

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

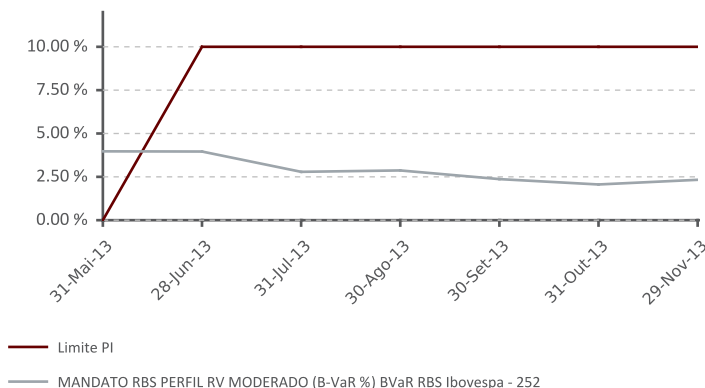
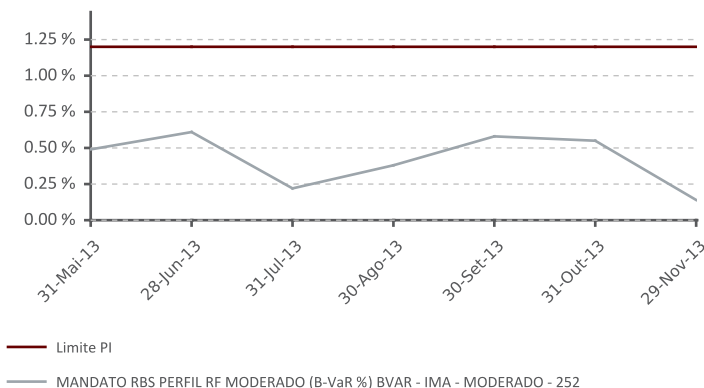
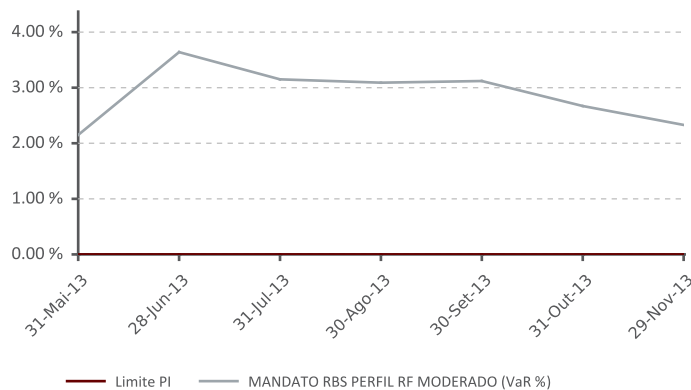
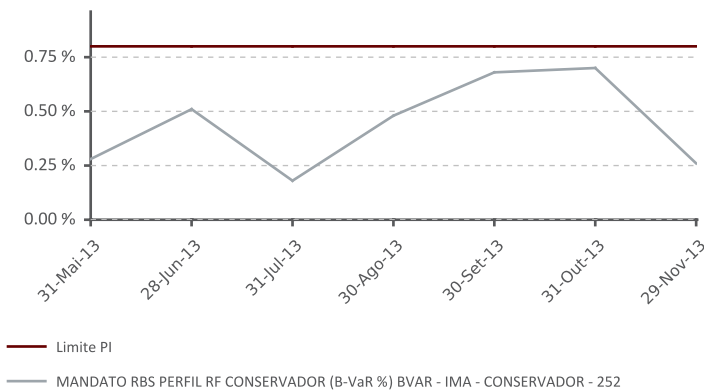
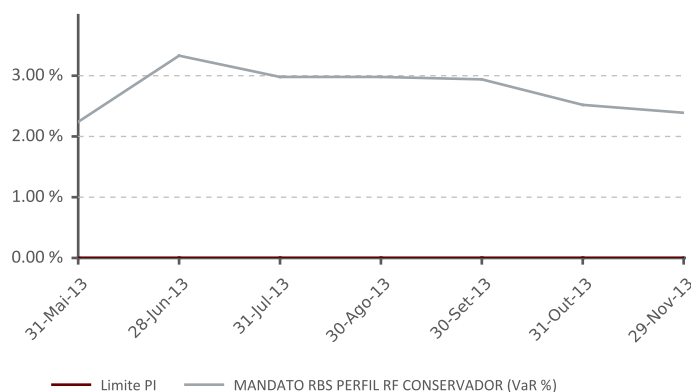
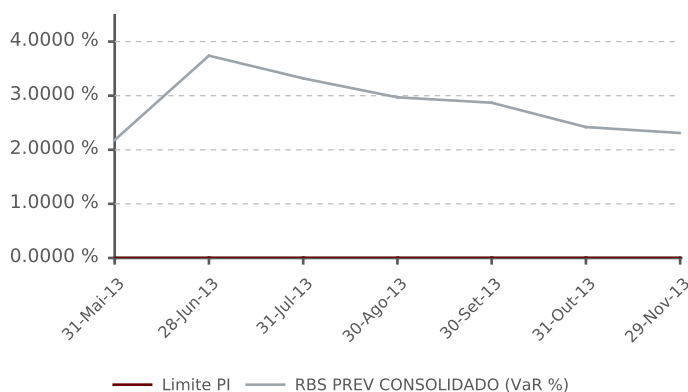
RBS PREV CONSOLIDADO 2013-11-29

