

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-06-30

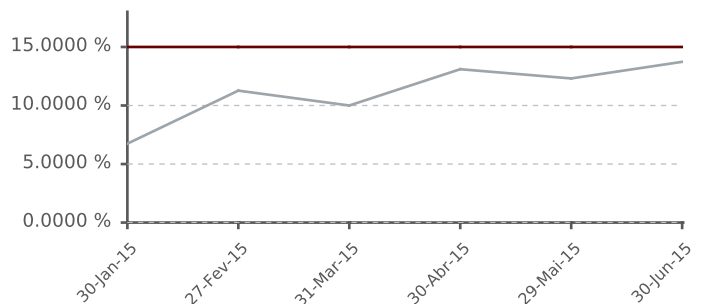
30/06/2015

RISCO DE MERCADO

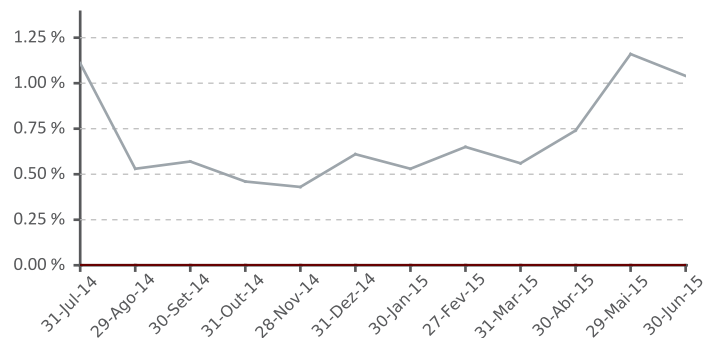
Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	-	25,279,660.48	25,278,911.46	1.04%	-	-	(318,874.80)	(1.26)%
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	70%IMA-B + 30%CDI	25,148,452.71	25,147,703.69	2.78%	5.00%	✓	-	-
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	Ibovespa Carteira Aberta	131,207.77	131,207.77	13.73%	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.

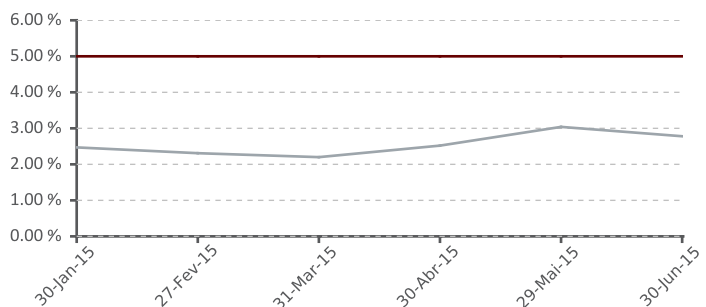
EVOLUÇÃO GRÁFICA



— Limite PI
— SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO (B-VaR %) SFS BVAR RV IBOVESPA 21d - 252



— Limite PI — SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO (VaR %)



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

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-06-30

30/06/2015

RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	1,851,879.84	99.90	7.33
Faixa 2	AA+	1,797,711.81	96.98	7.11
Faixa 3	A+	22,322.32	1.20	0.09
Faixa 4	BBB+	21,824.92	1.18	0.09
Faixa 5	< BBB-	21,824.92	1.18	0.09
Sem Nota	-	1,882.77	0.10	0.01
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		1,853,762.60		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	7.33	75.00	✓
Grau Especulativo	6.95	7.50	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
IPPT12	1,227.77	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
VEBM17	654.99	VOTORANTIM CIMENTOS SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
FIDC TREND BANK	21,824.92	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITARIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
QT IPCA FIDC JUROS	1,733,171.55	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	96.07%	96.07%	30.00%	✓
21	0.15%	96.22%	40.00%	✓
Longo	3.78%	100.00%	-	-

ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.48%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.52%	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.