

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-03-31

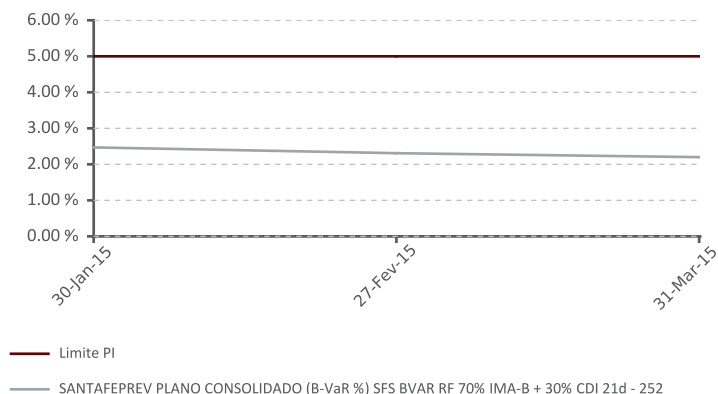
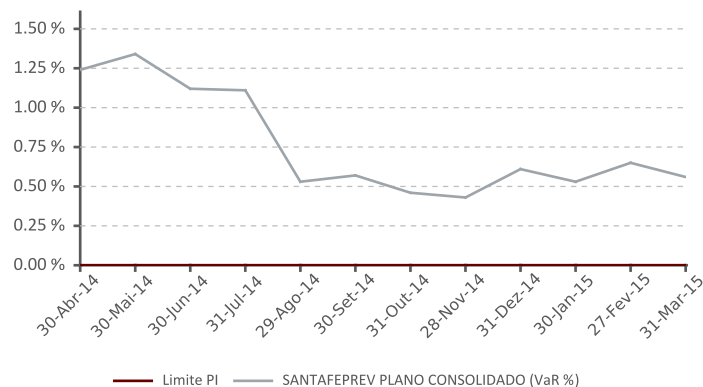
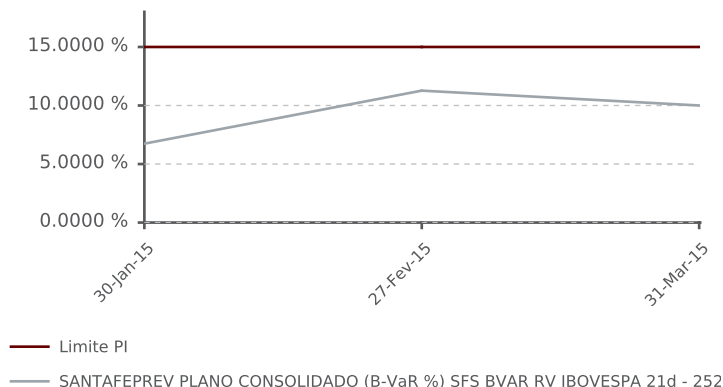
31/03/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	-	23,951,825.81	23,951,629.97	0.56%	-	-	(254,509.64)	(1.06)%
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	70%IMA-B + 30%CDI	23,826,176.73	23,825,980.90	2.20%	5.00%	✓	-	-
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	Ibovespa Carteira Aberta	125,649.07	125,649.07	10.00%	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



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 2015-03-31

31/03/2015

RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	1,948,930.33	99.63	8.14
Faixa 2	AA+	1,826,368.60	93.37	7.63
Faixa 3	A+	22,306.95	1.14	0.09
Faixa 4	BBB+	22,066.45	1.13	0.09
Faixa 5	< BBB-	21,861.66	1.12	0.09
Sem Nota	-	7,217.43	0.37	0.03
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		1,956,147.76		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	8.17	75.00	✓
Grau Especulativo	7.07	7.50	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
VEBM17	1,802.07	VOTORANTIM CIMENTOS SA	-	-	SANTANDER FI REFERENCIADO DI
NP_cdi	1,822.64	ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	-	-	SANTANDER FI REFERENCIADO DI
ALPA14	171.09	ALUPAR INVESTIMENTO S.A	RETIRADO	MOODY	SANTANDER FI REFERENCIADO DI
IPPT12	3,592.72	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI REFERENCIADO DI
QT IPCA FIDC JUROS	1,664,260.58	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
FIDC TREND BANK	21,861.66	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	95.52%	95.52%	30.00%	✓
21	0.15%	95.66%	40.00%	✓
Longo	4.34%	100.00%	-	-

ALOCAÇÃO 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.