

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO PGA 2014-12-31

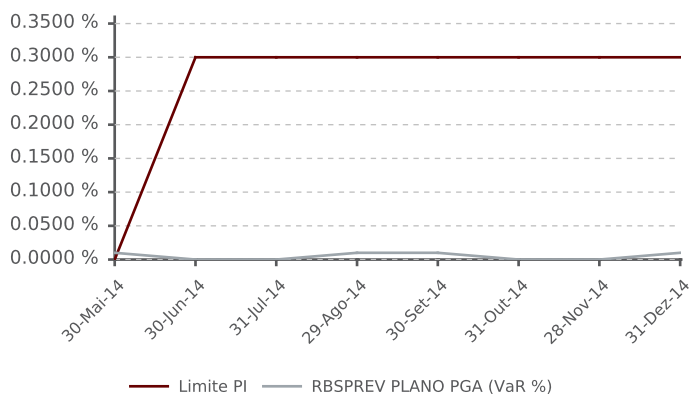
31/12/2014

## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,200,208.80	2,206,400.83	0.01%	0.30%	✓	(520.97)	(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	1,048,547.87	67.03	47.52
Faixa 2	AA	511,077.95	32.67	23.16
Faixa 3	A	3,123.32	0.20	0.14
Faixa 4	BBB	0.00	0.00	0.00
Faixa 5	< BBB-	1,627.14	0.10	0.07
Sem Nota	-	<b>0.00</b>	0.00	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
<b>Total</b>		<b>1,564,376.28</b>		

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

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	70.90	80.00	✓
Grau Especulativo	0.07	5.00	✓

## ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	1,627.14	BCO BONSUCESSO SA	Ba1.br	MOODY	HSBC FI REF DI CRED PRIV LP EXECUTIVO

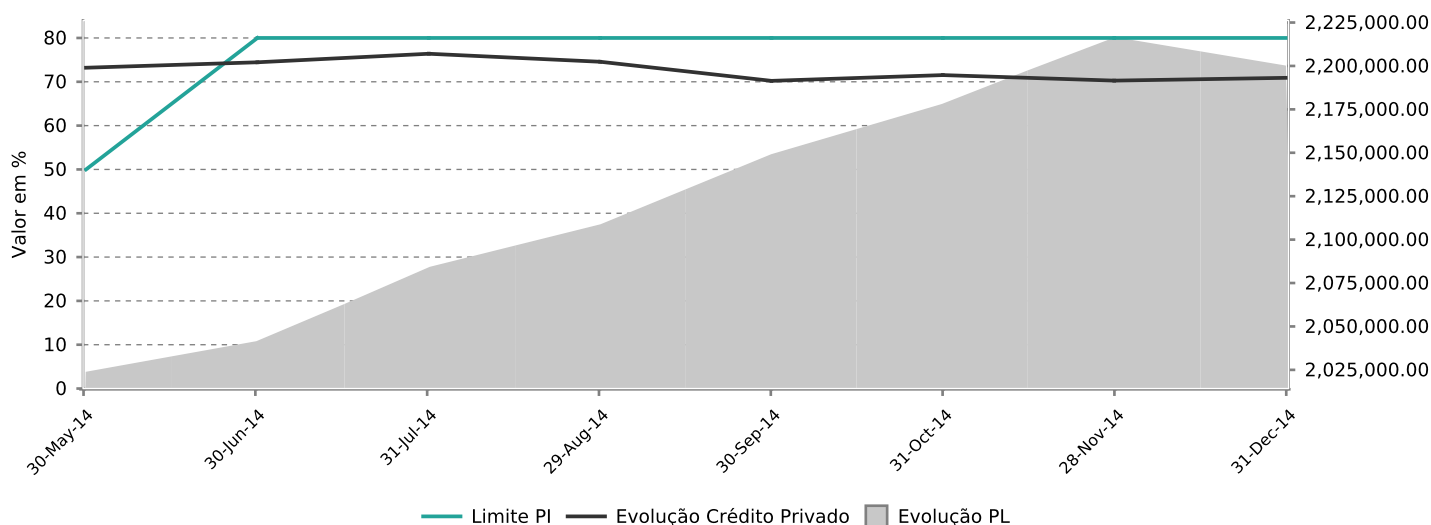
1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2014-12-31

31/12/2014

## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	308,413.11	13.98%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	286,825.09	13.00%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	241,073.95	10.93%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	163,763.79	7.42%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	133,839.80	6.07%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	75,133.03	3.41%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	62,423.37	2.83%	20.00%	✓
CAMARGO CORREA SA	48,475.29	2.20%	10.00%	✓
BCO SAFRA SA	45,048.08	2.04%	20.00%	✓
CIELO SA	34,046.17	1.54%	10.00%	✓

## 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	0.41%	0.00%
HSBC FI REFERENCIADO DI CASH	0.00%	0.00%
CARTEIRA PROPRIA RBS PGA	0.00%	0.00%
<b>Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia*</b>	<b>0.41%</b>	
<b>Total do percentual gasto com compra de opções*</b>		<b>0.00%</b>

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

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	37.02%	37.02%	-	-
7	0.00%	37.02%	-	-
21	2.23%	39.25%	-	-
Longo	60.75%	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 2014-12-31

31/12/2014

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
HSBC FI REF DI CRED PRIV LP EXECUTIVO	2,206,594.41	11,028,217,624.86	0.02%

## ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total Inf.	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	100.00%	100.00%	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.
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.