



Risco de Mercado

Patrimônio Líquido

PL Calculado	104.396.720,01
PL Informado	104.322.079,29
PL Calculado a Mercado	104.396.720,01

Value At Risk

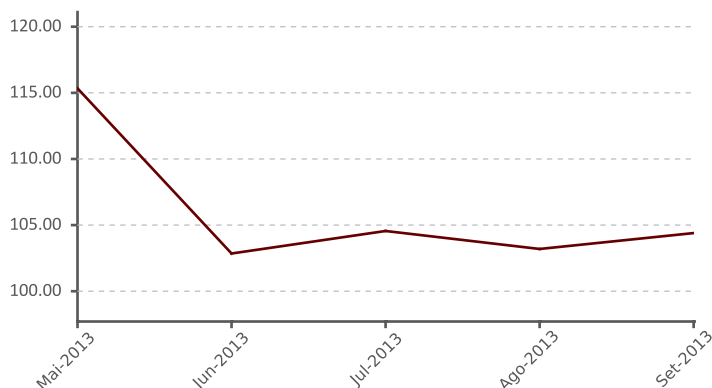
Value-at-Risk	3.258.932,17
Value-at-Risk (%)	3,1217

Parâmetros Para Cálculo Do VaR

Modelo	Non-Parametric
Nível de Confiança	95%
Horizonte de Tempo	21
BVaR (%)	
BVaR - IMA - RBS PREV	0,5762

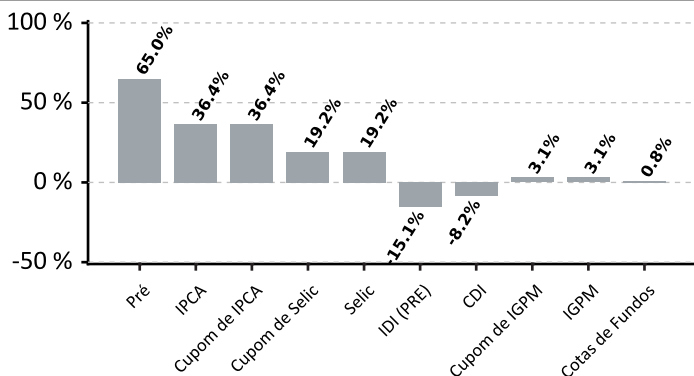
Evolução do PL

(em milhões)



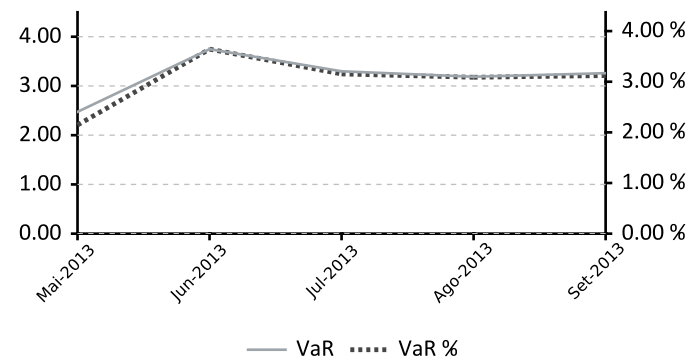
Distribuição Percentual da Carteira por Fator de Risco

(% sobre PL Calculado)

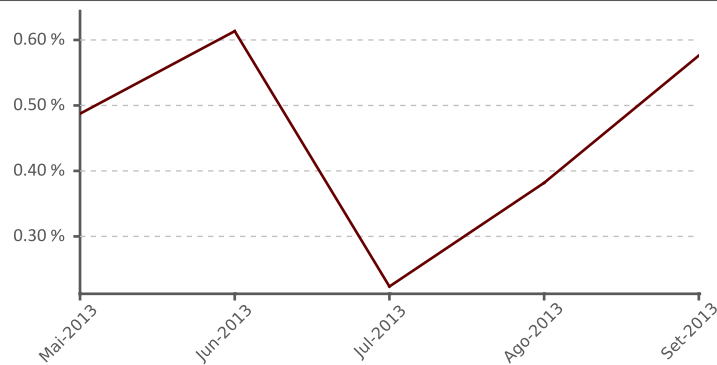


Evolução do VaR

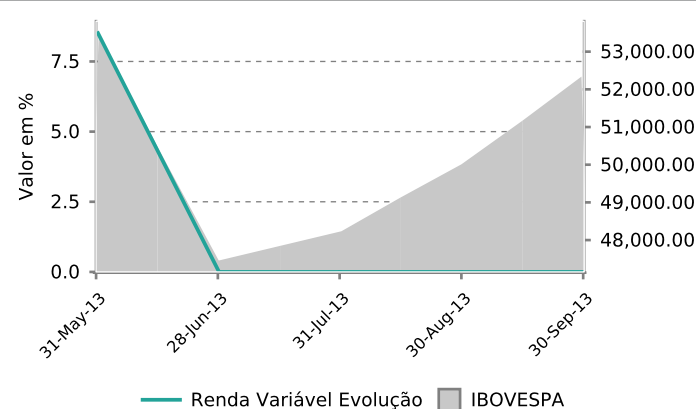
(em milhões)



