

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PERFIL CONSERVADOR VITALICIO 2016-01-29

29/01/2016

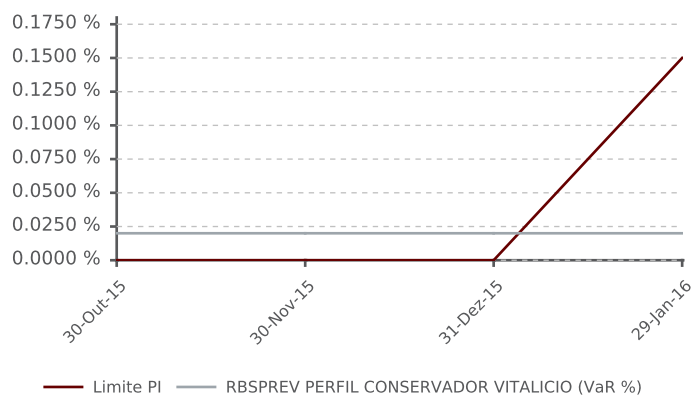
## RISCO DE MERCADO

### VAR

Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PERFIL CONSERVADOR VITALICIO	5,789,860.30	5,792,568.30	0.02%	0.15%	✓	-	-	-	-	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	4,711.18	100.00	0.08	50.00	✓
2 - Faixa AA+	4,711.18	100.00	0.08	40.00	✓
3 - Faixa A+	0.00	0.00	0.00	20.00	✓
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	

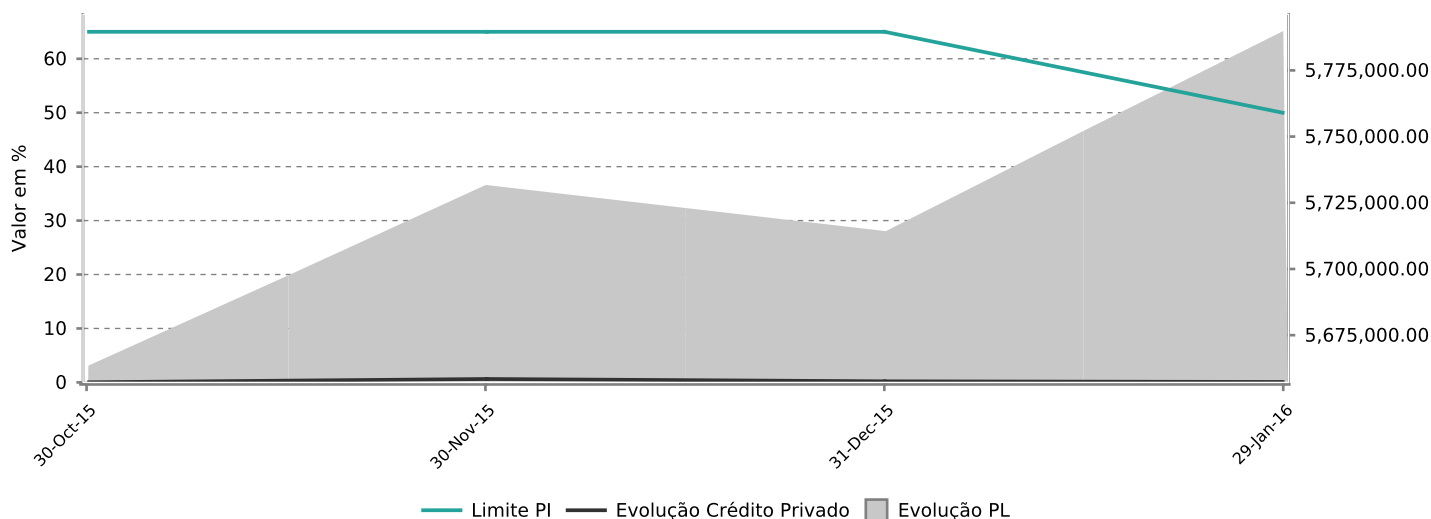
**Total Crédito Privado 4,711.18**

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

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	0.08	50.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	4,711.18	0.08%	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	14.66%	14.66%	10.00%	✓
21	0.00%	14.66%	20.00%	✗
252	13.78%	28.44%	50.00%	✗
Longo	71.56%	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%	✓