



### Risco de Mercado

#### Patrimônio Líquido

PL Calculado	101.999.165,95
PL Informado	101.950.330,59
PL Calculado a Mercado	101.999.165,95

#### Value At Risk

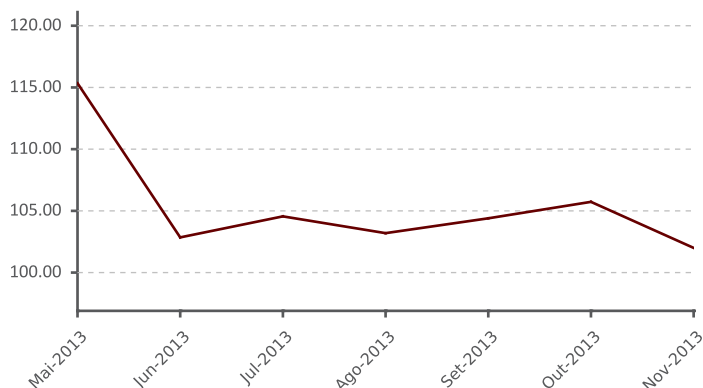
Value-at-Risk	2.377.446,34
Value-at-Risk (%)	2,3308

#### Parâmetros Para Cálculo Do VaR

Modelo	Non-Parametric
Nível de Confiança	95%
Horizonte de Tempo	21
BVaR (%)	
BVaR - IMA - RBS PREV	0,1395

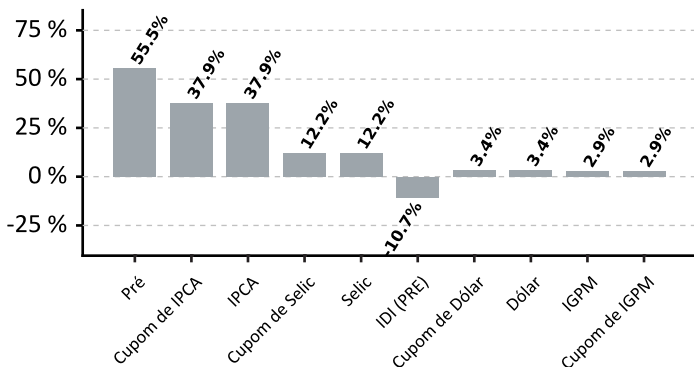
### Evolução do PL

(em milhões)



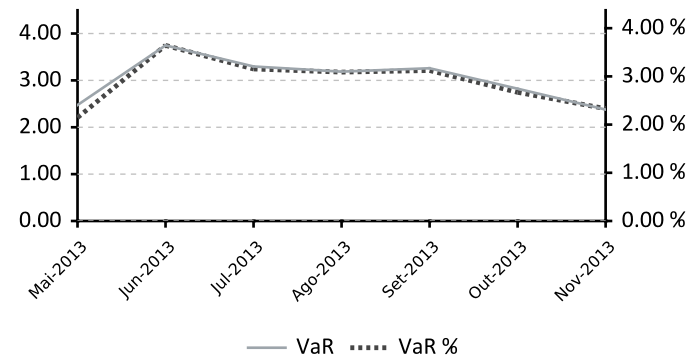
### Distribuição Percentual da Carteira por Fator de Risco

(% sobre PL Calculado)



### Evolução do VaR

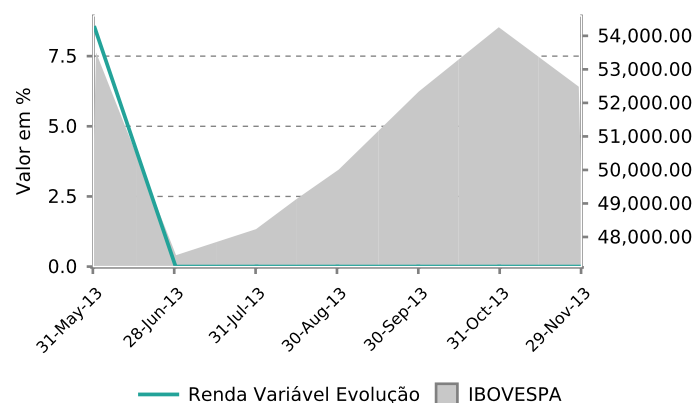
(em milhões)



