

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2015-09-30

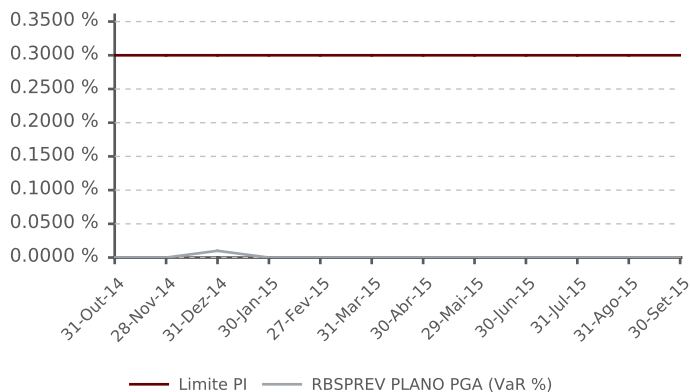
30/09/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
PREV PLANO PGA	-	2,413,528.10	2,415,946.01	0.00%	0.30%	✓	2.73	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	794,757.70	100.00	32.90
Faixa 2	<= AA+	685,882.19	86.30	28.39
Faixa 3	<= A+	45,684.71	5.75	1.89
Faixa 4	<= BBB+	5,512.47	0.69	0.23
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 794,757.70

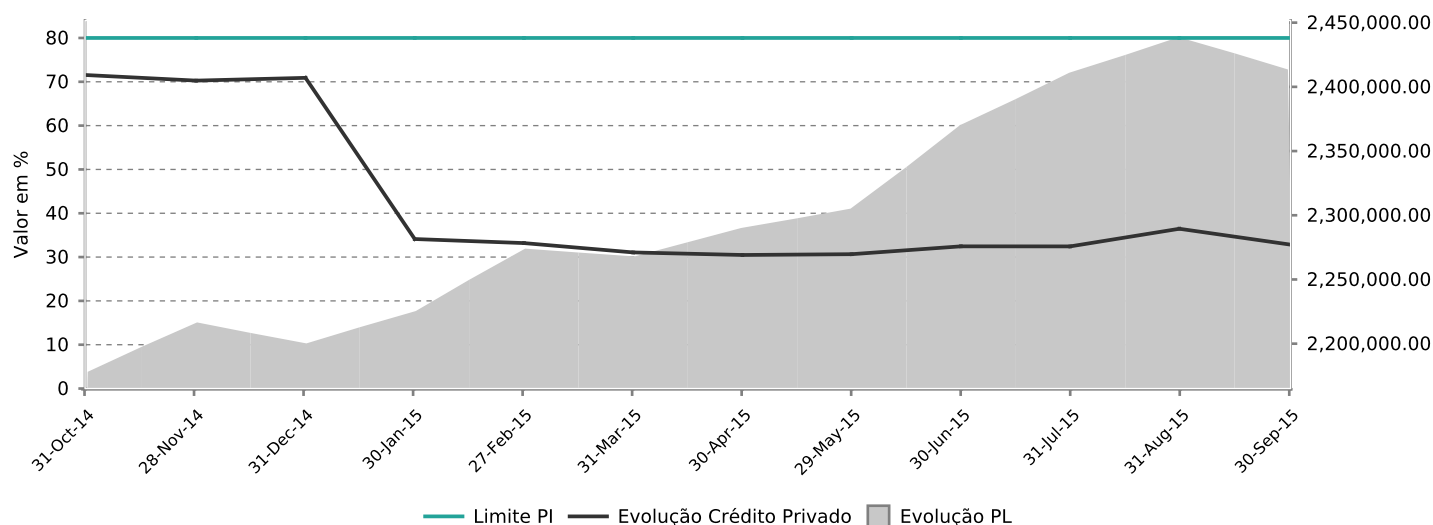
*Contempla o financeiro dos Swaps intermediados pela BM&FBovespa e/ou com garantia.

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	32.90	80.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓



EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	318,192.92	13.17%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	159,069.32	6.58%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	87,507.94	3.62%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	61,773.49	2.56%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	58,820.28	2.43%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	39,864.75	1.65%	20.00%	✓
BCO INDL COML SA BICBANCO	33,196.49	1.37%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	21,367.57	0.88%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	6,975.75	0.29%	10.00%	✓
BCO BMG SA	5,512.47	0.23%	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	67.48%	67.48%	-	-
7	0.00%	67.48%	-	-
21	0.92%	68.39%	-	-
Longo	31.61%	100.00%	-	-



CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI FI	2,416,149.81	1,197,504,536.23	0.20%

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	100.00%	100.00%	100.00%	✓