

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2015-07-31

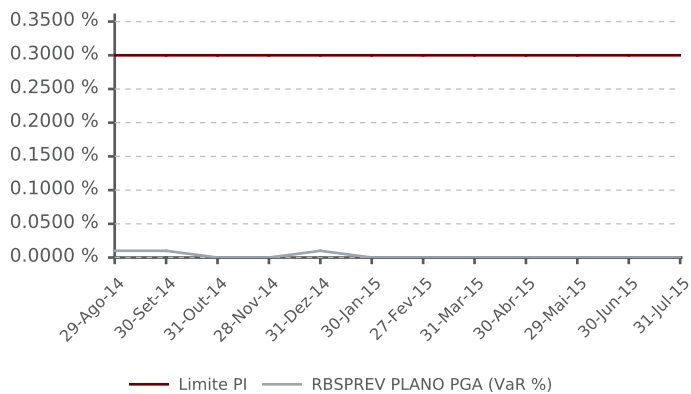
31/07/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,410,985.96	2,412,734.22	0.00%	0.30%	✓	4.18	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



Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2015-07-31

31/07/2015

RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	782,757.89	100.00	32.44
Faixa 2	AA+	279,695.45	35.73	11.59
Faixa 3	A+	78,942.92	10.09	3.27
Faixa 4	BBB+	35,856.26	4.58	1.49
Faixa 5	< BBB-	30,744.64	3.93	1.27
Sem Nota	-	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		782,757.89		

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

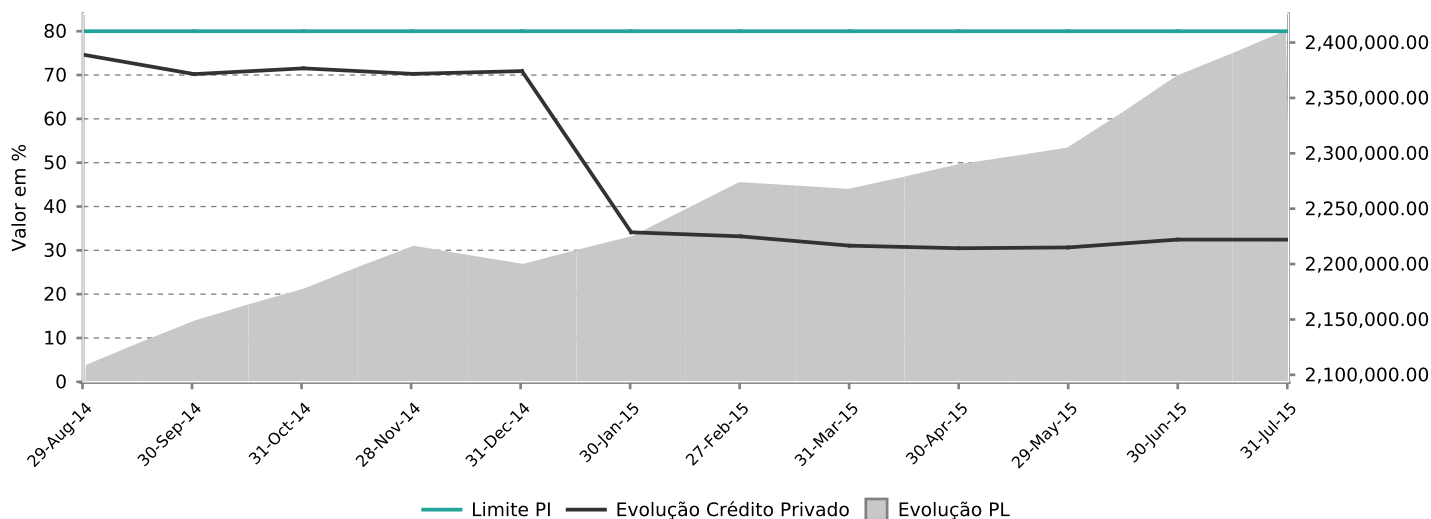
LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	32.44	80.00	✓
Grau Especulativo	1.27	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	30,744.64	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	294,778.83	12.22%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	147,034.13	6.09%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	81,098.73	3.36%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	65,914.49	2.73%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	54,513.25	2.26%	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 2015-07-31

31/07/2015

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
ITAUSA INVESTS ITAU SA	38,434.88	1.59%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	30,755.65	1.27%	20.00%	✓
BCO FIBRA SA	30,744.64	1.27%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	19,761.90	0.82%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	7,401.70	0.31%	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	69.77%	69.77%	-	-
7	0.00%	69.77%	-	-
21	1.15%	70.92%	-	-
Longo	29.08%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	2,412,953.56	1,259,989,034.68	0.19%

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.