

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

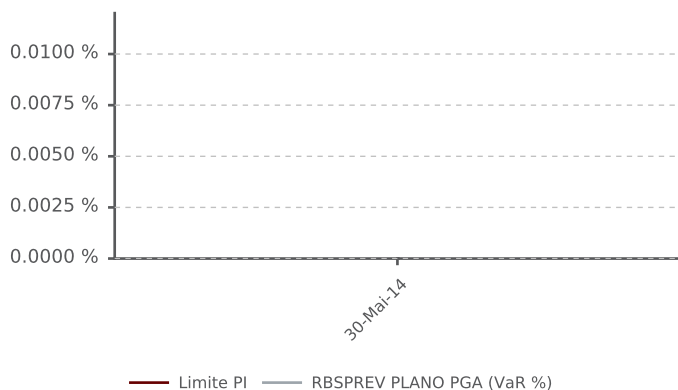
RBSPREV PLANO PGA 2014-05-30

30/05/2014

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	Var	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,023,875.98	2,030,006.45	0.01%	-	-	(147.87)	(0.01)%

EVOLUÇÃO GRÁFICA



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	846,100.40	56.94	41.68
Faixa 2	AA	629,799.69	42.38	31.02
Faixa 3	A	5,970.07	0.40	0.29
Faixa 4	BBB	4,198.30	0.28	0.21
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		1,486,068.45		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite PI	Status
Total Crédito Privado	73.21	50.00	✘
Grau Especulativo	0.11	5.00	✔

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

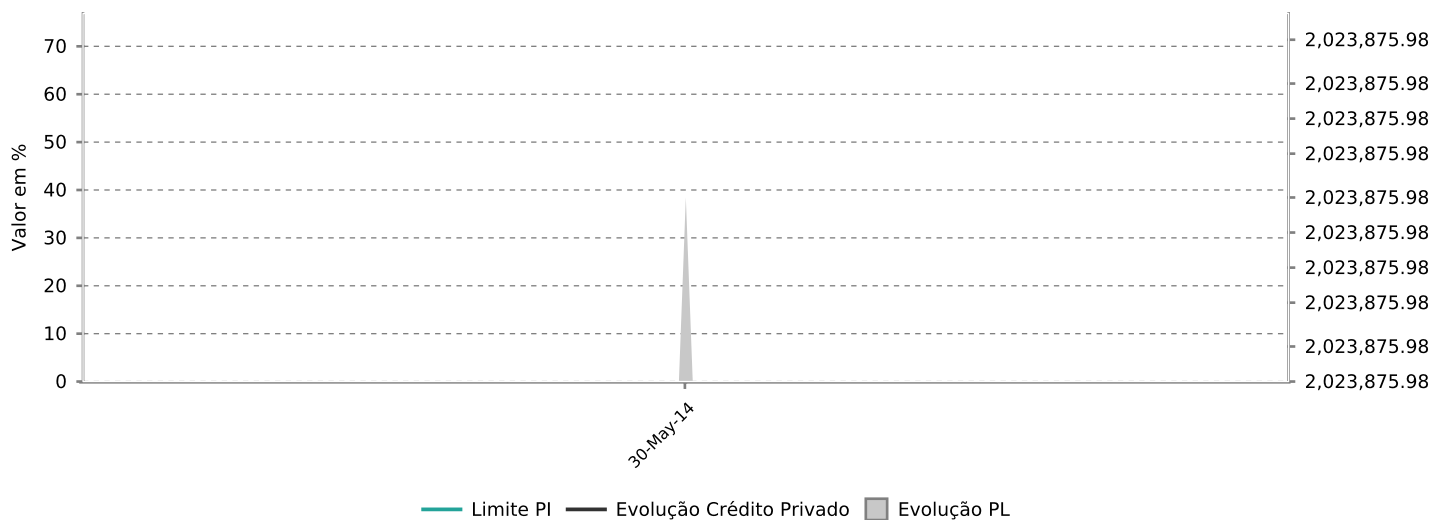
Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência
DPGE_cdi	773.03	BCO MERCANTIL BRASIL	brBBB	SP
DPGE_cdi	1,442.62	BCO BONSUCESSO SA	Baa3.br	MOODY

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO PGA 2014-05-30

30/05/2014

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Contraparte	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	303,756.71	14.96%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	243,615.78	12.00%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	212,826.55	10.48%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	183,361.24	9.03%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	173,745.23	8.56%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	72,388.63	3.57%	20.00%	✓
CAMARGO CORREA SA	50,690.52	2.50%	3.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	38,680.22	1.91%	20.00%	✓
BCO SAFRA SA	32,000.69	1.58%	20.00%	✓
BCO BTG PACTUAL SA	29,434.42	1.45%	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	0.40%	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* 0.40%

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	37.76%	37.76%	-	-
7	0.00%	37.76%	-	-
21	0.40%	38.16%	-	-
Longo	61.84%	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 2014-05-30

30/05/2014

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
HSBC FI REF DI CRED PRIV LP EXECUTIVO	2,030,046.67	10,571,552,975.70	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.