

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

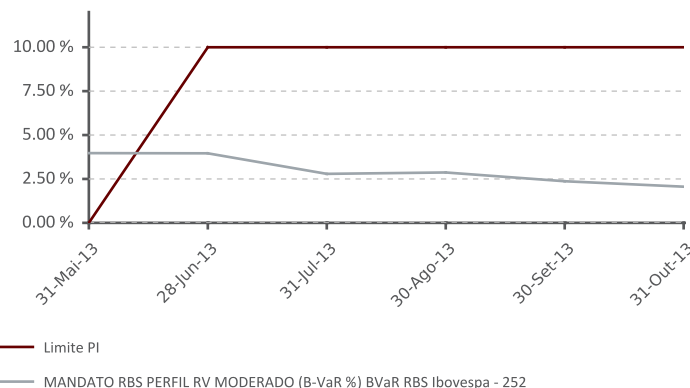
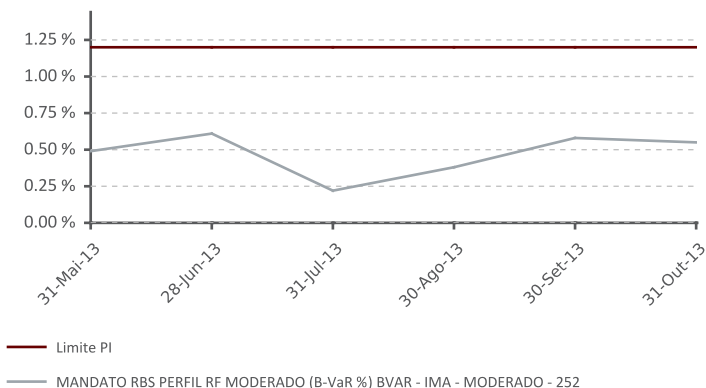
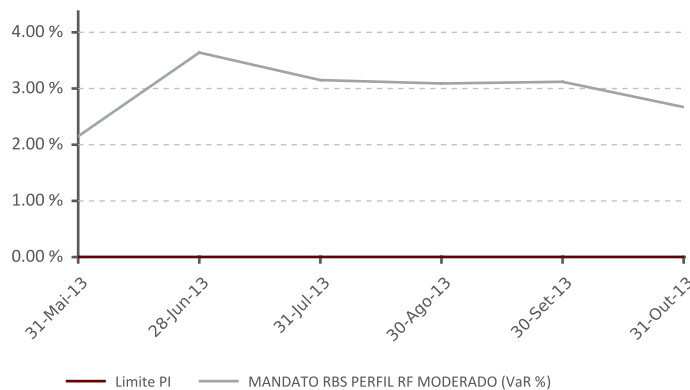
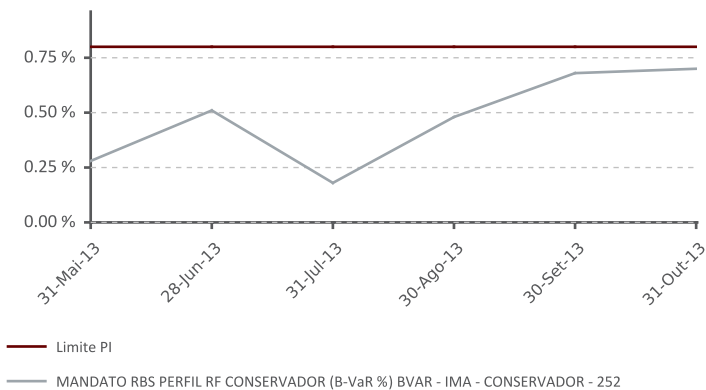
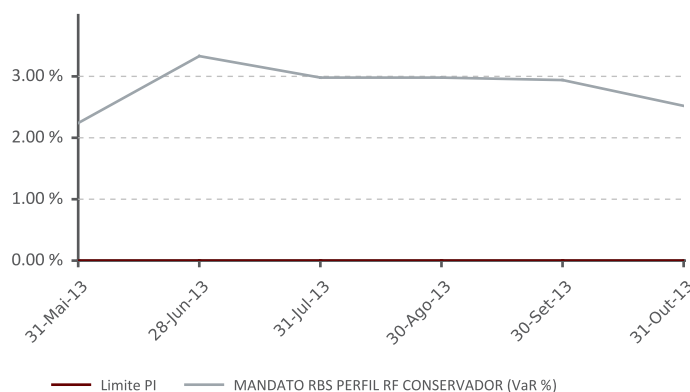
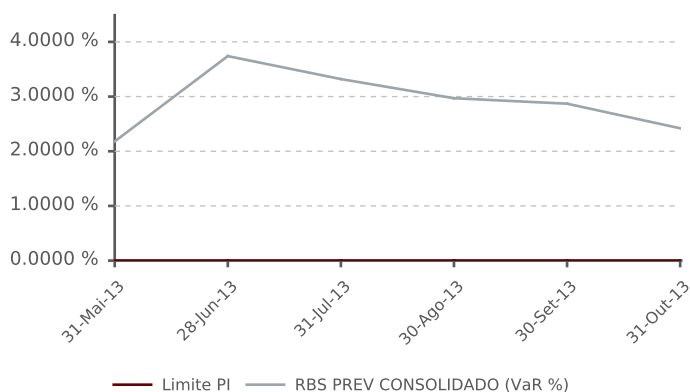
RBS PREV CONSOLIDADO 2013-10-31

