

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

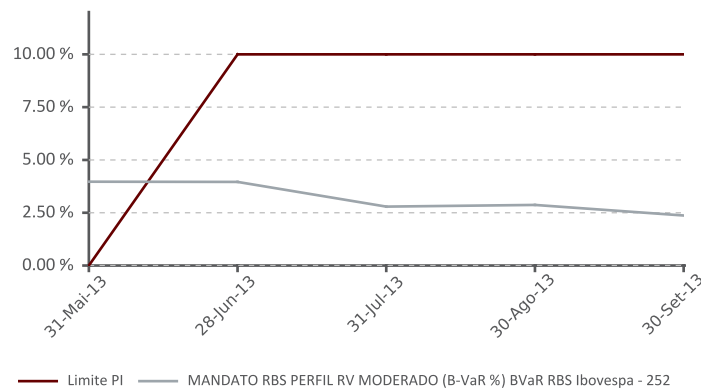
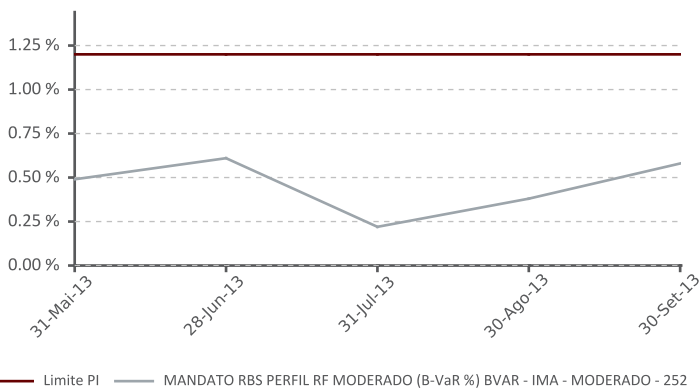
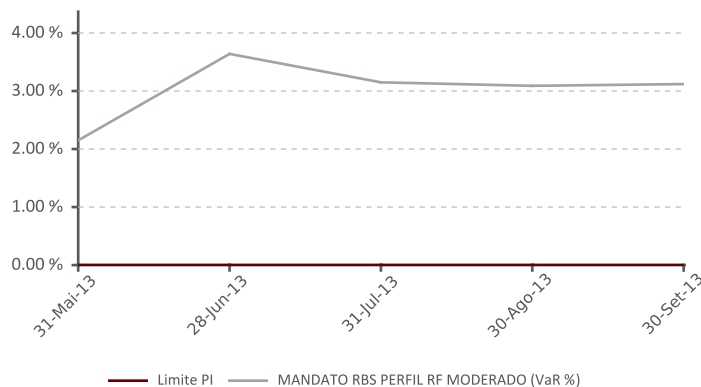
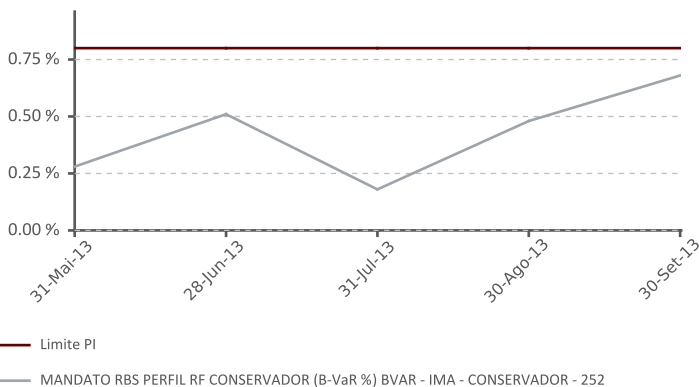
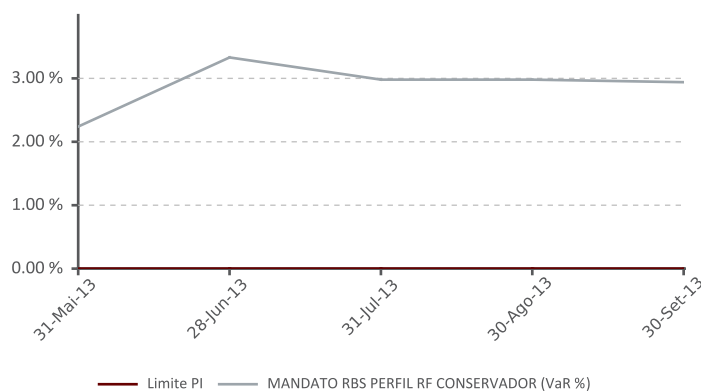
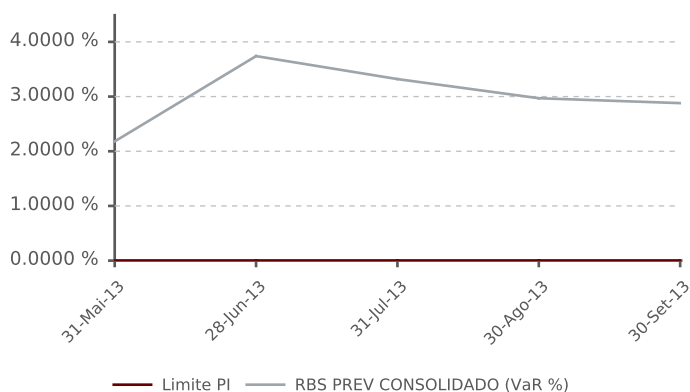
RBS PREV CONSOLIDADO 2013-09-30

30/09/2013

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	Var	Limite PI	Status	Stress	Stress %
CONSOLIDADO	-	212,501,962.02	212,412,270.79	2.88%	-	-	(12,756,697.94)	(6.00)%
MANDATO PERFIL RF CONSERVADOR	-	97,150,797.75	97,135,665.50	2.94%	-	-	(5,174,477.89)	(5.33)%
MANDATO PERFIL RF CONSERVADOR	IMA	97,150,797.75	97,135,665.50	0.68%	0.80%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RF MODERADO	-	104,396,720.01	104,322,079.29	3.12%	-	-	(5,916,150.76)	(5.67)%
MANDATO PERFIL RF MODERADO	IMA	104,396,720.01	104,322,079.29	0.58%	1.20%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RV MODERADO	IBOVESPA	9,448,771.37	9,448,852.45	2.37%	10.00%	✓	-	-
MANDATO PERFIL RV MODERADO	-	10,954,444.26	10,954,526.00	9.38%	-	-	(1,666,069.29)	(15.21)%

EVOLUÇÃO GRÁFICA

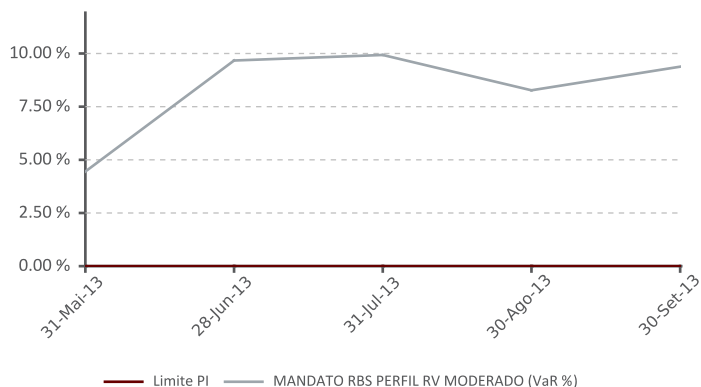


1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2013-09-30

30/09/2013



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	33,625,355.07	65.04	15.83
Faixa 2	AA	9,407,639.50	18.20	4.43
Faixa 3	A	4,393,790.82	8.50	2.07
Faixa 4	BBB	4,265,935.22	8.25	2.01
Faixa 5	< BBB-	0.00	0.00	0.00
Sem Nota	-	6,515.96	0.01	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		51,699,236.58		

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

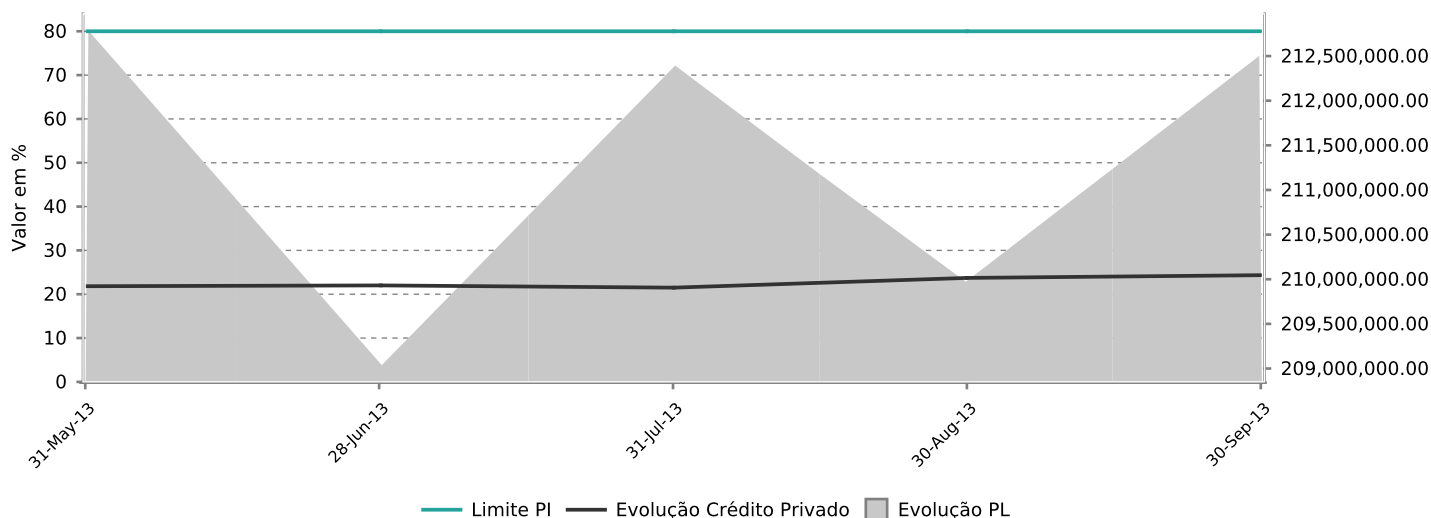
LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite PI	Status
Total Crédito Privado	24.34	80.00	✓
Grau Especulativo	2.01	20.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência
CAIXA	6,515.96	Não Informado	-	-
DPGE_cdi	4,265,935.22	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 2013-09-30

30/09/2013

RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Contraparte	MtM Inf.	% Total	Limite Legal	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	12,525,945.80	5.90%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	11,680,626.41	5.50%	20.00%	✓
BCO BMG SA	4,265,935.22	2.01%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	4,122,229.88	1.94%	20.00%	✓
BCO SAFRA SA	3,419,644.55	1.61%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	2,652,881.10	1.25%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	2,418,300.44	1.14%	20.00%	✓
OI SA	1,883,598.95	0.89%	10.00%	✓
SONAE SIERRA BRASIL SA	1,640,663.84	0.77%	10.00%	✓
BR MALLS PARTICIPACOES SA	1,517,612.59	0.71%	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%	0.00%
ITAU CAIXA ACOES FI	3.90%	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%	0.24%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	0.48%	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%	0.47%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	0.00%	0.00%
JGP INSTITUCIONAL FIA	0.00%	0.26%
SQUADRA INSTITUCIONAL FI DE	0.00%	0.00%
PACIFICO ACOES MASTER FI ACOES	0.00%	0.00%
KONDOR INSTITUCIONAL FI ACOES	0.74%	0.00%
BRASIL CAPITAL LONG ONLY FIC FI	0.00%	0.00%
BRASIL CAPITAL LONG ONLY MASTER	0.00%	0.00%
ITAU INST ACOES FOF MULTIGESTOR	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 2013-09-30

30/09/2013

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
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%	0.00%
BLACKROCK INST IBOVESPA YIELD FI	0.00%	0.00%
EXPLORA OPORTUNIDADES II FI DE	0.00%	7.40%
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%
STUDIO 30 INST FI EM COTAS DE FI	0.00%	0.00%
BOGARI VALUE INSTITUCIONAL FI DE	0.00%	0.00%
STI INSTITUCIONAL FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
PACIFICO RV MASTER FIA	0.00%	0.00%
PACIFICO RV FIC FI ACOES	0.00%	0.00%
Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*	0.14%	
Total do percentual gasto com compra de opções*	0.08%	

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	76.56%	76.56%	10.00%	✓
7	2.42%	78.98%	-	-
21	0.13%	79.11%	15.00%	✓
Longo	20.89%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU RPI ACOES IBOVESPA ATIVO FICFI	10,954,526.00	702,173,380.83	1.56%
ATLANTIDA FI MULTIMERCADO	50,040,729.28	50,060,046.16	99.96%
ITAPEMA FI MULTIMERCADO	54,281,350.01	54,281,350.01	100.00%
TORRES FI MULTIMERCADO	47,444,318.04	47,444,318.04	100.00%
LAGOINHA FI MULTIMERCADO	49,691,347.46	49,691,347.46	100.00%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	95.55%	27.00%	100.00%	✓
Renda Variável	4.45%	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;