

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2016-05-31

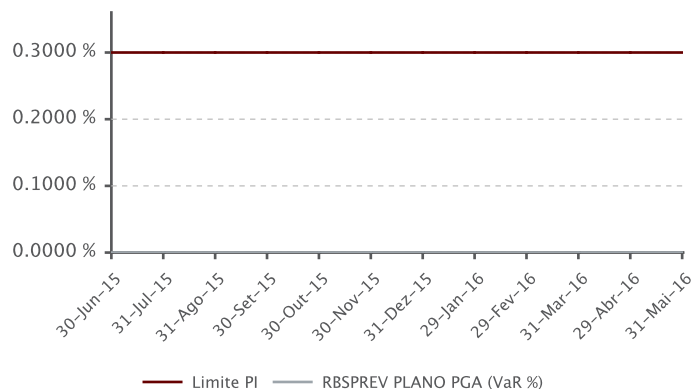
31/05/2016

## RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PLANO PGA	1,535,222.82	1,536,336.18	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 2016-05-31

31/05/2016

## RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	519,144.21	100.00	33.79	80.00	✓
2 - Faixa AA+	457,097.65	88.05	29.75	50.00	✓
3 - Faixa A+	24,088.66	4.64	1.57	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	

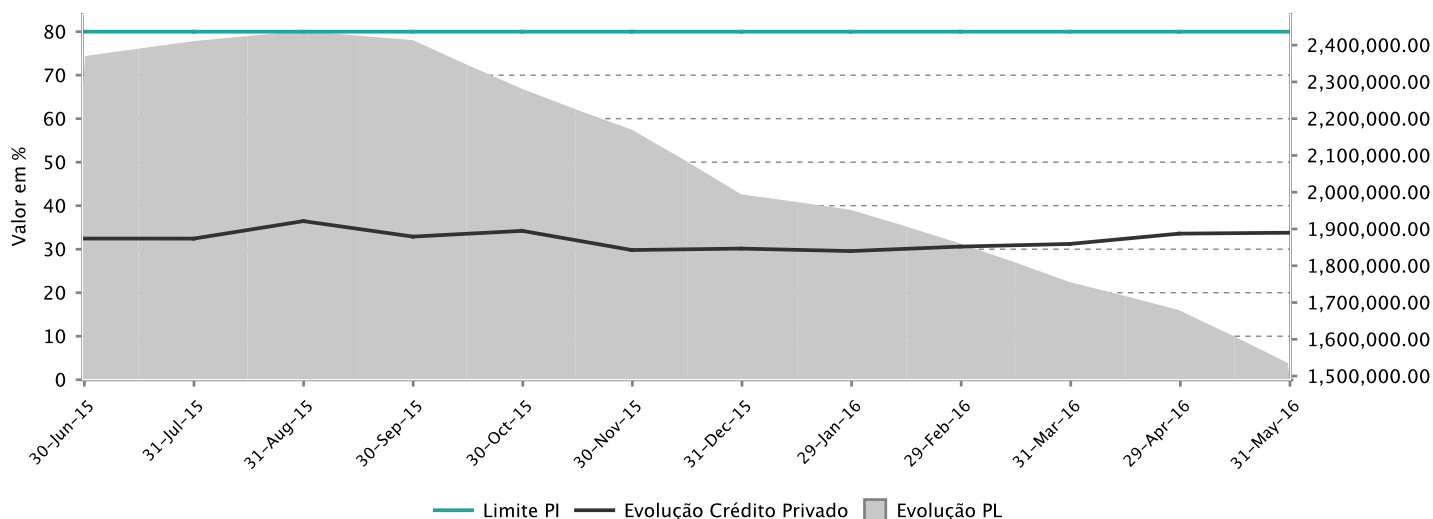
**Total Crédito Privado 519,144.21**

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

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	33.79	80.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

## EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



## RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	151,353.79	9.85%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	117,529.55	7.65%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	69,942.59	4.55%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	62,173.15	4.05%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	60,121.55	3.91%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	37,853.33	2.46%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	13,210.70	0.86%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	3,764.76	0.25%	10.00%	✓
BCO MERRILL LYNCH INVESTS SA	1,925.01	0.13%	20.00%	✓
BCO SAFRA SA	1,269.78	0.08%	20.00%	✓

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 2016-05-31

31/05/2016

## 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	68.21%	68.21%	-	-
7	0.00%	68.21%	-	-
21	0.00%	68.21%	-	-
Longo	31.79%	100.00%	-	-

## CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI FI	1,536,460.54	1,361,868,574.80	0.11%

## ALOCÇÃO POR SEGMENTO

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

\* Os valores percentuais de alocação por segmento são calculados com base na abertura dos fundos em nível de ativos (salvas exceções previstas na legislação vigente para fundos de investimento no exterior e fundos de investimento enquadrados no segmento de investimentos estruturados). Desta forma, não são consideradas as classificações dos fundos em si.