

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

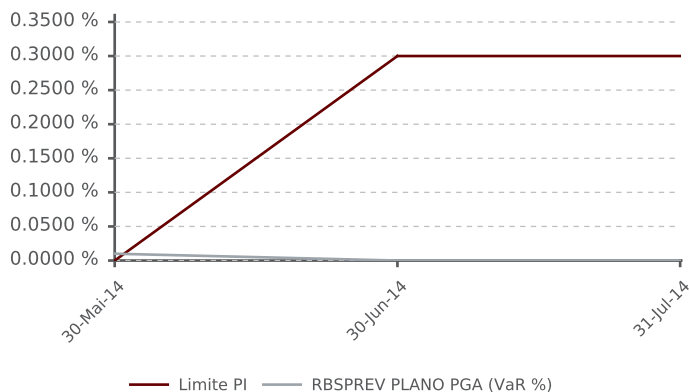
RBSPREV PLANO PGA 2014-07-31

31/07/2014

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	Var	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,084,331.37	2,090,200.41	0.00%	0.30%	✓	(181.48)	(0.01)%

EVOLUÇÃO GRÁFICA



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	906,546.87	56.77	43.37
Faixa 2	AA	680,855.40	42.64	32.57
Faixa 3	A	6,325.44	0.40	0.30
Faixa 4	BBB	0.00	0.00	0.00
Faixa 5	< BBB-	3,165.26	0.20	0.15
Sem Nota	-	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		1,596,892.97		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite PI	Status
Total Crédito Privado	76.40	80.00	✓
Grau Especulativo	0.08	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	1,568.05	BCO BONSUCESSO SA	Ba1.br	MOODY	HSBC FI REF DI CRED PRIV LP EXECUTIVO

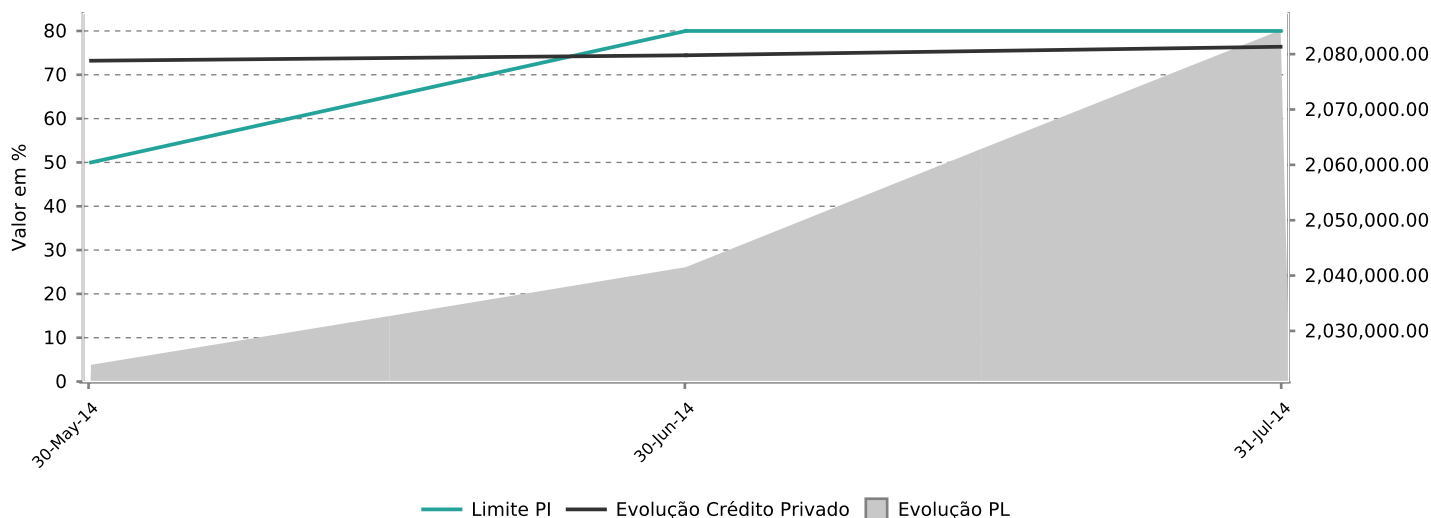
1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2014-07-31

31/07/2014

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Contraparte	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	324,018.16	15.50%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	261,666.80	12.52%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	223,319.73	10.68%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	199,064.76	9.52%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	188,580.78	9.02%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	77,438.63	3.70%	20.00%	✓
CAMARGO CORREA SA	53,400.17	2.55%	3.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	52,910.69	2.53%	20.00%	✓
BCO SAFRA SA	36,140.92	1.73%	20.00%	✓
BCO VOLKSWAGEN SA	26,129.50	1.25%	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	31.74%	31.74%	-	-
7	0.00%	31.74%	-	-
21	0.00%	31.74%	-	-
Longo	68.26%	100.00%	-	-

- Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
- 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;
- O conteúdo deste documento não deve ser entendido e nem interpretado como recomendação e nem garantia de resultados;
- A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO PGA 2014-07-31

31/07/2014

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
HSBC FI REF DI CRED PRIV LP EXECUTIVO	2,090,390.57	10,218,589,548.22	0.02%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	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.