

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2015-05-29

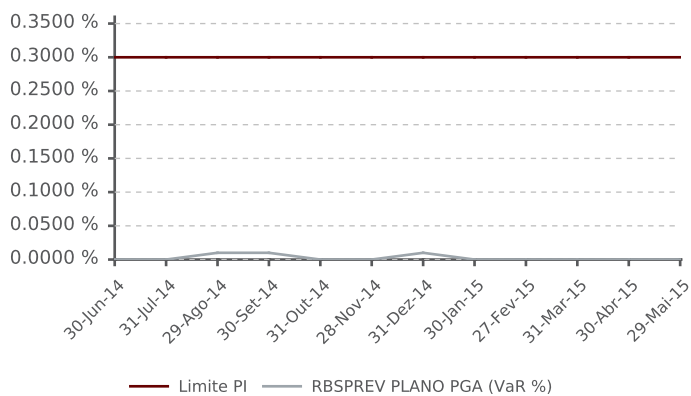
29/05/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,305,163.52	2,306,557.36	0.00%	0.30%	✓	1.15	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	503,517.21	71.21	21.83
Faixa 2	AA	161,001.39	22.77	6.98
Faixa 3	A	0.00	0.00	0.00
Faixa 4	BBB	4,767.85	0.67	0.21
Faixa 5	< BBB-	28,688.76	4.06	1.24
Sem Nota	-	9,077.04	1.28	0.39
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		707,052.24		

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

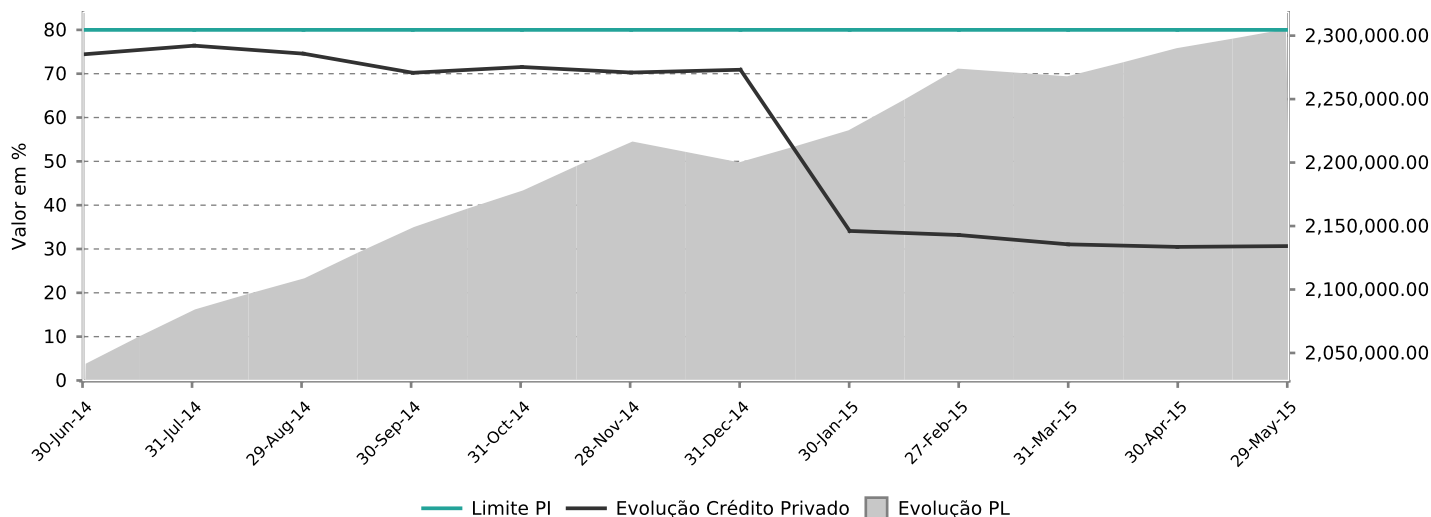
LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	30.65	80.00	✓
Grau Especulativo	1.64	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
GLEX13	9,077.04	VIA VAREJO SA	-	-	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI
DPGE_cdi	28,688.76	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	275,534.92	11.95%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	126,236.02	5.47%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	73,540.97	3.19%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	50,897.87	2.21%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	36,864.59	1.60%	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 2015-05-29

29/05/2015

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
ITAUSA INVESTS ITAU SA	35,671.69	1.55%	20.00%	✓
BCO FIBRA SA	28,688.76	1.24%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	28,684.87	1.24%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	18,421.80	0.80%	20.00%	✓
ELETROPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	11,973.09	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	71.80%	71.80%	-	-
7	0.00%	71.80%	-	-
21	0.44%	72.24%	-	-
Longo	27.76%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	2,306,742.00	1,260,043,567.28	0.18%

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.