

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2015-08-31

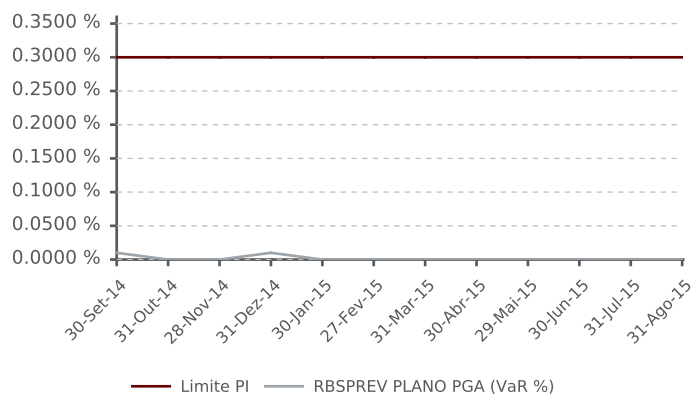
31/08/2015

## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,438,688.20	2,441,034.22	0.00%	0.30%	✓	1.01	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



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 2015-08-31

31/08/2015

## RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	890,071.56	100.00	36.46
Faixa 2	AA+	288,263.88	32.39	11.81
Faixa 3	A+	75,184.57	8.45	3.08
Faixa 4	BBB+	28,416.25	3.19	1.16
Faixa 5	< BBB-	22,743.60	2.56	0.93
Sem Nota	-	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
<b>Total</b>		<b>890,071.56</b>		

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

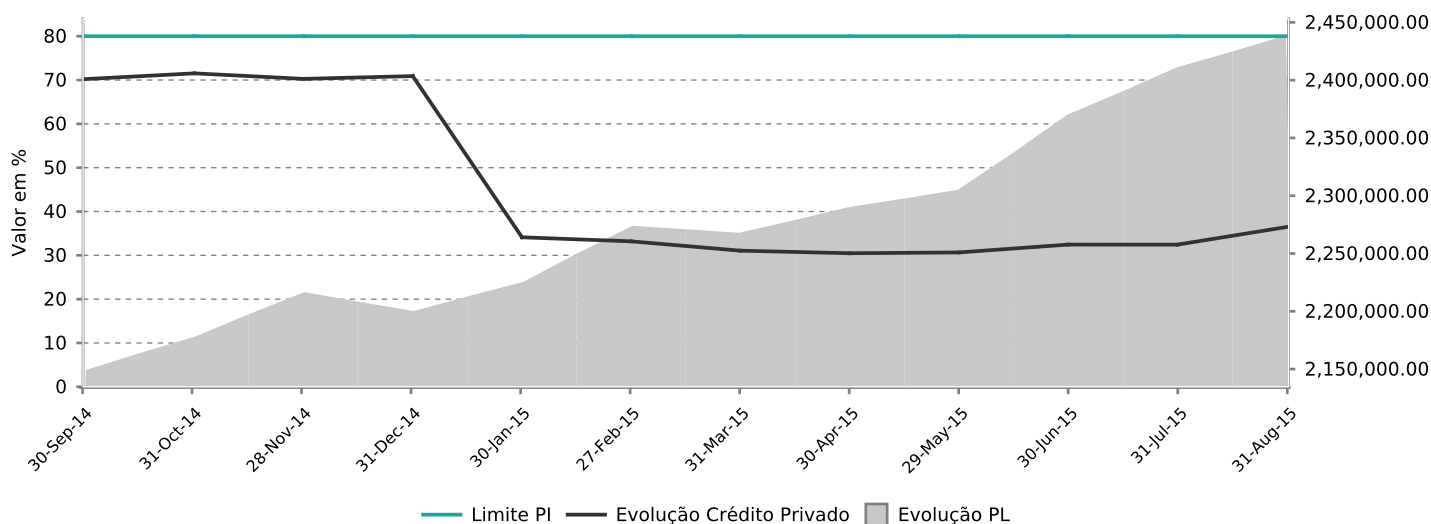
## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	36.46	80.00	✓
Grau Especulativo	0.93	5.00	✓

## ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	22,743.60	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	327,205.17	13.40%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	163,486.07	6.70%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	89,969.25	3.69%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	85,731.47	3.51%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	63,529.65	2.60%	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 2015-08-31

31/08/2015

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	60,468.31	2.48%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	34,132.27	1.40%	20.00%	✓
BCO FIBRA SA	22,743.60	0.93%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	21,949.83	0.90%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	7,163.73	0.29%	10.00%	✓

## DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO	0.00%	0.00%
RBSPREV PLANO PGA	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	66.52%	66.52%	-	-
7	0.00%	66.52%	-	-
21	0.93%	67.45%	-	-
Longo	32.55%	100.00%	-	-

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	2,441,238.12	1,162,737,538.72	0.21%

## 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.