### Evolução do BVaR (%) Renda Fixa



### Alocação em Renda Variável



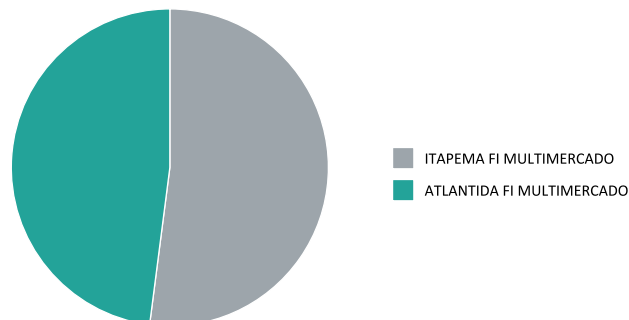
### Evolução de Crédito Privado





### Composição do Plano

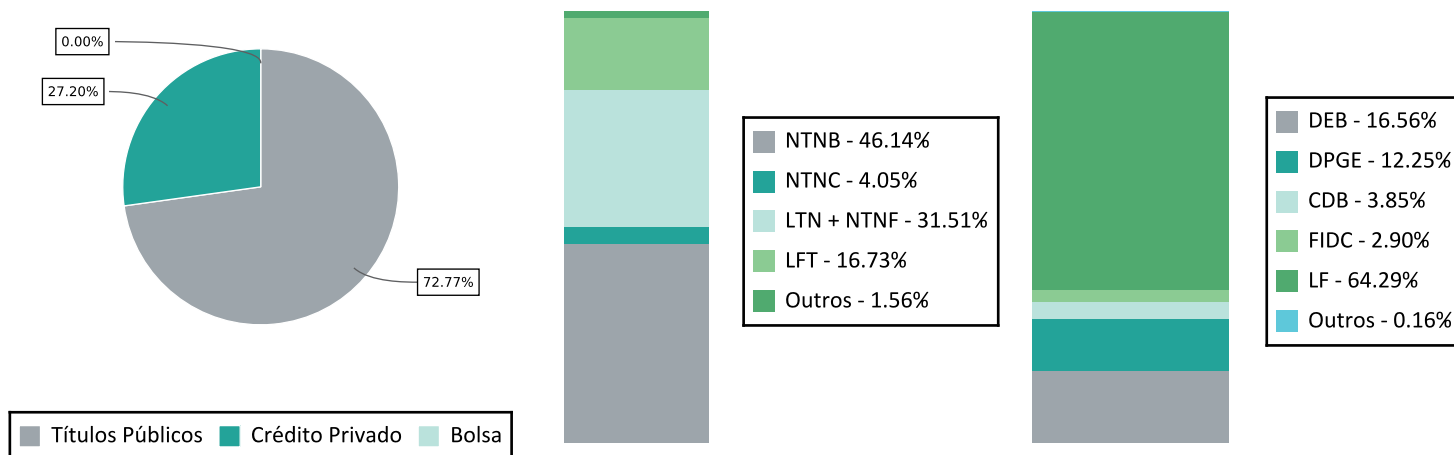
Book	Valor
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	53.056.194,39
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	48.894.136,20



### Participação por Classe de Ativos

Fatores de Risco	(%)			Dur. Ativa (du)			Dur. Passiva (du)		
	29/11/2013	31/10/2013	30/09/2013	29/11/2013	31/10/2013	30/09/2013	29/11/2013	31/10/2013	30/09/2013
CDI	0,68%	(36,21)%	(8,18)%	-	-	-	-	-	-
Caixa	(1,15)%	(0,07)%	(0,29)%	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos	0,79%	0,78%	0,80%	-	-	-	-	-	-
Cupom de Dólar	3,44%	1,99%	0,75%	22,00	21,00	24,00	0,00	0,00	0,00
Cupom de IGPM	2,95%	2,95%	3,07%	1.830,02	1.890,56	1.896,57	0,00	0,00	0,00
Cupom de IPCA	37,90%	38,72%	36,36%	1.869,25	2.019,54	1.879,38	0,00	0,00	0,00
Cupom de Selic	12,18%	14,27%	19,17%	316,17	336,65	303,73	0,00	0,00	0,00
Dólar	3,44%	1,99%	0,75%	-	-	-	-	-	-
IDI (PRE)	(10,65)%	(3,05)%	(15,13)%	-	-	-	-	-	-
IGPM	2,95%	2,95%	3,07%	-	-	-	-	-	-
IPCA	37,90%	38,72%	36,36%	-	-	-	-	-	-
Pré	55,54%	82,22%	65,01%	211,17	282,56	445,41	96,25	32,28	99,32
Selic	12,18%	14,27%	19,17%	-	-	-	-	-	-

### Alocação em Títulos Públicos e Privados





### Maiores Exposições Consolidado 10+

Contraparte	MtM Calc	MtM Calc (%)
SECRETARIA TESOURO NACIONAL	73.060.745,05	71,63
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	6.354.394,23	6,23
ITAU UNIBANCO SA	4.617.554,08	4,53
BCO BRADESCO SA	2.404.457,10	2,36
BCO SAFRA SA	2.315.246,01	2,27
BCO BMG SA	2.168.612,20	2,13
BCO BRASIL SA	1.292.300,56	1,27
BCO INDL COML SA BICBANCO	1.229.225,92	1,21
OI SA	978.508,76	0,96
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	909.556,68	0,89

### Basiléia Emissores Crédito Privado

Contraparte	Basiléia
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	20,70
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL	20,60
BCO INDL COML SA BICBANCO	18,90
ITAUSA INVESTS ITAU SA	18,00
BCO BRADESCO SA	16,40
BCO BRASIL SA	15,30
BCO SAFRA SA	13,90
BCO BMG SA	13,80
BCO VOLKSWAGEN SA	13,70
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	12,80



## Aquisições durante o Mês

## Títulos Públicos

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	4.418,38	6,26	6,55	15/08/2050	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	1.970.599,46	6,26	6,55	15/08/2050	ITAPEMA FI MULTIMERCADO
NTNB	2.187,00	6,10	6,53	15/05/2045	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	2.231,04	6,05	6,52	15/08/2040	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	2.215,87	6,02	6,50	15/05/2035	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	2.314,09	5,86	6,38	15/08/2024	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	34.926,02	5,73	6,34	15/08/2022	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	465.680,21	5,73	6,34	15/08/2022	ITAPEMA FI MULTIMERCADO
NTNB	4.710,22	5,67	6,19	15/08/2020	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	28.538,72	5,50	5,99	15/08/2018	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	2.361,30	5,36	5,75	15/05/2017	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
LTN	1.117.381,11	12,24	12,37	01/01/2017	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	4.811,42	5,26	5,48	15/08/2016	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	2.393,70	4,29	4,37	15/05/2015	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	2.413,00	3,64	3,65	15/08/2014	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO