

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO PGA 2014-08-29

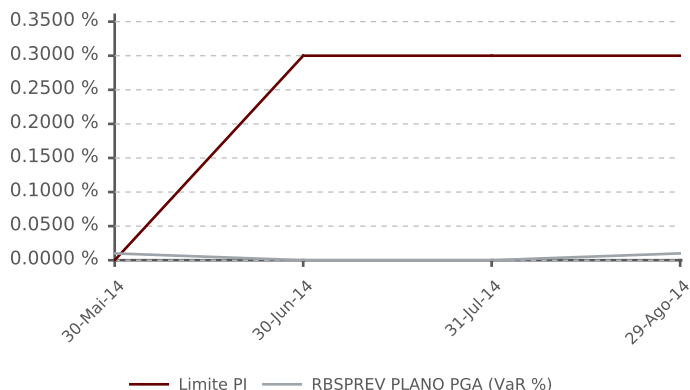
29/08/2014

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,108,834.35	2,114,635.10	0.01%	0.30%	✓	(431.62)	(0.02)%

* Quando o campo Benchmark estiver preenchido, o valor apresentado na coluna VaR/BVaR será o Benchmark VaR. Caso contrário o valor apresentado será o Value at Risk.

EVOLUÇÃO GRÁFICA



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	894,171.85	56.70	42.28
Faixa 2	AA	676,420.15	42.90	31.99
Faixa 3	A	3,130.91	0.20	0.15
Faixa 4	BBB	0.00	0.00	0.00
Faixa 5	< BBB-	3,162.86	0.20	0.15
Sem Nota	-	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		1,576,885.77		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite PI	Status
Total Crédito Privado	74.57	80.00	✓
Grau Especulativo	0.07	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	1,566.86	BCO BONSUCESSO SA	Ba1.br	MOODY	HSBC FI REF DI CRED PRIV LP EXECUTIVO

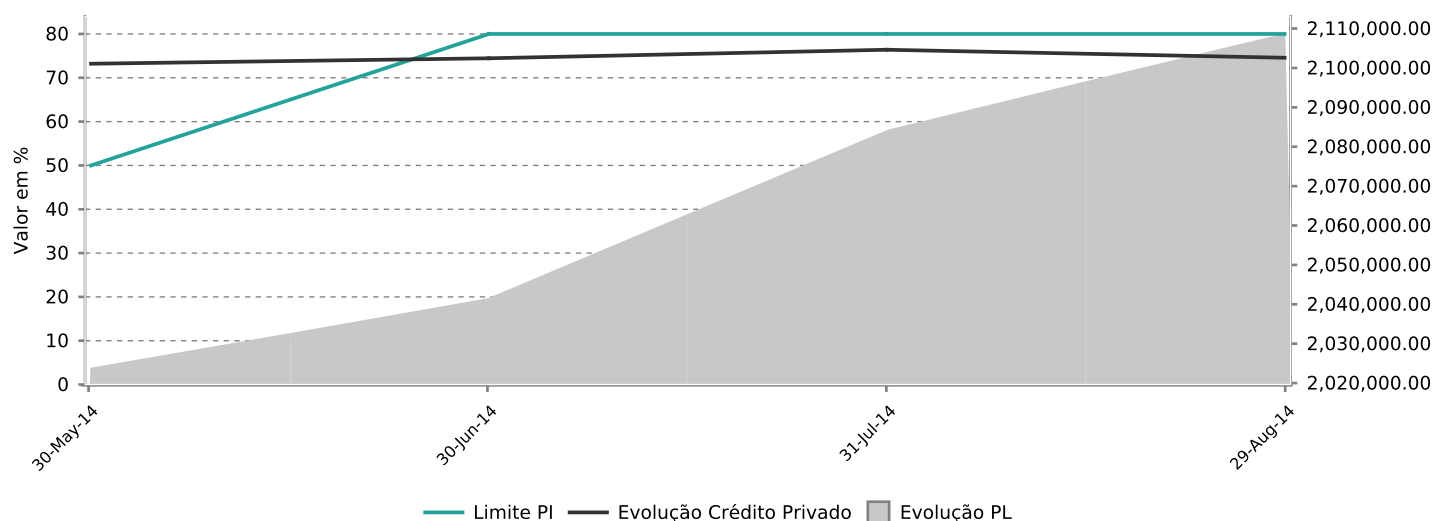
1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou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

RBSPREV PLANO PGA 2014-08-29

29/08/2014

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Contraparte	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	323,576.72	15.30%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	255,924.67	12.10%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	222,908.60	10.54%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	198,808.45	9.40%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	186,993.51	8.84%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	73,184.37	3.46%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	52,836.07	2.50%	20.00%	✓
CAMARGO CORREA SA	49,821.77	2.36%	3.00%	✓
BCO SAFRA SA	35,101.64	1.66%	20.00%	✓
BCO VOLKSWAGEN SA	26,087.18	1.23%	20.00%	✓

DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
HSBC FI REFERENCIADO DI CASH II	0.00%	0.00%
HSBC FI REF DI CRED PRIV LP	0.42%	0.00%
HSBC FI REFERENCIADO DI CASH	0.00%	0.00%
CARTEIRA PROPRIA RBS PGA	0.00%	0.00%
Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*		0.42%
Total do percentual gasto com compra de opções*		0.00%

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

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	33.24%	33.24%	-	-
7	0.00%	33.24%	-	-
21	7.43%	40.68%	-	-
Longo	59.32%	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

RBSPREV PLANO PGA 2014-08-29

29/08/2014

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
HSBC FI REF DI CRED PRIV LP EXECUTIVO	2,114,811.50	10,448,137,220.88	0.02%

ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total Inf.	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	100.00%	100.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.00%	-	-	-
Investimentos Estruturados	0.00%	-	-	-
Investimentos no Exterior	0.00%	-	-	-
Imóveis	0.00%	-	-	-
Empréstimos	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.

5. Os valores informados nos segmentos de imóveis e empréstimos são considerados como parte do total dos recursos garantidores do plano quando verificamos os limites de concentração estipulados na Resolução CMN 3.792.