

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2015-12-31

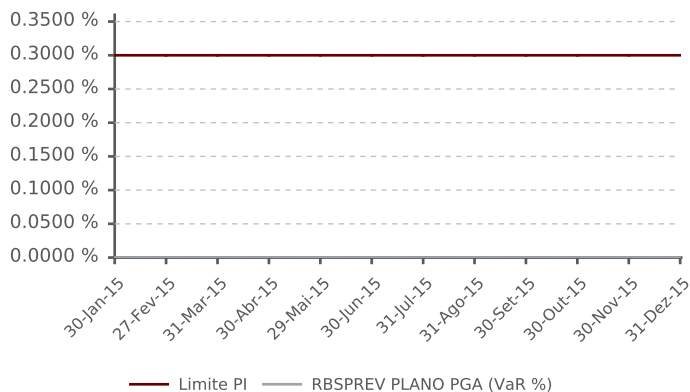
31/12/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	1,994,188.72	1,995,866.76	0.00%	0.30%	✓	0.21	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 Acum.	% Total Acum.
Faixa 1	<= AAA	601,628.47	100.00	30.14
Faixa 2	<= AA+	516,645.23	85.87	25.89
Faixa 3	<= A+	4,874.25	0.81	0.24
Faixa 4	<= BBB+	0.00	0.00	0.00
Faixa 5	<= BB+	0.00	0.00	0.00
-	Sem Nota	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00

Total Crédito Privado 601,628.47

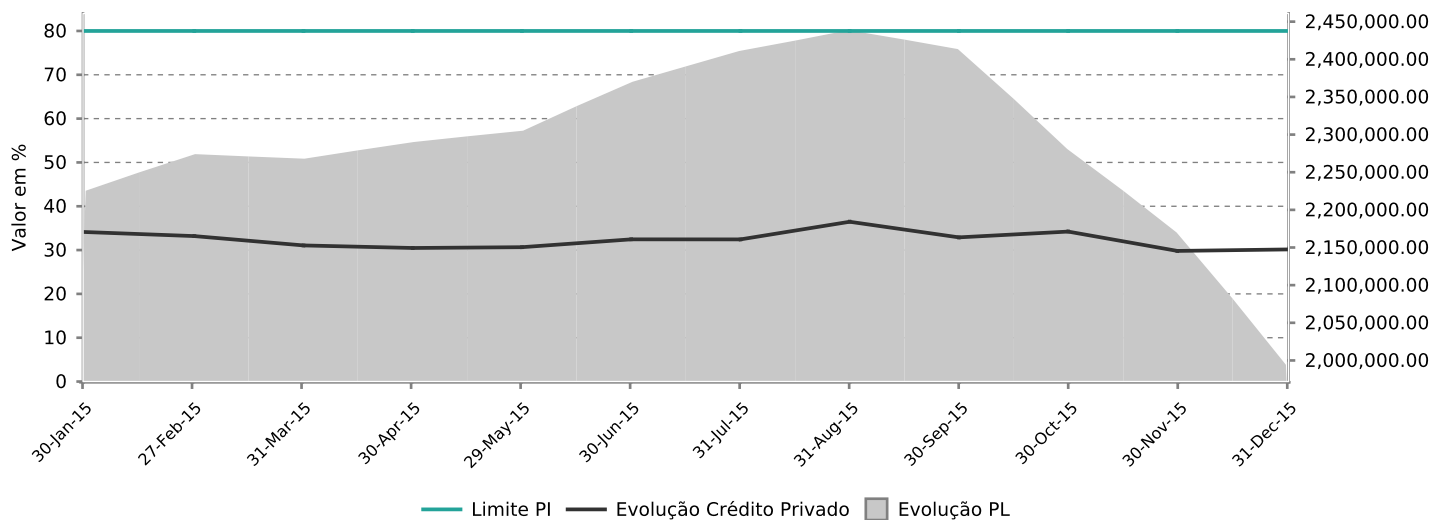
*Contempla o financeiro dos Swaps intermediados pela BM&FBovespa e/ou com garantia.

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	30.14	80.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓



EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	205,048.61	10.27%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	125,051.74	6.27%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	91,002.95	4.56%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	69,192.27	3.47%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	45,532.16	2.28%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	43,333.42	2.17%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	15,790.97	0.79%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	4,874.25	0.24%	10.00%	✓
BCO SAFRA SA	1,526.97	0.08%	20.00%	✓
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	275.14	0.01%	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	70.17%	70.17%	-	-
7	0.00%	70.17%	-	-
21	0.49%	70.66%	-	-
Longo	29.34%	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.



CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	1,996,048.08	1,390,085,698.21	0.14%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

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