

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2015-04-30

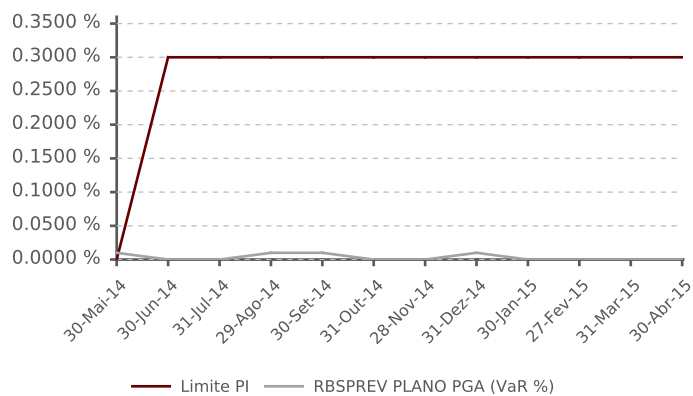
30/04/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,290,097.55	2,291,515.63	0.00%	0.30%	✓	2.68	0.00%

* 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	481,468.28	68.94	21.01
Faixa 2	AA	171,622.11	24.57	7.49
Faixa 3	A	0.00	0.00	0.00
Faixa 4	BBB	5,076.14	0.73	0.22
Faixa 5	< BBB-	30,548.78	4.37	1.33
Sem Nota	-	9,665.95	1.38	0.42
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		698,381.26		

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

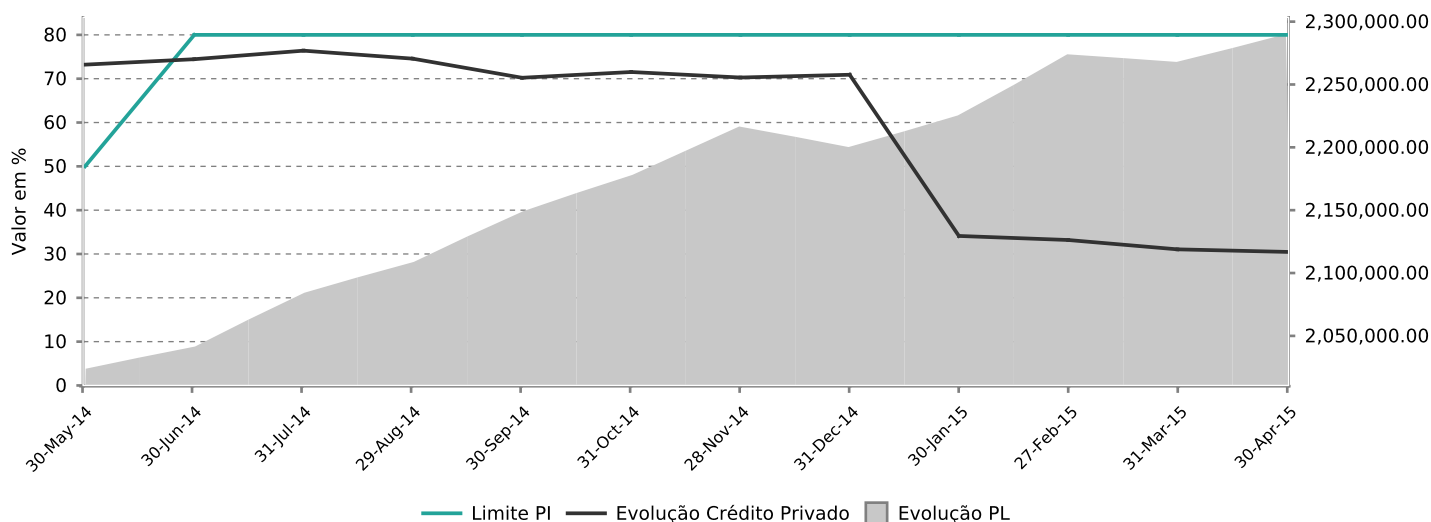
LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	30.48	80.00	✓
Grau Especulativo	1.75	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
GLEX13	9,665.95	VIA VAREJO SA	-	-	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI
DPGE_cdi	30,548.78	BCO FIBRA SA	brB	SP	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	252,796.23	11.03%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	126,076.31	5.50%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	78,360.76	3.42%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	54,210.45	2.37%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	37,941.07	1.66%	20.00%	✓

1. Este documento é de propriedade exclusiva da 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 2015-04-30

30/04/2015

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO VOTORANTIM SA	33,672.47	1.47%	20.00%	✓
BCO FIBRA SA	30,548.78	1.33%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	30,538.26	1.33%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	19,611.65	0.86%	20.00%	✓
ELETROPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	12,704.23	0.55%	10.00%	✓

DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO	0.00%	0.00%
CARTEIRA PROPRIA RBS PGA	0.00%	0.00%

Total do percentual de títulos depositados como margem de garantia* 0.00%

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	71.90%	71.90%	-	-
7	0.25%	72.15%	-	-
21	0.32%	72.47%	-	-
Longo	27.53%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	2,291,697.81	1,163,184,960.07	0.20%

ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	100.00%	100.00%	100.00%	✓

1. Este documento é de propriedade exclusiva da 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.