31/10/2013

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	Var	Limite PI	Status	Stress	Stress %
CONSOLIDADO	-	214,912,520.65	214,843,436.41	2.42%	-	-	(14,050,119.21)	(6.54)%
MANDATO PERFIL RF CONSERVADOR	-	97,729,271.74	97,726,169.74	2.52%	-	-	(5,660,067.76)	(5.79)%
MANDATO PERFIL RF CONSERVADOR	IMA	97,729,271.74	97,726,169.74	0.70%	0.80%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RF MODERADO	-	105,730,212.45	105,665,421.58	2.67%	-	-	(6,671,034.43)	(6.31)%
MANDATO PERFIL RF MODERADO	IMA	105,730,212.45	105,665,421.58	0.55%	1.20%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RV MODERADO	IBOVESPA	9,913,435.97	9,912,243.77	2.06%	10.00%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RV MODERADO	-	11,453,036.45	11,451,845.09	7.49%	-	-	(1,719,017.02)	(15.01)%

EVOLUÇÃO GRÁFICA

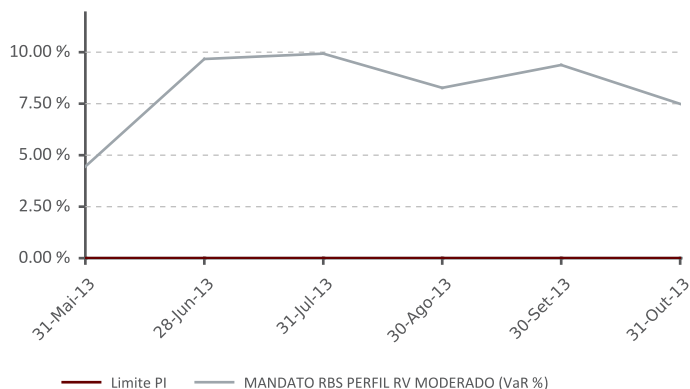


1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2013-10-31

31/10/2013



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	33,343,428.51	62.52	15.52
Faixa 2	AA	11,309,034.33	21.20	5.26
Faixa 3	A	4,357,238.65	8.17	2.03
Faixa 4	BBB	4,307,100.52	8.08	2.00
Faixa 5	< BBB-	0.00	0.00	0.00
Sem Nota	-	19,640.33	0.04	0.01
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		53,336,442.34		

