

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2016-02-29

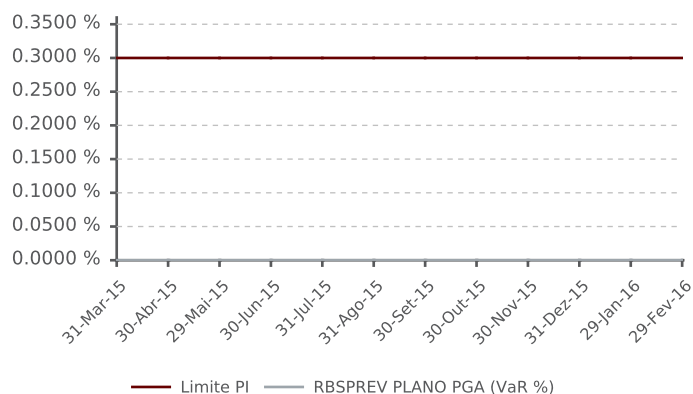
29/02/2016

RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PLANO PGA	1,860,691.58	1,861,893.71	0.00%	0.30%	✓	-	-	-	-	0.00%

* VaR Rel. representa o % de valor em risco (VaR), em relação ao risco da carteira teórica (IBOVESPA, IBX, IBX50 e outros).

EVOLUÇÃO GRÁFICA





RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	569,814.58	100.00	30.60	80.00	✓
2 - Faixa AA+	534,163.60	93.74	28.69	50.00	✓
3 - Faixa A+	4,319.85	0.76	0.23	30.00	✓
4 - Faixa BBB+	0.00	0.00	0.00	10.00	✓
5 - Faixa BB-	0.00	0.00	0.00	5.00	✓
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00	

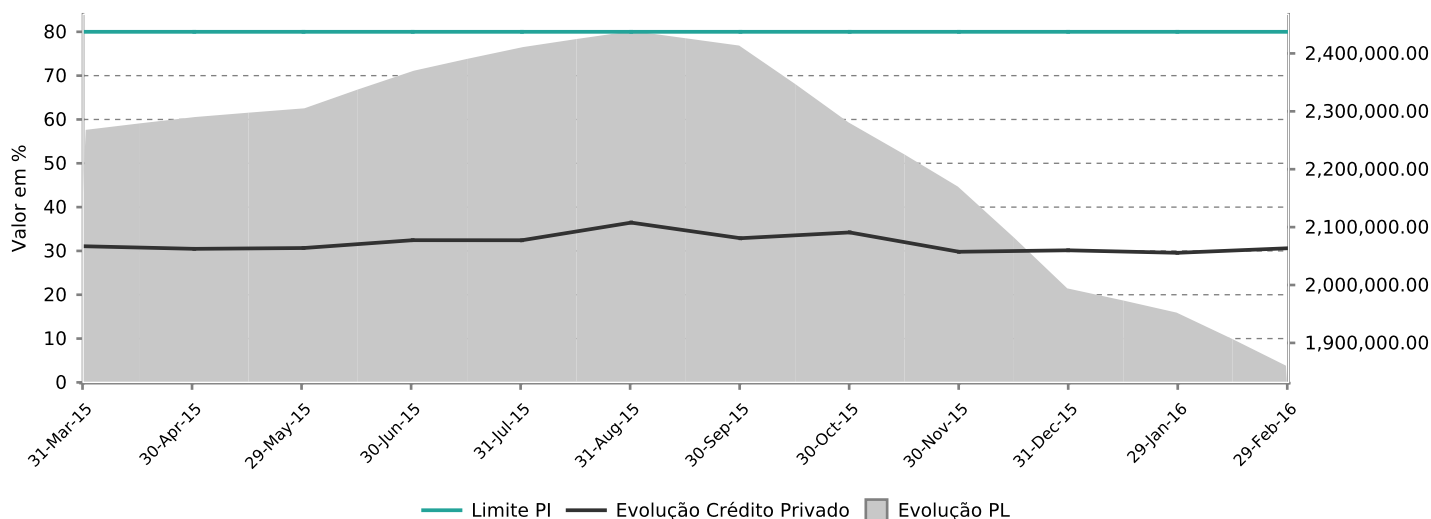
Total Crédito Privado 569,814.58

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	30.60	80.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	180,324.10	9.68%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	112,471.09	6.04%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	77,078.97	4.14%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	71,491.18	3.84%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	67,334.28	3.62%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	40,957.65	2.20%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	14,216.07	0.76%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	4,319.85	0.23%	10.00%	✓
BCO SAFRA SA	1,373.88	0.07%	20.00%	✓
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	247.51	0.01%	10.00%	✓

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 2016-02-29

29/02/2016

DERIVATIVOS

Ativos de Origem	% Títulos depositados como margem de garantia*	% Gasto com compra de opções*
ITAU INSTITUCIONAL RF	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	71.21%	71.21%	-	-
7	0.00%	71.21%	-	-
21	0.00%	71.21%	-	-
Longo	28.79%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI FI	1,862,027.84	1,473,147,853.29	0.13%

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.