

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

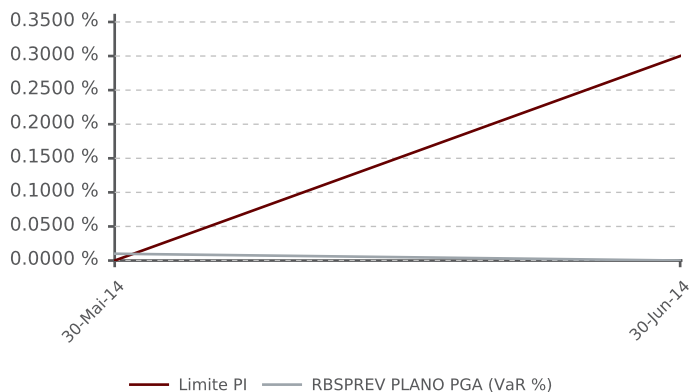
RBSPREV PLANO PGA 2014-06-30

30/06/2014

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	Var	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,041,520.22	2,047,119.06	0.00%	0.30%	✓	90.36	0.00%

EVOLUÇÃO GRÁFICA



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	860,173.99	56.44	42.02
Faixa 2	AA	654,381.84	42.94	31.97
Faixa 3	A	5,983.16	0.39	0.29
Faixa 4	BBB	3,530.47	0.23	0.17
Faixa 5	< BBB-	0.00	0.00	0.00
Sem Nota	-	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		1,524,069.46		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite PI	Status
Total Crédito Privado	74.45	80.00	✓
Grau Especulativo	0.07	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	1,486.92	BCO BONSUCESSO SA	Baa3.br	MOODY	HSBC FI REF DI CRED PRIV LP EXECUTIVO

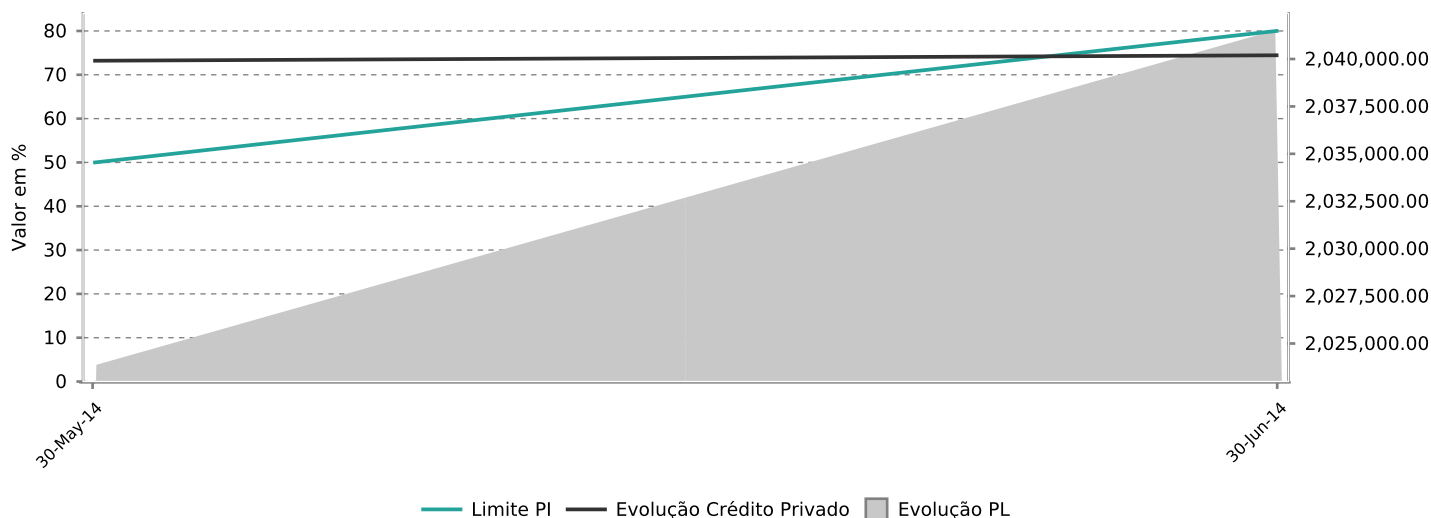
1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2014-06-30

30/06/2014

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Contraparte	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	307,439.48	15.02%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	248,301.62	12.13%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	212,013.35	10.36%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	188,873.19	9.23%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	178,932.08	8.74%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	73,508.10	3.59%	20.00%	✓
CAMARGO CORREA SA	50,653.86	2.47%	3.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	50,206.47	2.45%	20.00%	✓
BCO SAFRA SA	34,031.98	1.66%	20.00%	✓
BCO BTG PACTUAL SA	30,384.15	1.48%	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	0.41%	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*	0.41%	
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	33.87%	33.87%	-	-
7	0.00%	33.87%	-	-
21	0.01%	33.88%	-	-
Longo	66.12%	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 2014-06-30

30/06/2014

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
HSBC FI REF DI CRED PRIV LP EXECUTIVO	2,047,282.44	10,440,917,653.23	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.