

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-04-30

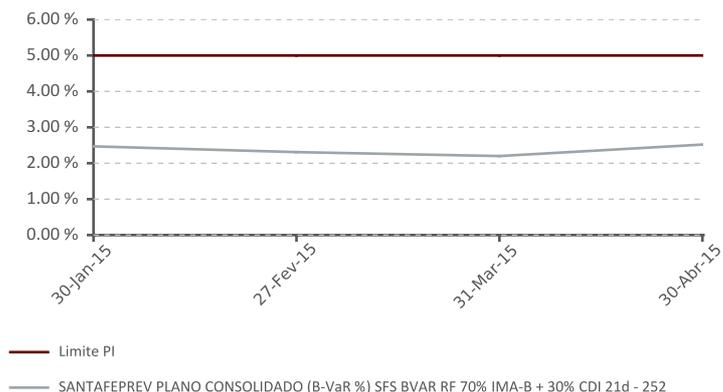
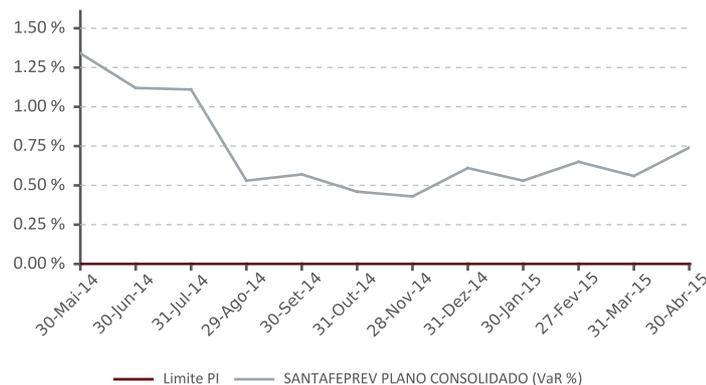
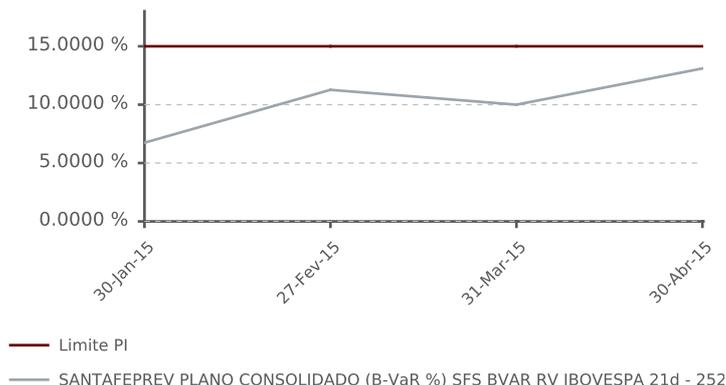
30/04/2015

## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	-	24,161,221.80	24,160,700.82	0.74%	-	-	(277,504.02)	(1.15)%
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	70%IMA-B + 30%CDI	24,031,514.90	24,030,993.92	2.52%	5.00%	✓	-	-
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	Ibovespa Carteira Aberta	129,706.90	129,706.90	13.10%	15.00%	✓	-	-

\* Quando o campo Benchmark estiver preenchido, o valor apresentado na coluna VaR/BVaR será o Benchmark VaR. Caso contrário o valor apresentado será o Value at Risk.

## EVOLUÇÃO GRÁFICA



# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-04-30

30/04/2015

## RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	1,875,603.05	99.82	7.76
Faixa 2	AA+	1,780,247.38	94.75	7.37
Faixa 3	A+	22,345.62	1.19	0.09
Faixa 4	BBB+	21,687.44	1.15	0.09
Faixa 5	< BBB-	21,687.44	1.15	0.09
Sem Nota	-	3,384.36	0.18	0.01
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
<b>Total</b>		<b>1,878,987.42</b>		

\*Os valores apresentados em crédito privado não contemplam o financeiro dos swaps.

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	7.78	75.00	✓
Grau Especulativo	7.10	7.50	✓

## ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
VEBM17	1,130.41	VOTORANTIM CIMENTOS SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
ALPA14	106.46	ALUPAR INVESTIMENTO S.A	RETIRADO	MOODY	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
IPPT12	2,253.96	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
QT IPCA FIDC JUROS	1,689,125.99	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
FIDC TREND BANK	21,687.44	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITARIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	95.78%	95.78%	30.00%	✓
21	0.13%	95.91%	40.00%	✓
Longo	4.09%	100.00%	-	-

## ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.46%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.54%	0.00%	30.00%	✓

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.