



Risco de Mercado

Patrimônio Líquido

PL Calculado	105.730.212,45
PL Informado	105.665.421,58
PL Calculado a Mercado	105.730.212,45

Value At Risk

Value-at-Risk	2.822.722,58
Value-at-Risk (%)	2,6697

Parâmetros Para Cálculo Do VaR

Modelo	Non-Parametric
Nível de Confiança	95%
Horizonte de Tempo	21
BVaR (%)	
BVaR - IMA - RBS PREV	0,5532

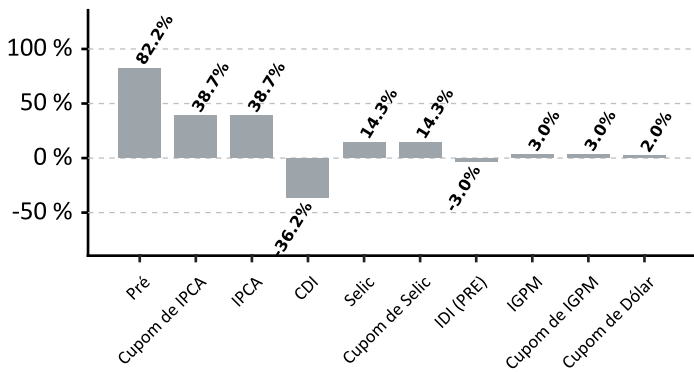
Evolução do PL

(em milhões)



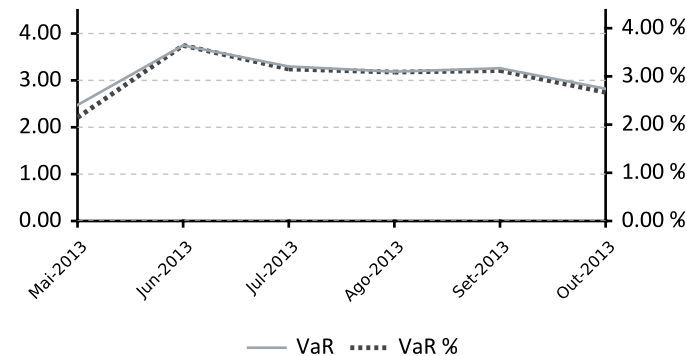
Distribuição Percentual da Carteira por Fator de Risco

(% sobre PL Calculado)

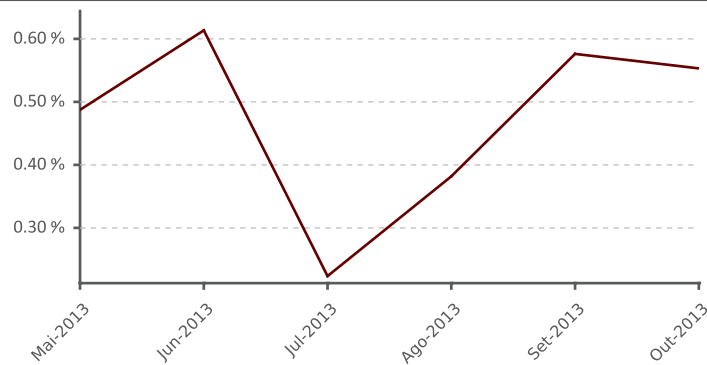


Evolução do VaR

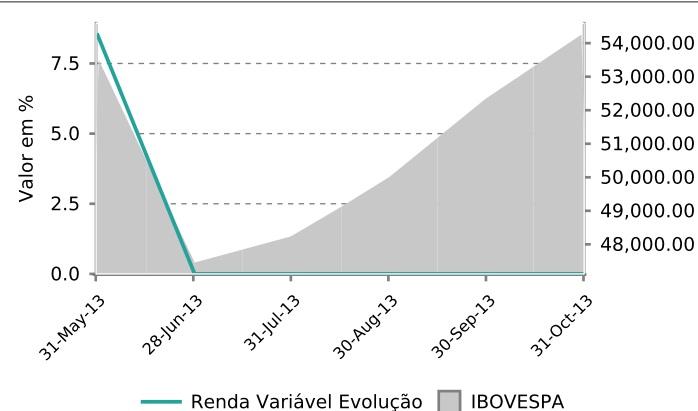
(em milhões)



