

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-08-31

31/08/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	-	26,623,090.72	26,622,150.55	1.16%	-	-	(371,535.21)	(1.40)%
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	70%IMA-B + 30%CDI	26,498,107.02	26,497,166.86	2.35%	5.00%	✓	-	-
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	Ibovespa Carteira Aberta	124,983.69	124,983.69	7.56%	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.

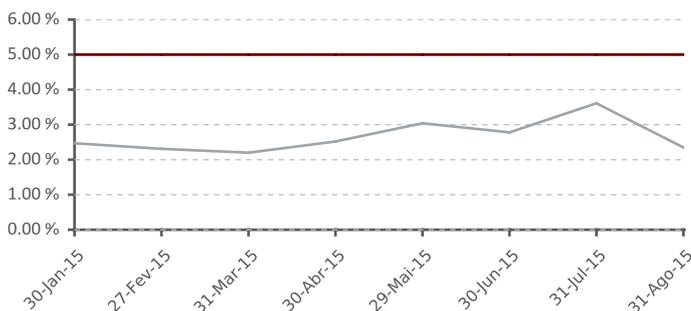
EVOLUÇÃO GRÁFICA



— Limite PI — SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO (B-VaR %) SFS BVAR RV IBOV



— Limite PI — SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO (VaR %)



— Limite PI — SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO (B-VaR %) SFS BVAR RF 70% IMA-B + 30% CDI 21d - 252

RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.
Faixa 1	AAA	1,863,703.99	100.00	7.00
Faixa 2	AA+	1,824,869.19	97.92	6.85
Faixa 3	A+	24,532.95	1.32	0.09
Faixa 4	BBB+	22,594.12	1.21	0.08
Faixa 5	< BBB-	22,594.12	1.21	0.08
Sem Nota	-	1,300.84	0.07	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00

Total Crédito Privado 1,863,703.99

*Os valores apresentados em crédito privado não contemplam o financeiro dos swaps intermediados pela BM&FBovespa.

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	7.00	75.00	✓
Grau Especulativo	6.75	7.50	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

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



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-08-31

31/08/2015

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
IPPT12	848.25	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
VEBM17	452.60	VOTORANTIM CIMENTOS SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
QT IPCA FIDC JUROS	1,773,527.50	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
FIDC TRENBANK	21,293.28	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	96.36%	96.36%	30.00%	✓
21	0.09%	96.46%	40.00%	✓
Longo	3.54%	100.00%	-	-

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.53%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.47%	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.