

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



RBSPREV PLANO PGA 2016-03-31

31/03/2016

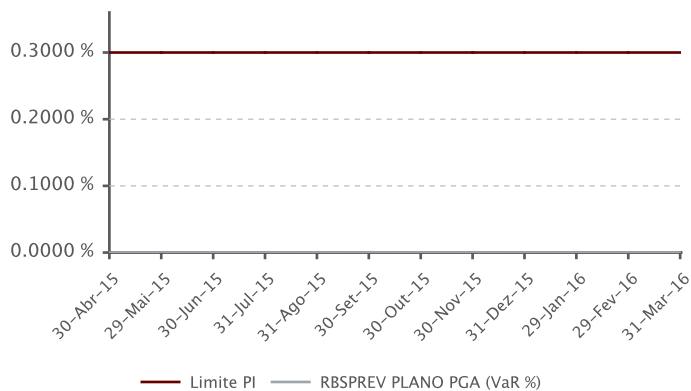
RISCO DE MERCADO

VAR

Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
PREV PLANO PGA	1,756,026.75	1,757,146.13	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 2016-03-31

31/03/2016

RISCO DE CRÉDITO

	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.	Limite	Status
1 - Faixa AAA	548,397.93	100.00	31.21	80.00	✓
2 - Faixa AA+	514,067.62	93.74	29.26	50.00	✓
3 - Faixa A+	30,203.00	5.51	1.72	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	

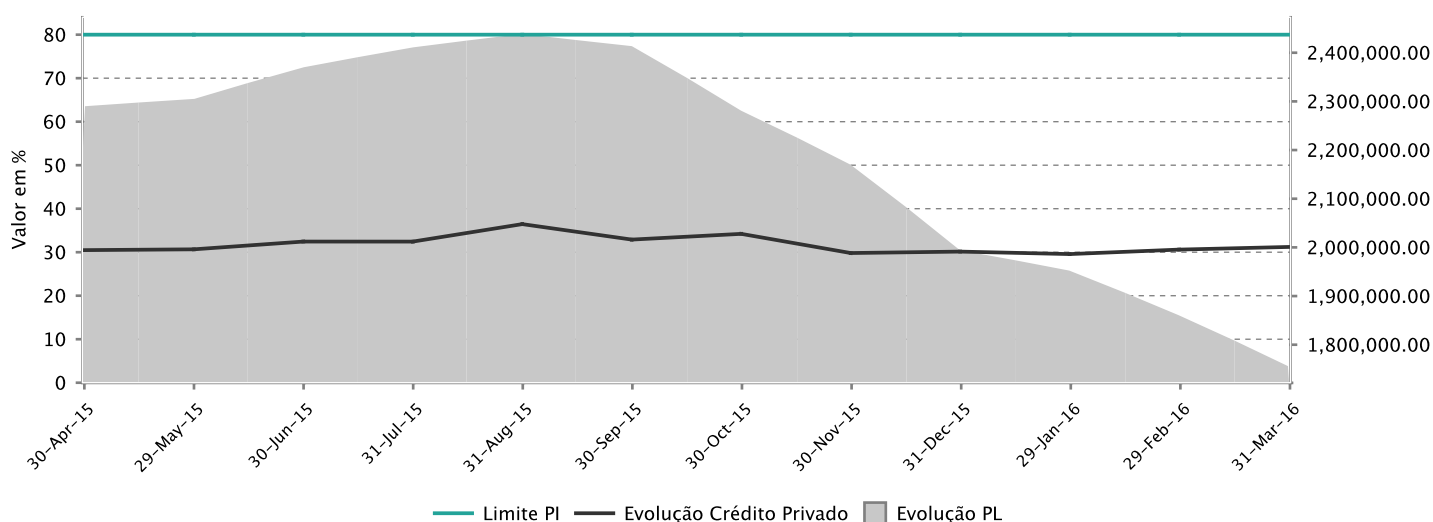
Total Crédito Privado 548,397.93

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	31.21	80.00	✓
Grau Especulativo	0.00	5.00	✓

EVOLUÇÃO GRÁFICA CRÉDITO PRIVADO



RISCO DE CONCENTRAÇÃO

Emissor	MtM Inf.	% Total	Limite	Status
BCO BRADESCO SA	173,639.16	9.88%	20.00%	✓
BCO SANTANDER (BRASIL) SA	108,198.18	6.16%	20.00%	✓
ITAUSA INVESTS ITAU SA	74,030.36	4.21%	20.00%	✓
HSBC BANK BRASIL SA BANCO MULTIPLO	68,893.06	3.92%	20.00%	✓
CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	64,807.38	3.69%	20.00%	✓
BCO VOTORANTIM SA	39,425.63	2.24%	20.00%	✓
BCO BRASIL SA	13,689.13	0.78%	20.00%	✓
ELETPAULO METROPOLITANA ELETRICIDADE SAO PAULO SA	4,153.33	0.24%	10.00%	✓
BCO SAFRA SA	1,323.31	0.08%	20.00%	✓
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	238.40	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 2016-03-31

31/03/2016

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	70.64%	70.64%	-	-
7	0.00%	70.64%	-	-
21	1.12%	71.76%	-	-
Longo	28.24%	100.00%	-	-

CONCENTRAÇÃO POR VEÍCULOS (PRIMEIRO NÍVEL)

Fundos	Alocação	PL	% PL
ITAU INSTITUCIONAL RF REFERENCIADO DI FI	1,757,292.94	1,461,716,556.25	0.12%

ALOCAÇÃO 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.