

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2015-06-30

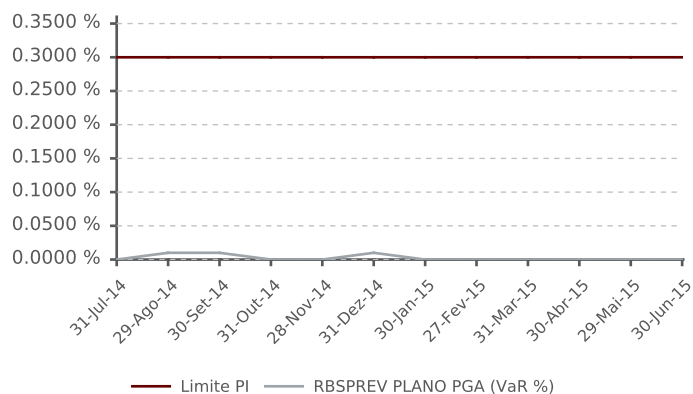
30/06/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,370,105.22	2,371,540.01	0.00%	0.30%	✓	5.03	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 2015-06-30

30/06/2015

RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	536,636.32	69.72	22.63
Faixa 2	AA	176,538.91	22.94	7.44
Faixa 3	A	12,435.64	1.62	0.52
Faixa 4	BBB	4,940.61	0.64	0.21
Faixa 5	< BBB-	29,722.67	3.86	1.25
Sem Nota	-	9,403.52	1.22	0.40
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		769,677.66		

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

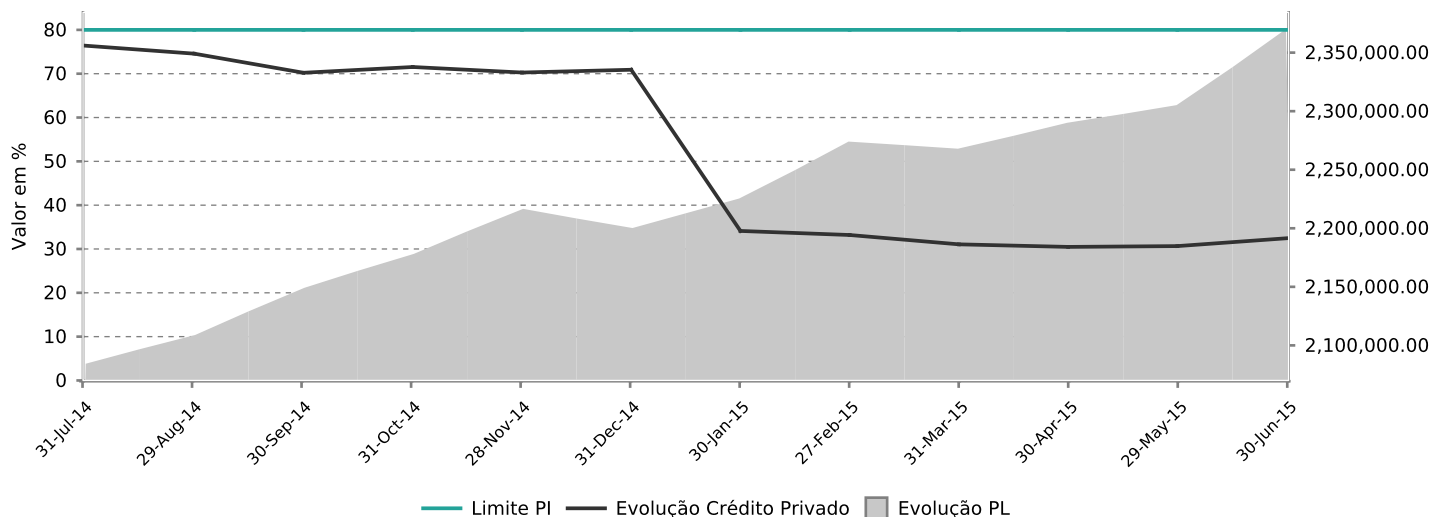
LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	32.45	80.00	✓
Grau Especulativo	1.65	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	29,722.67	BCO FIBRA SA	brB	SP	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI
GLEX13	9,403.52	VIA VAREJO SA	-	-	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	285,035.18	12.02%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	142,145.11	5.99%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	76,186.02	3.21%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	64,353.17	2.71%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	52,723.64	2.22%	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 2015-06-30

30/06/2015

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
ITAUSA INVESTS ITAU SA	36,934.34	1.56%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	29,725.59	1.25%	20.00%	✓
BCO FIBRA SA	29,722.67	1.25%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	19,096.86	0.81%	20.00%	✓
ELETROPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	12,435.64	0.52%	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	70.57%	70.57%	-	-
7	0.00%	70.57%	-	-
21	0.00%	70.57%	-	-
Longo	29.43%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	2,371,738.27	1,264,922,118.30	0.19%

ALOCAÇÃO 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.