

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2016-01-29

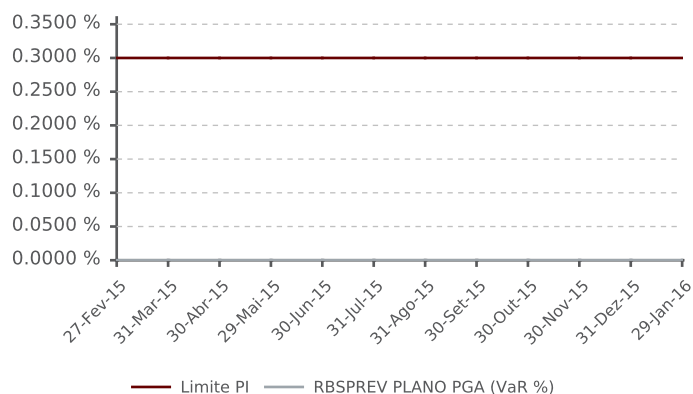
29/01/2016

RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PLANO PGA	1,952,311.62	1,953,834.33	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



Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2016-01-29

29/01/2016

RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	577,705.36	100.00	29.57	80.00	✓
2 - Faixa AA+	486,315.74	84.18	24.89	50.00	✓
3 - Faixa A+	4,676.12	0.81	0.24	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	

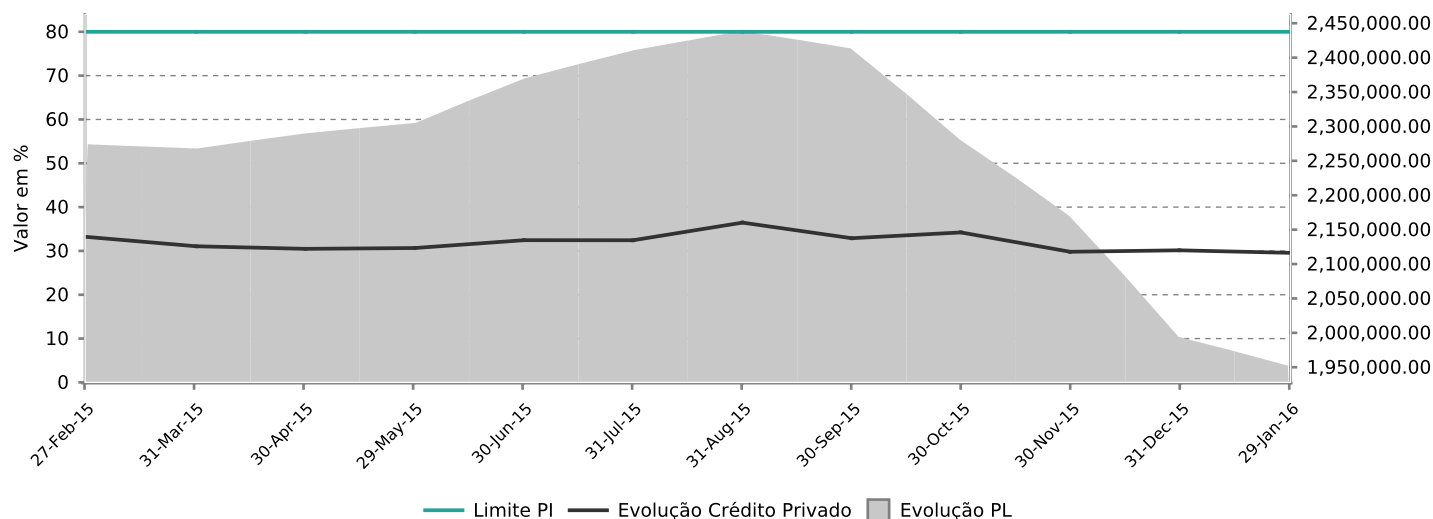
Total Crédito Privado 577,705.36

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	29.57	80.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	192,494.38	9.85%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	119,966.41	6.14%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	82,207.05	4.21%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	76,235.63	3.90%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	43,679.86	2.24%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	41,562.33	2.13%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	15,153.98	0.78%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	4,676.12	0.24%	10.00%	✓
BCO SAFRA SA	1,465.63	0.08%	20.00%	✓
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	263.97	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 2016-01-29

29/01/2016

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	70.74%	70.74%	-	-
7	0.00%	70.74%	-	-
21	0.00%	70.74%	-	-
Longo	29.26%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI FI	1,953,990.29	1,434,267,735.96	0.14%

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.