

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-10-30

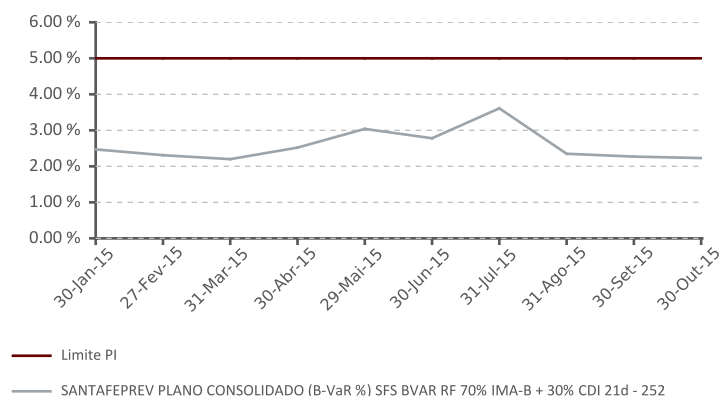
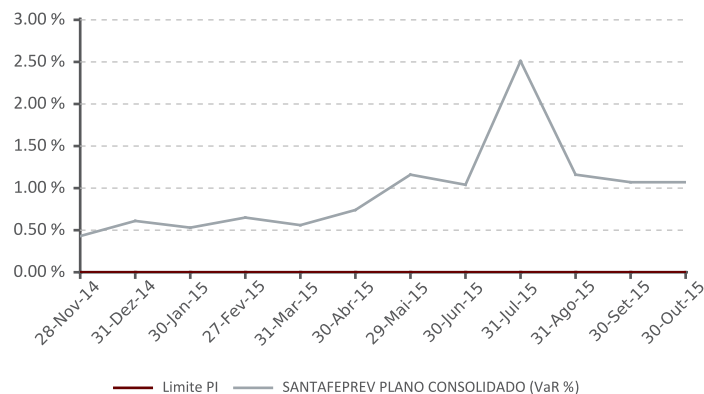
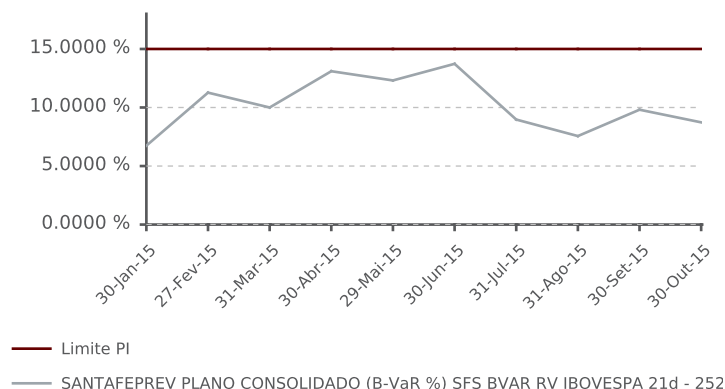
30/10/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	-	28,115,268.69	28,114,245.68	1.07%	-	-	(381,936.18)	(1.36)%
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	70%IMA-B + 30%CDI	27,974,184.02	27,973,161.01	2.23%	5.00%	✓	-	-
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	Ibovespa Carteira Aberta	141,084.67	141,084.67	8.73%	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



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.
Faixa 1	<= AAA	1,934,903.47	100.00	6.88
Faixa 2	<= AA+	1,907,964.15	98.61	6.79
Faixa 3	<= A+	25,879.27	1.34	0.09
Faixa 4	<= BBB+	25,190.47	1.30	0.09
Faixa 5	<= BB+	22,771.11	1.18	0.08
-	Sem Nota	2,027.57	0.10	0.01
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00

Total Crédito Privado 1,934,903.47

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	6.88	75.00	✓
Grau Especulativo	6.54	7.50	✓

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 2015-10-30

30/10/2015

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
CSNA15	2,419.36	CIA SIDERURGICA NACIONAL	Baa3.br	MOODY	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
VEBM17	674.38	VOTORANTIM CIMENTOS SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
IPPT12	1,353.19	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
NATU25	719.32	NATURA COSMETICOS SA	RETIRADO	FR	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
NATU35	719.40	NATURA COSMETICOS SA	RETIRADO	FR	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
USIM16	107.73	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA	Ba2.br	MOODY	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
FIDC TRENBANK	20,743.54	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
QT IPCA FIDC JUROS	1,812,559.13	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	96.48%	96.48%	30.00%	✓
21	0.08%	96.56%	40.00%	✓
Longo	3.44%	100.00%	-	-

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.50%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.50%	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.