29/11/2013

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	Var	Limite PI	Status	Stress	Stress %
CONSOLIDADO	-	209,651,780.58	209,616,939.76	2.31%	-	-	(10,185,524.43)	(4.86)%
MANDATO PERFIL RF CONSERVADOR	-	96,277,767.72	96,292,430.88	2.39%	-	-	(4,153,351.95)	(4.31)%
MANDATO PERFIL RF CONSERVADOR	IMA	96,277,767.72	96,292,430.88	0.26%	0.80%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RF MODERADO	-	101,999,165.95	101,950,330.59	2.33%	-	-	(4,321,293.49)	(4.24)%
MANDATO PERFIL RF MODERADO	IMA	101,999,165.95	101,950,330.59	0.14%	1.20%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RV MODERADO	IBOVESPA	9,903,719.48	9,903,049.94	2.33%	10.00%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RV MODERADO	-	11,374,846.91	11,374,178.29	5.56%	-	-	(1,710,878.99)	(15.04)%

EVOLUÇÃO GRÁFICA

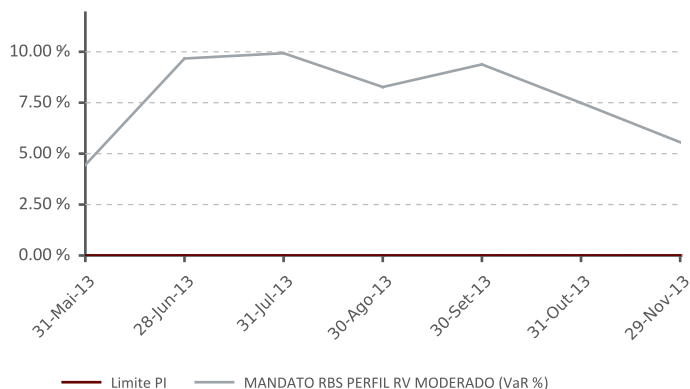


1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2013-11-29

29/11/2013



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	35,219,574.11	66.22	16.80
Faixa 2	AA	9,244,751.31	17.38	4.41
Faixa 3	A	4,362,196.03	8.20	2.08
Faixa 4	BBB	4,351,889.57	8.18	2.08
Faixa 5	< BBB-	0.00	0.00	0.00
Sem Nota	-	7,311.45	0.01	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		53,185,722.47		

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

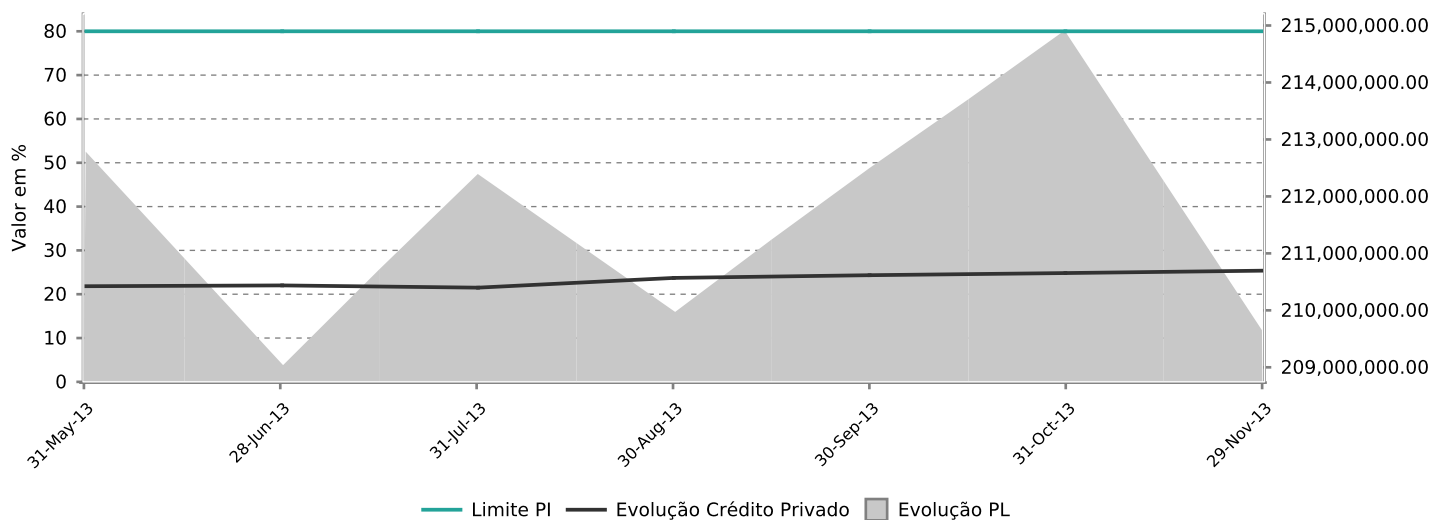
LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite PI	Status
Total Crédito Privado	25.37	80.00	✓
Grau Especulativo	2.08	20.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência
CAIXA	7,311.45	BNY MELLON BANCO S.	-	-
DPGE_cdi	4,351,889.57	BCO BMG SA	brBBB-	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 2013-11-29

29/11/2013

RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Contraparte	MtM Inf.	% Total	Limite Legal	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	12,733,003.35	6.07%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	11,390,105.99	5.43%	20.00%	✓
BCO BMG SA	4,351,889.57	2.08%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	4,208,753.84	2.01%	20.00%	✓
BCO SAFRA SA	3,474,645.14	1.66%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	2,642,129.98	1.26%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	2,454,006.62	1.17%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	2,235,454.18	1.07%	20.00%	✓
OI SA	1,904,103.63	0.91%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	1,659,117.89	0.79%	10.00%	✓

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%
BNY MELLON ARX FI DE ACOES	0.00%	0.74%
ITAU CAIXA ACOES FI	7.62%	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%	0.38%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	0.71%	0.00%
TORRES FI MULTIMERCADO	0.00%	0.07%
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%	0.97%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
JGP INSTITUCIONAL FIA	0.00%	0.32%
SQUADRA INSTITUCIONAL FI DE	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL BOLSA INDEX	0.41%	0.00%
PACIFICO ACOES MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
KONDOR INSTITUCIONAL FI ACOES	0.79%	0.00%
BRASIL CAPITAL LONG ONLY FIC FI	0.00%	0.00%
BRASIL CAPITAL LONG ONLY MASTER	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 2013-11-29

29/11/2013

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
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%	0.30%
APEX ACOES FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
JGP EXPLORER INSTITUCIONAL FI EM	0.00%	0.36%
BLACKROCK INST IBOVESPA YIELD FI	0.00%	0.00%
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%
BOGARI VALUE INSTITUCIONAL FI DE	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX OVER FI CURTO	0.00%	0.00%
STI INSTITUCIONAL FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
PACIFICO RV FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
PACIFICO RV MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
ITAU VERTICE IBOVESPA INDEX FICFI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
VERTRA INSTITUCIONAL FC FI ACOES	0.00%	0.00%
VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI	0.00%	0.00%
ITAU FOF RPI MASTER ACOES IBOV	0.00%	0.00%
ATMOS INSTITUCIONAL MASTER FIA	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUID FI REF DI LP	0.00%	0.00%
BNY MELLON ARX LIQUIDEZ FI REF DI	0.00%	0.00%

Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia* 0.19%

Total do percentual gasto com compra de opções* 0.11%

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	75.27%	75.27%	10.00%	✓
7	2.40%	77.67%	-	-
21	1.48%	79.16%	15.00%	✓
Longo	20.84%	100.00%	-	-

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 2013-11-29

29/11/2013

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	11,374,178.29	684,986,502.96	1.66%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	48,894,136.20	48,894,137.48	100.00%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	53,056,194.39	53,056,195.12	100.00%
TORRES FI MULTIMERCADO	47,064,058.17	47,064,058.21	100.00%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	49,228,372.71	49,228,376.24	100.00%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	95.28%	27.00%	100.00%	✓
Renda Variável	4.72%	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;