

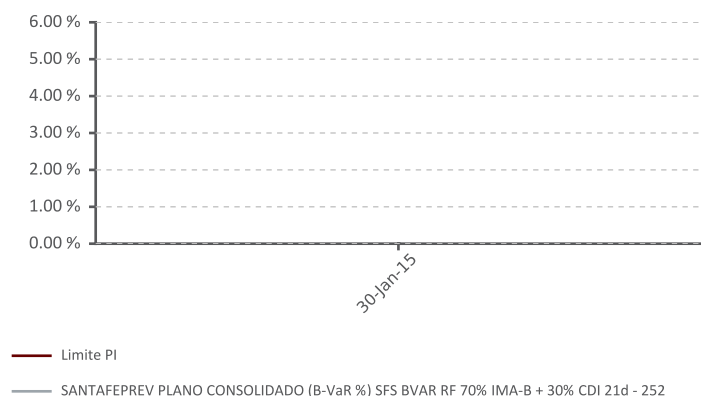
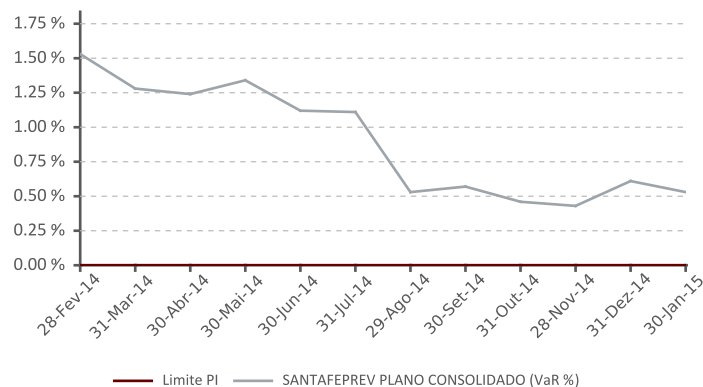
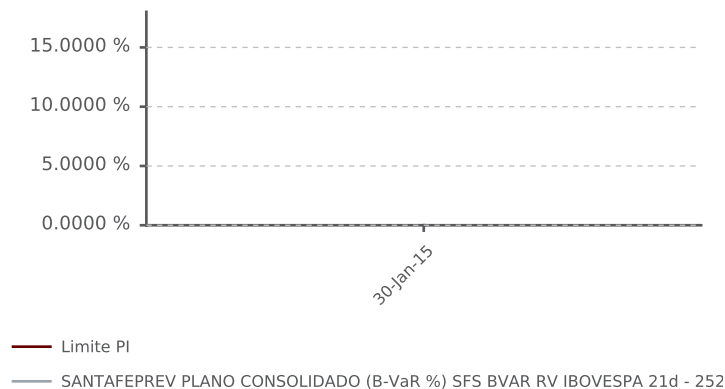


## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	-	23,125,496.38	23,126,778.97	0.53%	-	-	(269,813.14)	(1.17)%
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	70%IMA-B + 30%CDI	22,983,608.34	22,984,890.93	2.47%	5.00%	✓	-	-
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	Ibovespa Carteira Aberta	141,888.04	141,888.04	6.74%	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 2015-01-30

30/01/2015

## RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	1,797,344.25	99.81	7.77
Faixa 2	AA+	1,722,214.92	95.64	7.45
Faixa 3	A+	23,546.56	1.31	0.10
Faixa 4	BBB+	21,776.76	1.21	0.09
Faixa 5	< BBB-	21,296.95	1.18	0.09
Sem Nota	-	3,365.26	0.19	0.01
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
<b>Total</b>		<b>1,800,709.50</b>		

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

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	7.79	75.00	✓
Grau Especulativo	7.05	7.50	✓

## ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
NP_cdi	1,649.00	ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	-	-	SAFRA EXECUTIVE 2 FI RF
NP_cdi	269.47	ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	-	-	SANTANDER FI REFERENCIADO DI
LC_cdi	634.09	PORTOSEG SA CRED FINANC INVEST	-	-	SAFRA EXECUTIVE 2 FI RF
IPPT12	530.95	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI REFERENCIADO DI
VEBM17	281.75	VOTORANTIM CIMENTOS SA	-	-	SANTANDER FI REFERENCIADO DI
QT IPCA FIDC JUROS	1,604,857.95	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
FIDC TREND BANK	21,296.95	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITARIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	95.47%	95.47%	30.00%	✓
21	0.13%	95.60%	40.00%	✓
Longo	4.40%	100.00%	-	-

## ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.39%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.61%	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.