

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO PGA 2015-01-30

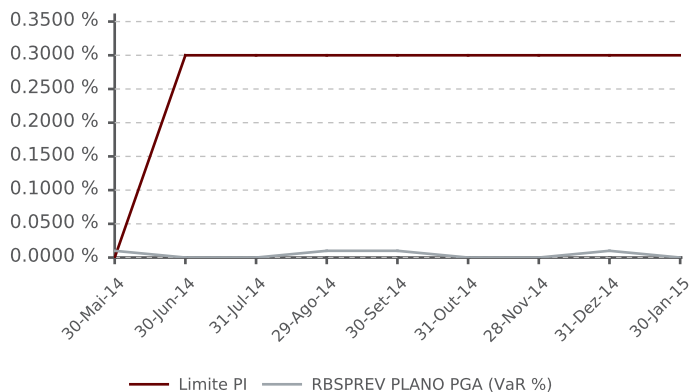
30/01/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,225,411.86	2,227,341.61	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	563,050.00	74.08	25.28
Faixa 2	AA	147,307.79	19.38	6.61
Faixa 3	A	0.00	0.00	0.00
Faixa 4	BBB	6,213.03	0.82	0.28
Faixa 5	< BBB-	37,404.32	4.92	1.68
Sem Nota	-	6,042.12	0.79	0.27
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		760,017.26		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	34.12	80.00	✓
Grau Especulativo	2.23	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
GLEX13	6,042.12	VIA VAREJO SA	-	-	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI
DPGE_cdi	37,404.32	BCO FIBRA SA	brB	SP	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI
DPGE_cdi	6,213.03	BCO BMG SA	RETIRADO	SP	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI

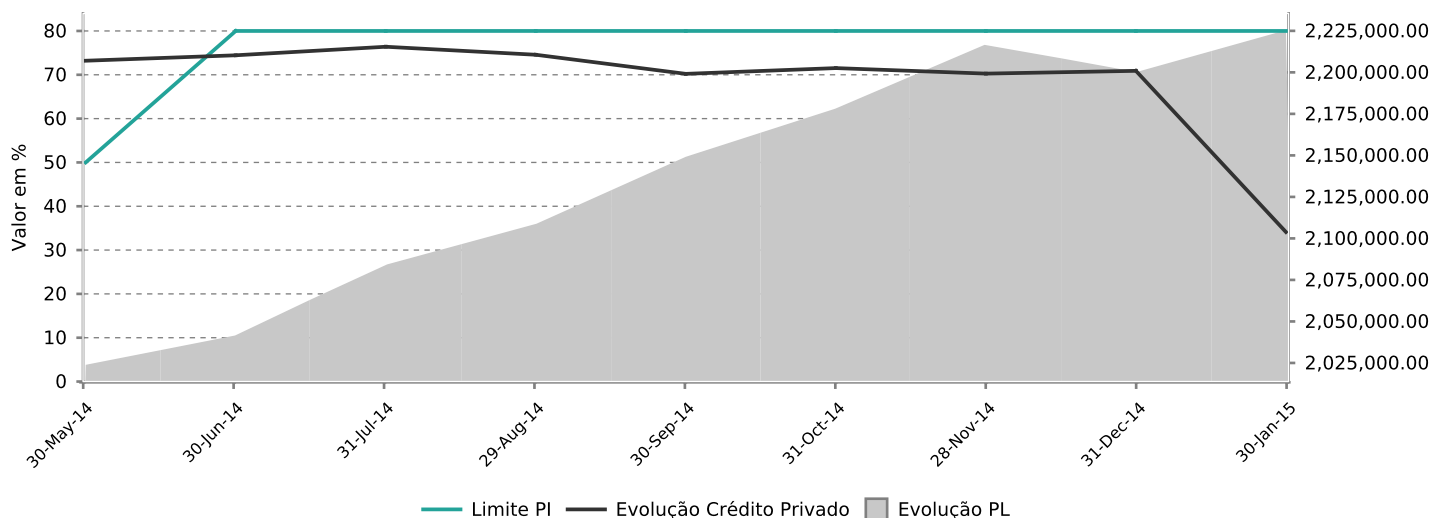
1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2015-01-30

30/01/2015

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	288,576.44	12.96%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	137,995.25	6.20%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	82,364.94	3.70%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	56,855.30	2.55%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	40,458.23	1.82%	20.00%	✓
BCO FIBRA SA	37,404.32	1.68%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	37,370.65	1.68%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	36,756.28	1.65%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	13,831.39	0.62%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	10,790.44	0.48%	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	68.38%	68.38%	-	-
7	0.00%	68.38%	-	-
21	0.00%	68.38%	-	-
Longo	31.62%	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 2015-01-30

30/01/2015

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	2,227,526.33	895,859,284.71	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.