

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO PGA 2015-02-27

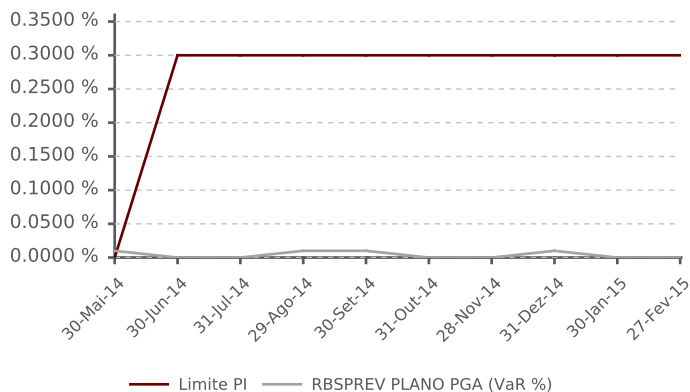
27/02/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,274,020.01	2,276,070.85	0.00%	0.30%	✓	0.04	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	562,708.36	74.48	24.72
Faixa 2	AA	143,173.84	18.95	6.29
Faixa 3	A	0.00	0.00	0.00
Faixa 4	BBB	6,210.19	0.82	0.27
Faixa 5	< BBB-	37,383.81	4.95	1.64
Sem Nota	-	6,038.80	0.80	0.27
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		755,514.99		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	33.19	80.00	✓
Grau Especulativo	2.18	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	6,210.19	BCO BMG SA	RETIRADO	SP	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI
DPGE_cdi	37,383.81	BCO FIBRA SA	brB	SP	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI
GLEX13	6,038.80	VIA VAREJO SA	-	-	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI

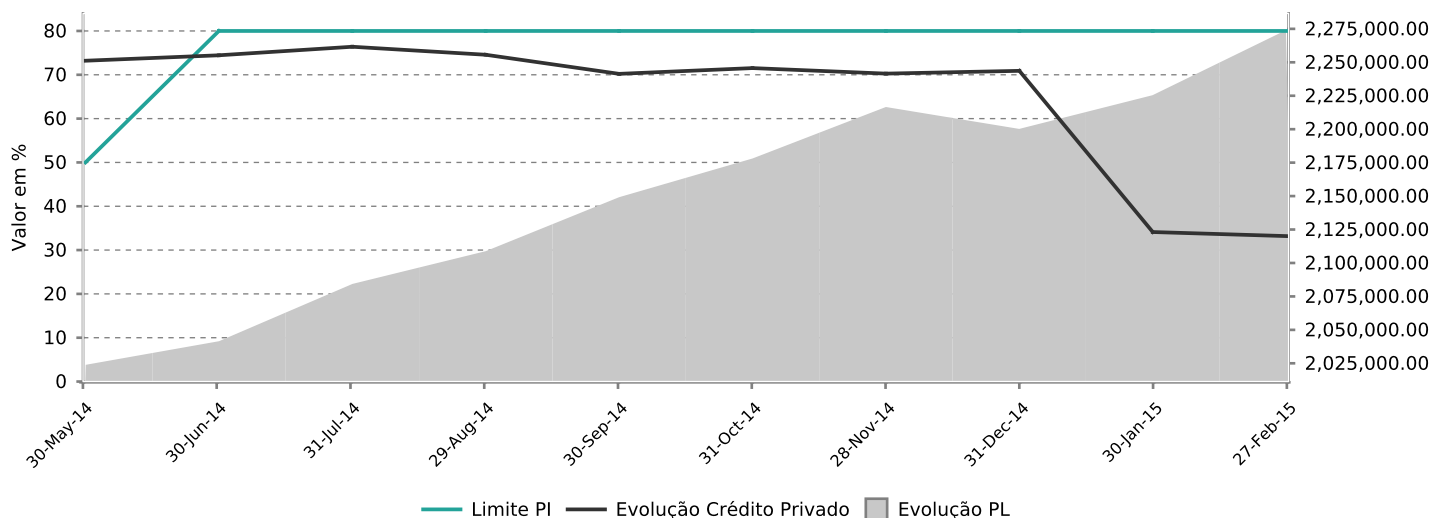
1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2015-02-27

27/02/2015

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	284,393.61	12.49%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	137,901.82	6.06%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	82,324.31	3.62%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	56,820.42	2.50%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	40,449.71	1.78%	20.00%	✓
BCO FIBRA SA	37,383.81	1.64%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	37,355.96	1.64%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	36,744.82	1.61%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	13,830.70	0.61%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	10,700.55	0.47%	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	69.08%	69.08%	-	-
7	0.00%	69.08%	-	-
21	0.00%	69.08%	-	-
Longo	30.92%	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 2015-02-27

27/02/2015

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	2,276,232.87	924,104,806.67	0.25%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total Inf.	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	100.00%	100.00%	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.
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.