

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-07-31

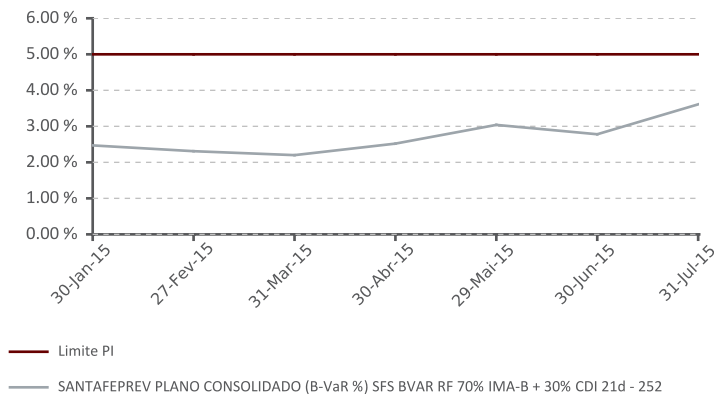
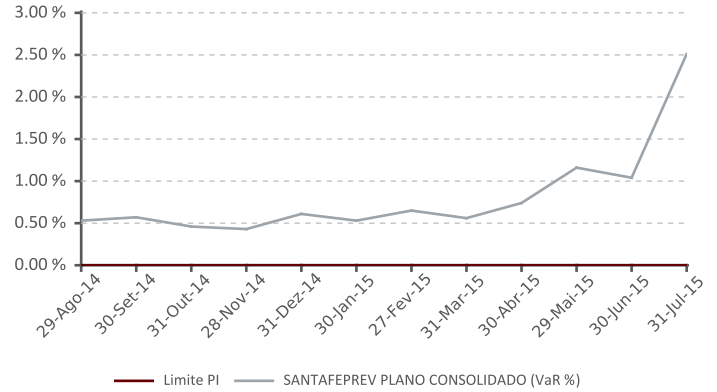
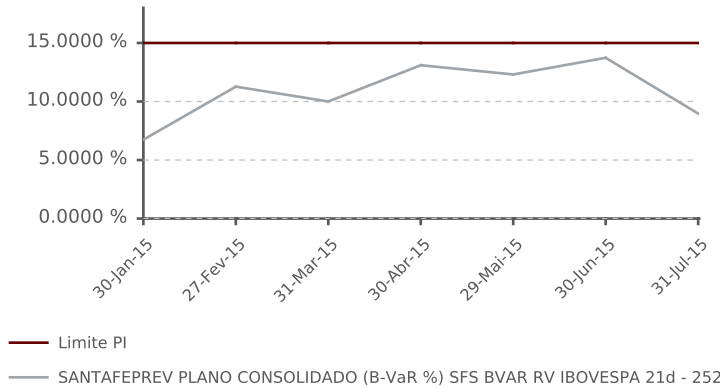
31/07/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	-	32,122,826.16	32,121,841.26	2.51%	-	-	(335,944.84)	(1.05)%
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	70%IMA-B + 30%CDI	31,998,652.45	31,997,667.55	3.61%	5.00%	✓	-	-
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	Ibovespa Carteira Aberta	124,173.71	124,173.71	8.97%	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 2015-07-31

31/07/2015

RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	1,794,594.72	99.98	5.59
Faixa 2	AA+	1,785,470.95	99.47	5.56
Faixa 3	A+	22,254.08	1.24	0.07
Faixa 4	BBB+	21,675.03	1.21	0.07
Faixa 5	< BBB-	21,675.03	1.21	0.07
Sem Nota	-	304.32	0.02	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		1,794,899.05		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	5.59	75.00	✓
Grau Especulativo	5.54	7.50	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
IPPT12	198.44	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
VEBM17	105.88	VOTORANTIM CIMENTOS SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
FIDC TREND BANK	21,675.03	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITARIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
QT IPCA FIDC JUROS	1,756,159.65	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	97.08%	97.08%	30.00%	✓
21	0.04%	97.13%	40.00%	✓
Longo	2.87%	100.00%	-	-

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.61%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.39%	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.