

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2015-10-30

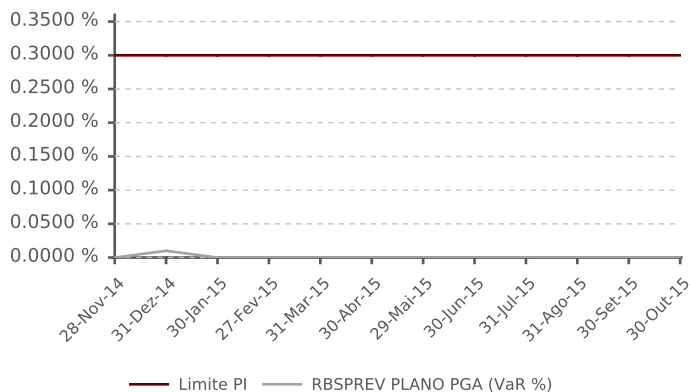
30/10/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,280,807.41	2,282,929.39	0.00%	0.30%	✓	1.63	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	781,176.86	100.00	34.22
Faixa 2	<= AA+	682,287.78	87.34	29.89
Faixa 3	<= A+	21,053.09	2.70	0.92
Faixa 4	<= BBB+	5,011.45	0.64	0.22
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 781,176.86

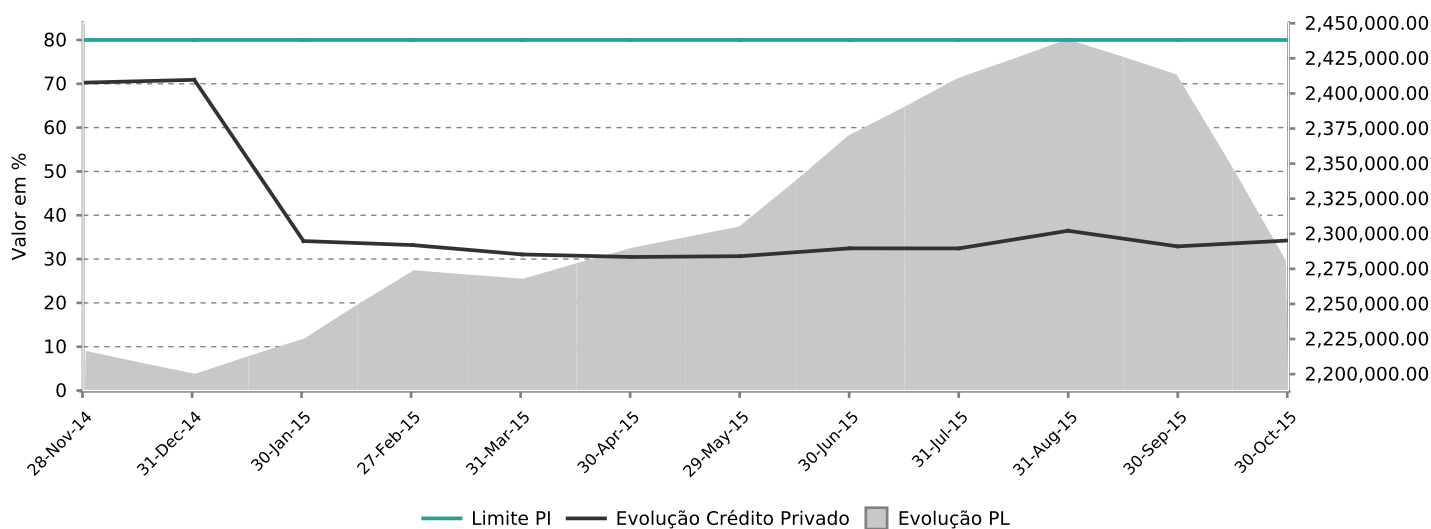
*Contempla o financeiro dos Swaps intermediados pela BM&FBovespa e/ou com garantia.

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	34.22	80.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓



EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	288,977.49	12.66%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	148,315.18	6.50%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	112,192.07	4.91%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	79,464.55	3.48%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	56,104.07	2.46%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	53,422.13	2.34%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	19,424.53	0.85%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	10,058.66	0.44%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	5,982.98	0.26%	10.00%	✓
BCO BMG SA	5,011.45	0.22%	20.00%	✓

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	67.71%	67.71%	-	-
7	0.39%	68.10%	-	-
21	0.44%	68.54%	-	-
Longo	31.46%	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.

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2015-10-30

30/10/2015

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	2,283,111.32	1,260,425,360.48	0.18%

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.