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

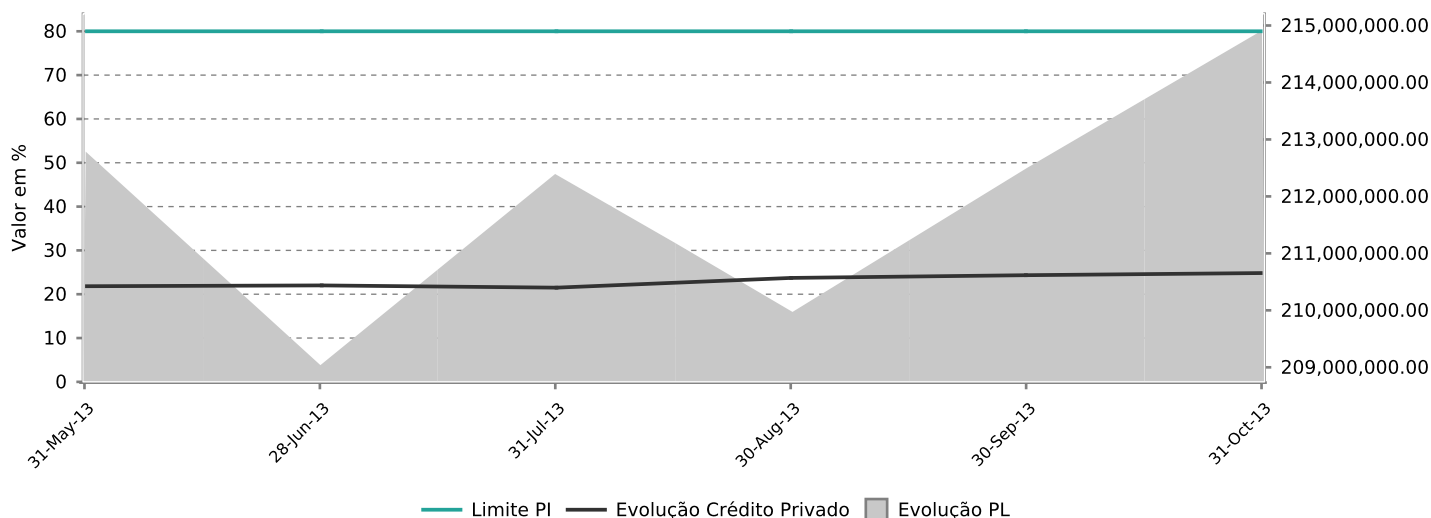
LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite PI	Status
Total Crédito Privado	24.83	80.00	✓
Grau Especulativo	2.01	20.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência
DPGE_cdi	4,307,100.52	BCO BMG SA	brBBB-	SP
CAIXA	19,640.33	Não Informado	-	-

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 2013-10-31

31/10/2013

RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Contraparte	MtM Inf.	% Total	Limite Legal	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	12,636,981.72	5.88%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	11,656,301.86	5.43%	20.00%	✓
BCO BMG SA	4,307,100.52	2.00%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	4,119,517.83	1.92%	20.00%	✓
BCO SAFRA SA	3,448,756.35	1.61%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	2,659,853.44	1.24%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	2,439,468.43	1.14%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	2,217,857.34	1.03%	20.00%	✓
OI SA	1,894,335.01	0.88%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	1,652,623.21	0.77%	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%	0.29%
ITAU CAIXA ACOES FI	5.20%	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%	0.29%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	0.71%	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%	1.00%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
JGP INSTITUCIONAL FIA	0.00%	0.25%
SQUADRA INSTITUCIONAL FI DE	0.00%	0.00%
ITAU INSTITUCIONAL BOLSA INDEX	0.55%	0.00%
PACIFICO ACOES MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
KONDOR INSTITUCIONAL FI ACOES	0.77%	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 2013-10-31

31/10/2013

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%	0.00%
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%	0.32%
BLACKROCK INST IBOVESPA YIELD FI	0.00%	0.00%
EXPLORA OPORTUNIDADES II FI DE	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%
ITAU FOF RPI MASTER ACOES	0.00%	0.00%
ATMOS INSTITUCIONAL MASTER FIA	0.00%	0.00%
VERTRA INSTITUCIONAL FC FI ACOES	0.00%	0.00%
VERTRA INSTITUCIONAL MASTER FI	0.00%	0.00%
Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*	0.19%	
Total do percentual gasto com compra de opções*	0.09%	

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	75.77%	75.77%	10.00%	✓
7	2.51%	78.28%	-	-
21	0.20%	78.48%	15.00%	✓
Longo	21.52%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	11,451,845.09	718,437,033.56	1.59%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	50,652,260.49	50,652,260.49	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 2013-10-31

31/10/2013

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	55,013,161.09	55,013,161.09	100.00%
TORRES FI MULTIMERCADO	47,759,789.29	47,759,789.30	100.00%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	49,966,380.45	49,966,380.45	100.00%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	95.39%	27.00%	100.00%	✓
Renda Variável	4.61%	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;