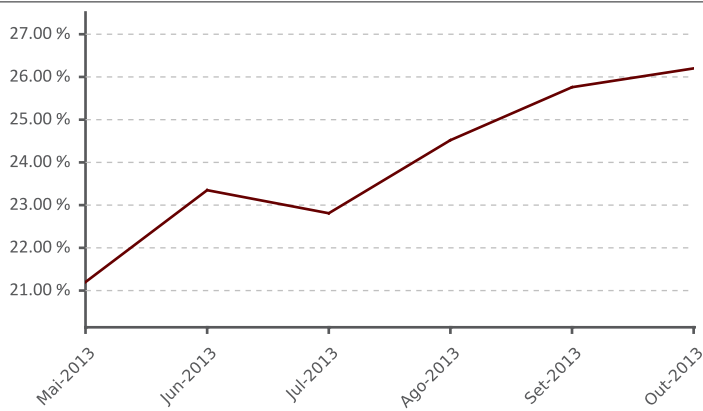
Evolução do BVaR (%) Renda Fixa



Alocação em Renda Variável



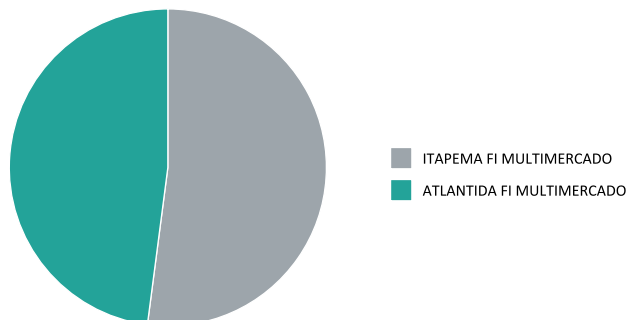
Evolução de Crédito Privado





Composição do Plano

Book	Valor
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	55.013.161,09
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	50.652.260,49



Participação por Classe de Ativos

Fatores de Risco	%			Dur. Ativa (du)			Dur. Passiva (du)		
	31/10/2013	30/09/2013	30/08/2013	31/10/2013	30/09/2013	30/08/2013	31/10/2013	30/09/2013	30/08/2013
CDI	(36,21)%	(8,18)%	(39,94)%	-	-	-	-	-	-
Caixa	(0,07)%	(0,29)%	1,09%	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos	0,78%	0,80%	0,83%	-	-	-	-	-	-
Cupom de Dólar	1,99%	0,75%	3,34%	21,00	24,00	14,81	0,00	0,00	0,00
Cupom de IGPM	2,95%	3,07%	3,01%	1.890,56	1.896,57	1.911,32	0,00	0,00	0,00
Cupom de IPCA	38,72%	36,36%	36,24%	2.019,54	1.879,38	1.921,13	0,00	0,00	0,00
Cupom de Selic	14,27%	19,17%	19,50%	336,65	303,73	337,22	0,00	0,00	0,00
Dólar	1,99%	0,75%	3,34%	-	-	-	-	-	-
IDI (PRE)	(3,05)%	(15,13)%	(12,80)%	-	-	-	-	-	-
IGPM	2,95%	3,07%	3,01%	-	-	-	-	-	-
IPCA	38,72%	36,36%	36,24%	-	-	-	-	-	-
Pré	82,22%	65,01%	90,16%	282,56	445,41	320,75	32,28	99,32	57,93
Selic	14,27%	19,17%	19,50%	-	-	-	-	-	-

Maiores Exposições Consolidado 10+

Contraparte	MtM Calc	MtM Calc (%)
SECRETARIA TESOUREO NACIONAL	76.880.881,49	72,71
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	6.306.355,40	5,96
ITAU UNIBANCO SA	4.727.078,23	4,47
BCO BRADESCO SA	2.355.600,11	2,23
BCO SAFRA SA	2.299.572,37	2,17
BCO BMG SA	2.151.219,60	2,03
BCO BRASIL SA	1.282.207,76	1,21
BCO INDL COML SA BICBANCO	1.219.625,72	1,15
OI SA	975.965,52	0,92
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	902.724,00	0,85

Basiléia Emissores Crédito Privado

Contraparte	Basiléia
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	21,50
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL)	19,50
BCO INDL COML SA BICBANCO	18,40
ITAUSA INVESTS ITAU SA	18,30
BCO BRASIL SA	15,90
BCO BRADESCO SA	15,40
BCO SAFRA SA	14,50
BCO BMG SA	14,00
BCO VOLKSWAGEN SA	13,60
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	13,50



Aquisições durante o Mês

Títulos Privados

Produto	Emissor	Inf.	Taxa (%)	Vencimento	Rating	Agência	Fundo de Origem
LF_CDI	SANB	903.689,09	0,00	21/10/2015	Aaa.br	MOODY	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO

Títulos Públicos

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	338.208,86	5,84	5,84	15/08/2050	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	2.700.839,29	5,84	5,84	15/08/2050	ITAPEMA FI MULTIMERCADO
NTNB	19.359,74	5,79	5,80	15/08/2040	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	804.041,04	5,59	5,67	15/08/2022	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNF	145.050,17	11,45	11,68	01/01/2019	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	110.663,11	5,30	5,45	15/08/2018	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
LTN	2.074.601,10	10,65	10,86	01/04/2015	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO