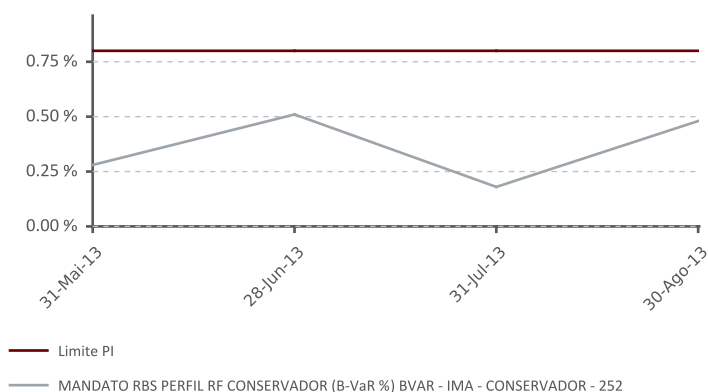
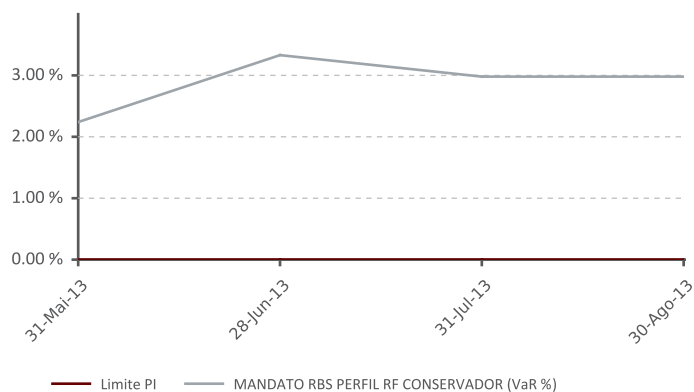
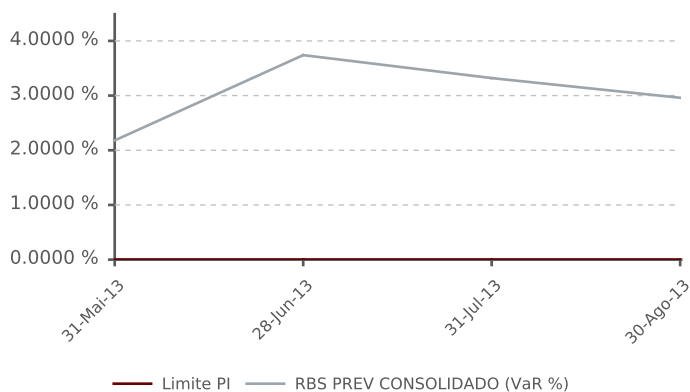
RBS PREV CONSOLIDADO 2013-08-30

30/08/2013

## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	Var	Limite PI	Status	Stress	Stress %
CONSOLIDADO	-	209,960,272.31	209,985,945.23	2.96%	-	-	(12,228,916.76)	(5.82)%
MANDATO PERFIL RF CONSERVADOR	-	96,237,905.60	96,274,369.03	2.98%	-	-	(5,007,699.56)	(5.20)%
MANDATO PERFIL RF CONSERVADOR	IMA	96,237,905.60	96,274,369.03	0.48%	0.80%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RF MODERADO	-	103,193,932.23	103,171,235.49	3.09%	-	-	(5,634,469.59)	(5.46)%
MANDATO PERFIL RF MODERADO	IMA	103,193,932.23	103,171,235.49	0.38%	1.20%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RV MODERADO	IBOVESPA	9,107,316.87	9,107,609.23	2.87%	10.00%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RV MODERADO	-	10,540,048.21	10,540,340.71	8.27%	-	-	(1,586,747.61)	(15.05)%
MANDATO PERFIL MODERADO	-	113,733,980.45	113,711,576.20	2.99%	-	-	(7,221,217.19)	(6.35)%

