

Mapa Simplificado de Controle de Riscos

RBSPREV PLANO PGA 2015-03-31

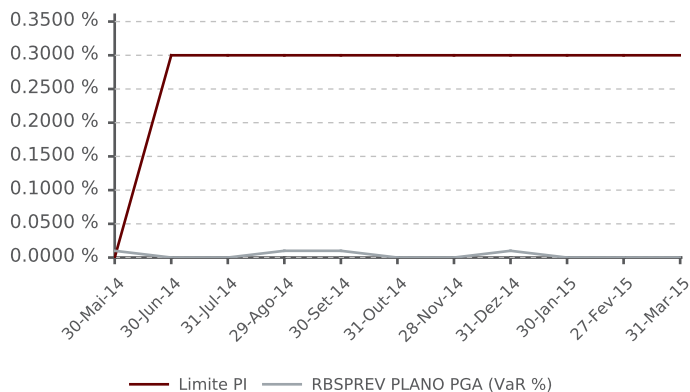
31/03/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,267,943.75	2,269,539.15	0.00%	0.30%	✓	0.03	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



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	525,058.85	74.48	23.14
Faixa 2	AA	133,502.40	18.94	5.88
Faixa 3	A	0.00	0.00	0.00
Faixa 4	BBB	5,801.62	0.82	0.26
Faixa 5	< BBB-	34,920.04	4.95	1.54
Sem Nota	-	5,640.61	0.80	0.25
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		704,923.52		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	31.06	80.00	✓
Grau Especulativo	1.79	5.00	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	34,920.04	BCO FIBRA SA	brB	SP	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI
GLEX13	5,640.61	VIA VAREJO SA	-	-	ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI

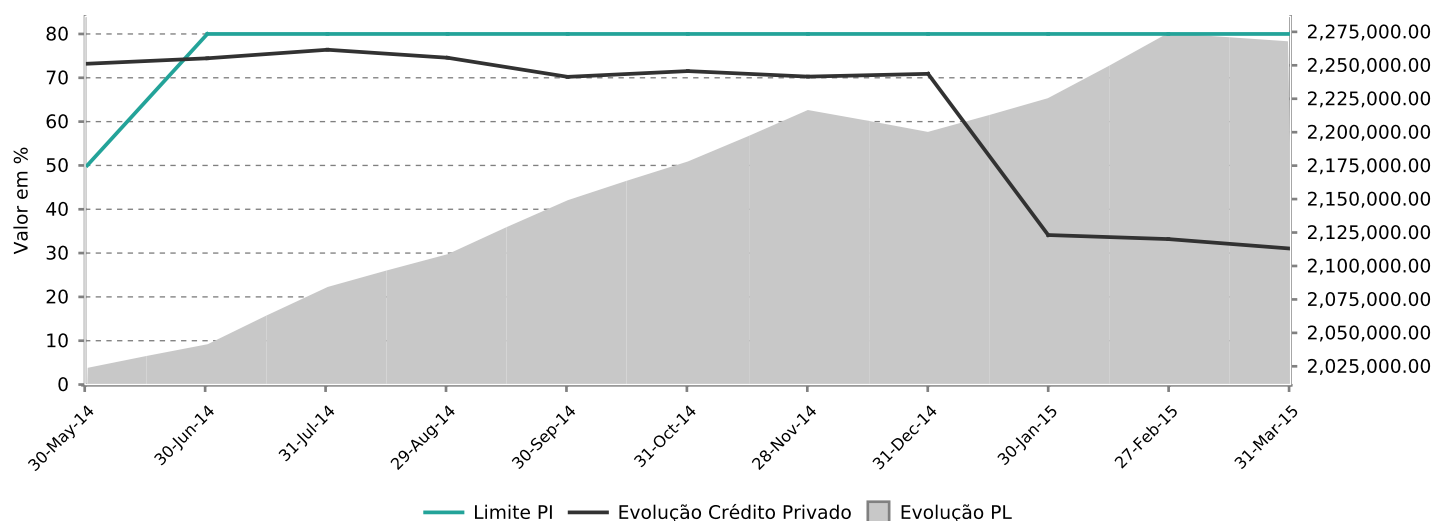
1. Este documento é de propriedade exclusiva do Risk Office e somente pode ser reproduzido mediante sua expressa autorização;
2. Este documento tem caráter meramente informativo, cabendo única e exclusivamente ao usuário a responsabilidade por eventuais prejuízos decorrentes da utilização que faça ou 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 2015-03-31

31/03/2015

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	265,563.67	11.70%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	128,578.16	5.67%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	76,878.29	3.39%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	53,072.21	2.34%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	37,765.99	1.66%	20.00%	✓
BCO FIBRA SA	34,920.04	1.54%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	34,900.99	1.54%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	34,051.78	1.50%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	12,928.54	0.57%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	10,013.72	0.44%	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	71.06%	71.06%	-	-
7	0.00%	71.06%	-	-
21	0.74%	71.79%	-	-
Longo	28.21%	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 2015-03-31

31/03/2015

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	2,269,738.09	997,587,034.91	0.23%

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.