

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-05-29

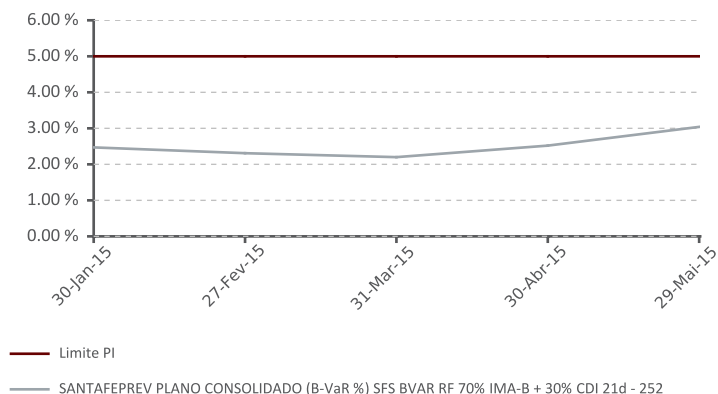
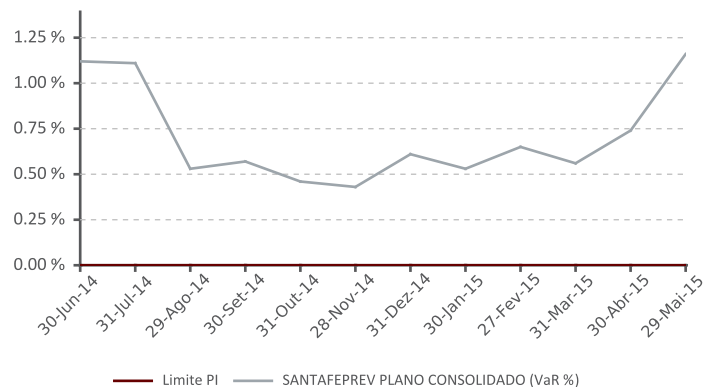
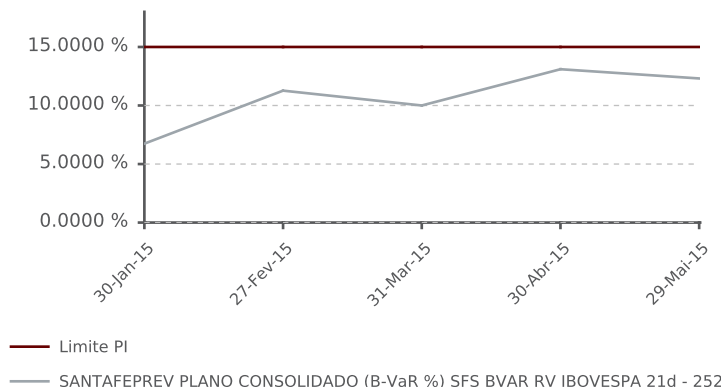
29/05/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	-	24,684,473.79	24,683,780.40	1.16%	-	-	(328,764.95)	(1.33)%
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	70%IMA-B + 30%CDI	24,546,541.71	24,545,761.92	3.04%	5.00%	✓	-	-
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	Ibovespa Carteira Aberta	137,932.08	138,018.48	12.31%	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 2015-05-29

29/05/2015

RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	1,789,623.97	99.93	7.25
Faixa 2	AA+	1,755,055.37	98.00	7.11
Faixa 3	A+	22,481.15	1.26	0.09
Faixa 4	BBB+	22,118.45	1.24	0.09
Faixa 5	< BBB-	22,118.45	1.24	0.09
Sem Nota	-	1,165.16	0.07	0.00
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		1,790,789.13		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	7.25	75.00	✓
Grau Especulativo	7.02	7.50	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
VEBM17	389.21	VOTORANTIM CIMENTOS SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
IPPT12	775.95	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
QT IPCA FIDC JUROS	1,708,741.66	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
FIDC TREND BANK	22,118.45	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	96.11%	96.11%	30.00%	✓
21	0.15%	96.26%	40.00%	✓
Longo	3.74%	100.00%	-	-

ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.44%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.56%	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.