

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO PGA 2014-09-30

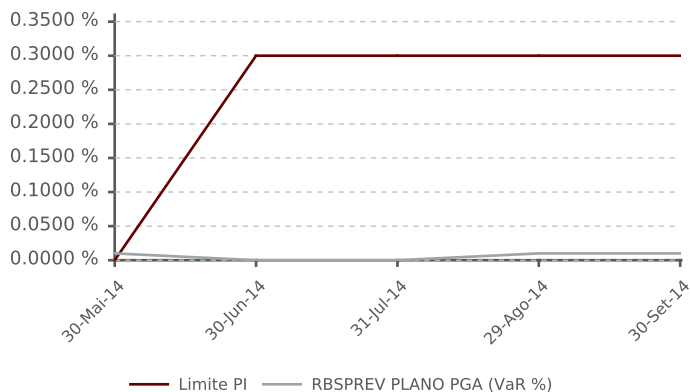
30/09/2014

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,149,162.34	2,155,143.05	0.01%	0.30%	✓	(709.05)	(0.03)%

* 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	965,100.39	63.78	44.78
Faixa 2	AA	543,417.45	35.91	25.21
Faixa 3	A	1,472.93	0.10	0.07
Faixa 4	BBB	0.00	0.00	0.00
Faixa 5	< BBB-	3,161.18	0.21	0.15
Sem Nota	-	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		1,513,151.95		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite PI	Status
Total Crédito Privado	70.21	80.00	✓
Grau Especulativo	0.07	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	1,566.03	BCO BONSUCESSO SA	Ba1.br	MOODY	HSBC FI REF DI CRED PRIV LP EXECUTIVO

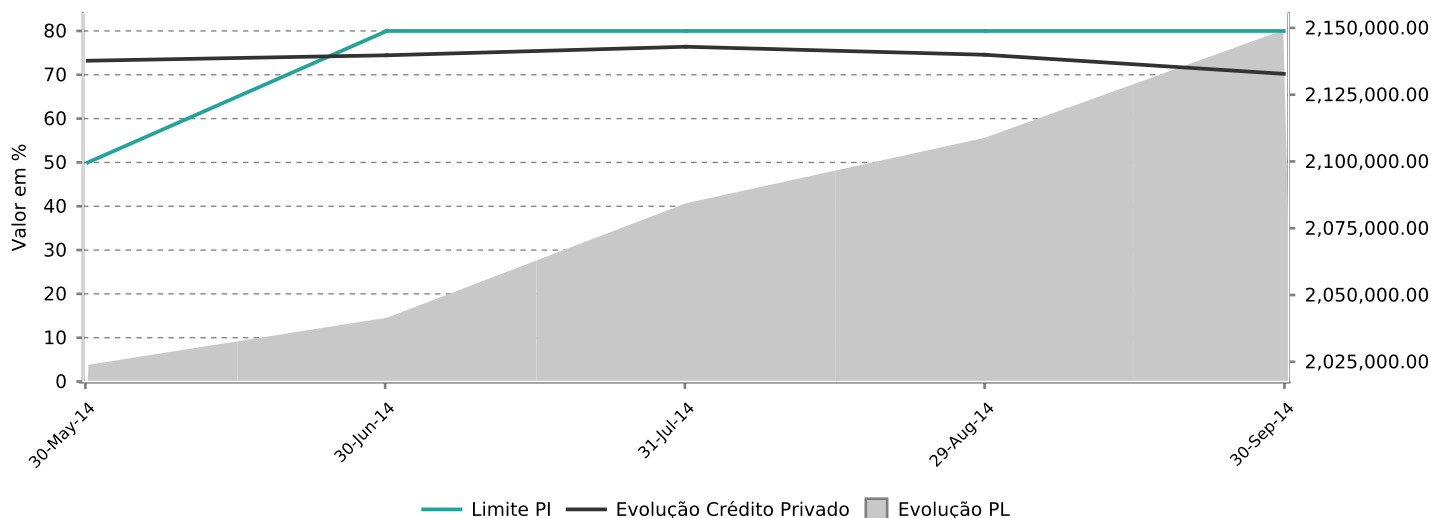
1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2014-09-30

30/09/2014

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Contraparte	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	323,283.95	15.00%	20.00%	✓
BCO BRADESCO SA	255,665.62	11.86%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	198,566.81	9.21%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	192,331.31	8.92%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	157,646.45	7.31%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	73,082.44	3.39%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	52,761.13	2.45%	20.00%	✓
CAMARGO CORREA SA	49,538.86	2.30%	10.00%	✓
BCO SAFRA SA	35,068.22	1.63%	20.00%	✓
BCO VOLKSWAGEN SA	26,049.32	1.21%	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	0.47%	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*	0.47%
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	37.44%	37.44%	-	-
7	0.58%	38.02%	-	-
21	4.76%	42.78%	-	-
Longo	57.22%	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 2014-09-30

30/09/2014

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
HSBC FI REF DI CRED PRIV LP EXECUTIVO	2,155,330.67	10,764,375,941.20	0.02%

ALOCAÇÃO 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.