

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR VITALICIO 2015-11-30

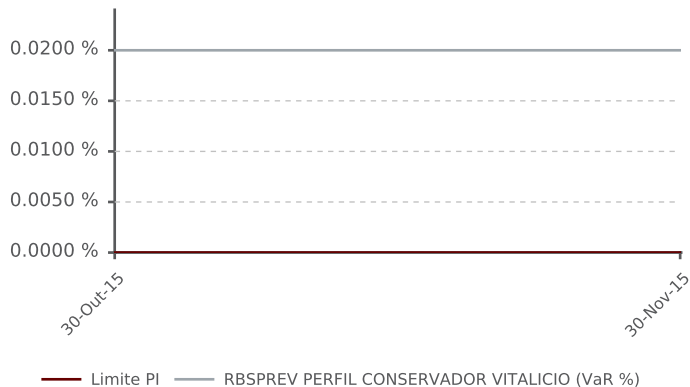
30/11/2015

## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PERFIL CONSERVADOR VITALICIO	-	5,731,734.94	5,736,545.93	0.02%	-	-	0.00	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 Acum.	% Total Acum.
Faixa 1	<= AAA	36,125.12	100.00	0.63
Faixa 2	<= AA+	36,125.12	100.00	0.63
Faixa 3	<= A+	0.00	0.00	0.00
Faixa 4	<= BBB+	0.00	0.00	0.00
Faixa 5	<= BB+	0.00	0.00	0.00
-	Sem Nota	0.00	0.00	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00

**Total Crédito Privado 36,125.12**

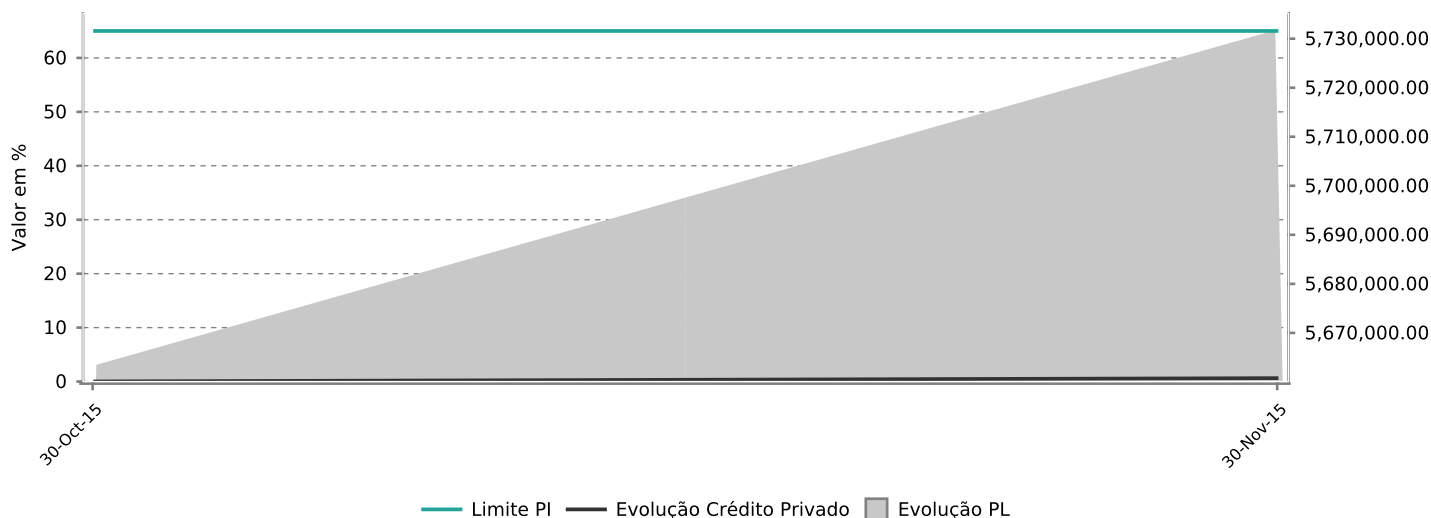
\*Contempla o financeiro dos Swaps intermediados pela BM&FBovespa e/ou com garantia.

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	0.63	65.00	✓
Grau Especulativo	0.00	6.00	✓



## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	36,125.12	0.63%	20.00%	✓

## DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
RBSPREV PERFIL CONSERVADOR	0.00%	0.00%
CARTEIRA RBS PREV ALM	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	16.57%	16.57%	10.00%	✓
21	0.00%	16.57%	20.00%	✗
Longo	83.43%	100.00%	-	-

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

## 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.