## EVOLUÇÃO GRÁFICA

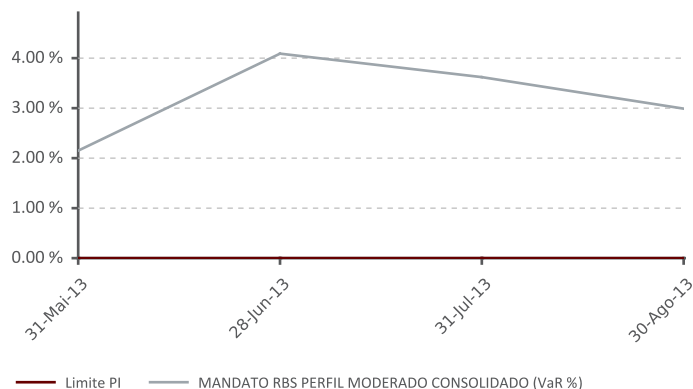
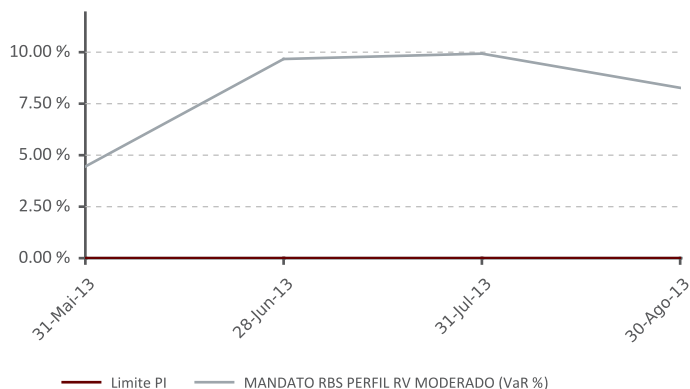


1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;
3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;
4. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBS PREV CONSOLIDADO 2013-08-30

30/08/2013



## RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	31,669,076.42	63.58	15.08
Faixa 2	AA	10,711,692.73	21.51	5.10
Faixa 3	A	3,188,562.46	6.40	1.52
Faixa 4	BBB	0.00	0.00	0.00
Faixa 5	< BBB-	4,237,224.65	8.51	2.02
Sem Nota	-	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
<b>Total</b>		<b>49,806,556.26</b>		

\*Os valores apresentados em crédito privado não contemplam o financeiro dos swaps.

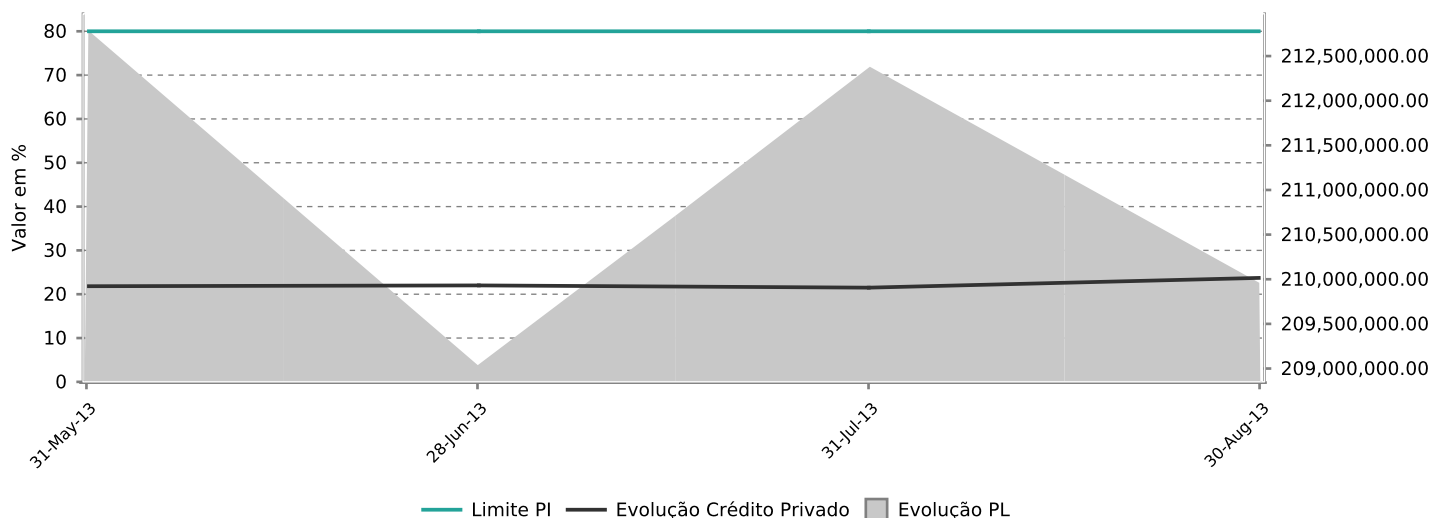
### LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite PI	Status
Total Crédito Privado	23.72	80.00	✓
Grau Especulativo	2.02	20.00	✓

### ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência
DPGE_cdi	4,237,224.65	BCO BMG SA	brBB+	SP

## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;
3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;
4. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBS PREV CONSOLIDADO 2013-08-30

30/08/2013

## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Contraparte	MtM Inf.	% Total	Limite Legal	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	12,430,318.42	5.92%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	11,531,578.53	5.49%	20.00%	✓
BCO BMG SA	4,237,224.65	2.02%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	4,082,724.18	1.94%	20.00%	✓
BCO SAFRA SA	3,394,478.53	1.62%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	2,574,691.07	1.23%	20.00%	✓
OI SA	1,938,115.41	0.92%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	1,627,105.52	0.77%	10.00%	✓
BR MALLS PARTICIPACOES SA	1,504,776.03	0.72%	10.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	1,201,699.60	0.57%	20.00%	✓

## DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
BNY MELLON ARX CASH FI CURTO	0.00%	0.00%
ARX FUNDO DE INVESTIMENTO EM	0.00%	0.00%
ITAU CAIXA ACOES FI	4.74%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO	0.00%	0.00%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.22%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	0.50%	0.00%
TORRES FI MULTIMERCADO	0.00%	0.06%
BNY MELLON ARX CASH V FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX CASH IV FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX CASH II FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX CASH III FI CURTO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX FI REFERENCIADO	0.00%	0.00%
OCEANA VALOR FI DE ACOES	0.00%	0.00%
STUDIO MASTER FI EM ACOES	0.00%	0.72%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	4.37%	0.00%
JGP INSTITUCIONAL FIA	0.00%	0.00%
SQUADRA INSTITUCIONAL FI DE	0.00%	0.00%
PACIFICO ACOES MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
PACIFICO ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
KONDOR INSTITUCIONAL FI ACOES	5.10%	0.00%
BRASIL CAPITAL LONG ONLY FIC FI	0.00%	0.00%

1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;

2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;

3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;

4. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBS PREV CONSOLIDADO 2013-08-30

30/08/2013

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
BRASIL CAPITAL LONG ONLY MASTER	0.00%	0.00%
ITAU INST ACOES FOF MULTIGESTOR	0.00%	0.00%
APEX ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
APEX MASTER FI DE ACOES	0.00%	0.00%
APEX ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
BEHAVIOR IBOVESPA PLUS FI DE	0.00%	0.00%
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	1.13%
BLACKROCK INST IBOVESPA YIELD FI	0.00%	0.00%
EXPLORA OPORTUNIDADES II FI DE	0.00%	2.19%
ATMOS INSTITUCIONAL FI DE ACOES	0.00%	0.00%
DUNA INSTITUCIONAL MASTER FI DE	0.00%	0.00%
DUNA INSTITUCIONAL FIC DE FI DE	0.00%	0.00%
SPX APACHE FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
SPX APACHE MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
STK LONG ONLY INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	0.00%
STUDIO 30 INST FI EM COTAS DE FI	0.00%	0.00%
BOGARI VALUE INSTITUCIONAL FI DE	0.00%	0.00%
STI INSTITUCIONAL FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
PACIFICO RV FICFI DE ACOES	0.00%	0.00%

Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia\* 1.18%

Total do percentual gasto com compra de opções\* 0.07%

\* Valores colhidos de forma bruta a partir das informações apresentadas pelo arquivo XML.

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	77.02%	77.02%	10.00%	✓
7	2.26%	79.28%	-	-
21	0.20%	79.48%	15.00%	✓
Longo	20.52%	100.00%	-	-

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	10,540,340.71	684,529,233.84	1.54%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	49,380,727.36	49,380,728.05	100.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	53,790,508.13	53,790,508.15	100.00%
TORRES FI MULTIMERCADO	47,003,004.30	47,003,004.35	100.00%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	49,271,364.73	49,271,365.37	100.00%

## ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	95.66%	27.00%	100.00%	✓
Renda Variável	4.34%	0.00%	70.00%	✓
Investimentos Estruturados	0.00%	-	-	-
Investimentos no Exterior	0.00%	-	-	-
Imóveis	0.00%	0.00%	8.00%	✓
Empréstimos	0.00%	0.00%	5.00%	✓

1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;

2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;

3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;

4. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBS PREV CONSOLIDADO 2013-08-30

30/08/2013

- 
1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
  2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou venha a fazer das informações nele contidas;
  3. O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;
  4. A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.
  5. Os valores informados nos segmentos de imóveis e empréstimos são considerados como parte do total dos recursos garantidores do plano quando verificamos os limites de concentração estipulados na Resolução CMN 3.792.