Evolução do BVaR (%) Renda Fixa



Alocação em Renda Variável



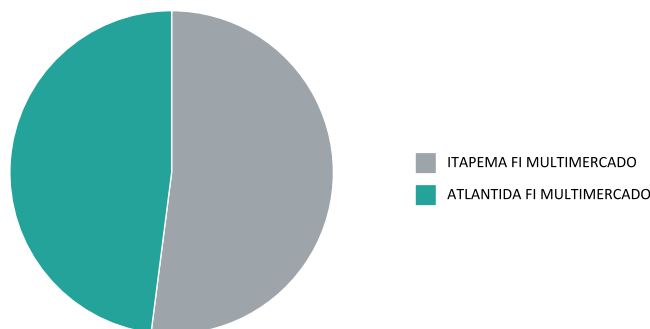
Evolução de Crédito Privado





Composição do Plano

Book	Valor
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	54.281.350,01
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	50.040.729,28



Participação por Classe de Ativos

Fatores de Risco	(%)			Dur. Ativa (du)			Dur. Passiva (du)		
	30/09/2013	30/08/2013	31/07/2013	30/09/2013	30/08/2013	31/07/2013	30/09/2013	30/08/2013	31/07/2013
CDI	(8,18)%	(39,94)%	(26,94)%	-	-	-	-	-	-
Caixa	(0,29)%	1,09%	(0,00)%	-	-	-	-	-	-
Cotas de Fundos	0,80%	0,83%	0,84%	-	-	-	-	-	-
Cupom de Dólar	0,75%	3,34%	1,32%	24,00	14,81	23,00	0,00	0,00	0,00
Cupom de IGPM	3,07%	3,01%	3,04%	1.896,57	1.911,32	1.946,26	0,00	0,00	0,00
Cupom de IPCA	36,36%	36,24%	33,65%	1.879,38	1.921,13	2.058,99	0,00	0,00	0,00
Cupom de Selic	19,17%	19,50%	35,84%	303,73	337,22	189,49	0,00	0,00	0,00
Dólar	0,75%	3,34%	1,32%	-	-	-	-	-	-
IDI (PRE)	(15,13)%	(12,80)%	(0,00)%	-	-	-	-	-	-
IGPM	3,07%	3,01%	3,04%	-	-	-	-	-	-
IPCA	36,36%	36,24%	33,65%	-	-	-	-	-	-
Pré	65,01%	90,16%	53,58%	445,41	320,75	434,18	99,32	57,93	137,81
Selic	19,17%	19,50%	35,84%	-	-	-	-	-	-

Maiores Exposições Consolidado 10+

Contraparte	MtM Calc	MtM Calc (%)
SECRETARIA TESOUREO NACIONAL	76.559.490,63	73,34
HSBC BANK BRASIL SA BANCO	6.252.526,32	5,99
ITAU UNIBANCO SA	4.812.660,59	4,61
BCO BRADESCO SA	2.339.101,16	2,24
BCO SAFRA SA	2.279.257,28	2,18
BCO BMG SA	2.131.740,25	2,04
BCO BRASIL SA	1.270.901,47	1,22
BCO INDL COML SA BICBANCO	1.208.871,26	1,16
OI SA	964.551,34	0,92
FUNDO INVEST DIREITOS	838.783,24	0,80

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
CDB_cdi	BVKW	200.823,60	105,50	12/09/2014	brAAA	SP	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
DPGE_cdi	BICB	1.208.927,58	0,00	31/08/2015	A+(bra)	FR	ITAPEMA FI MULTIMERCADO

Títulos Públicos

Produto	Inf.	Tx. Média	Tx. ANBIMA	Vencimento	Fundo de Origem
NTNB	293.592,55	5,89	5,96	15/08/2050	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	45.569,82	5,77	5,91	15/05/2045	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	18.992,34	5,73	5,87	15/08/2040	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	21.945,92	5,65	5,75	15/05/2035	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	60.161,44	5,65	5,70	15/08/2030	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	26.568,44	5,62	5,54	15/08/2024	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	565.018,66	5,52	5,47	15/08/2022	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	28.855,63	5,56	5,42	15/08/2020	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	96.035,49	5,46	5,26	15/08/2018	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	24.335,86	5,32	5,06	15/05/2017	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	47.842,77	5,16	4,94	15/08/2016	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO
NTNB	642.868,82	4,15	3,95	15/05/2015	ATLANTIDA FI MULTIMERCADO

Alterações de Ratings

Títulos Privados

Produto	Contraparte	Agência	Rating Anterior	Rating Atual	Emissor/Emissão	Fundo de Origem
DPGE_cdi	BCO BMG SA	SP	brBB+	brBBB-	Emissão	ITAPEMA FI MULTIMERCADO