

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-02-27

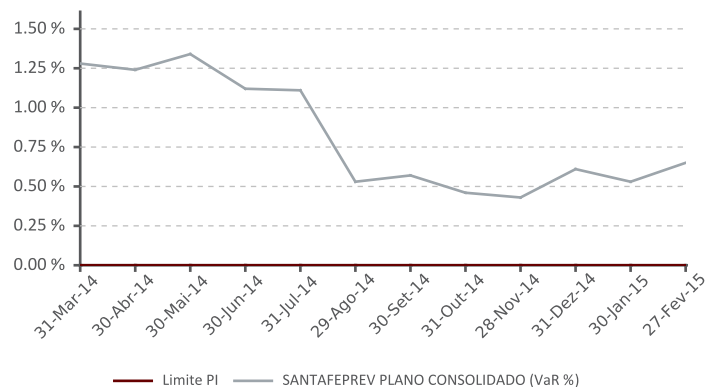
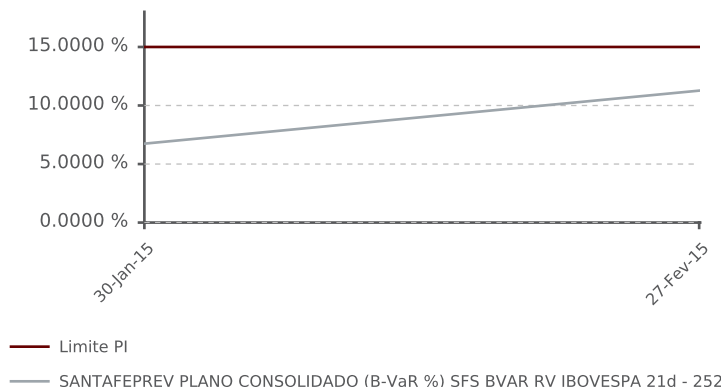
27/02/2015

RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	-	23,579,427.96	23,578,767.51	0.65%	-	-	(268,096.71)	(1.14)%
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	70%IMA-B + 30%CDI	23,444,674.95	23,444,014.51	2.31%	5.00%	✓	-	-
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	Ibovespa Carteira Aberta	134,753.00	134,753.00	11.27%	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 2015-02-27

27/02/2015

RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito	% Total
Faixa 1	AAA	1,734,566.41	99.86	7.36
Faixa 2	AA+	1,699,636.47	97.85	7.21
Faixa 3	A+	22,000.25	1.27	0.09
Faixa 4	BBB+	22,000.25	1.27	0.09
Faixa 5	< BBB-	21,492.98	1.24	0.09
Sem Nota	-	2,358.23	0.14	0.01
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total		1,736,924.65		

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

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	7.37	75.00	✓
Grau Especulativo	7.01	7.50	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
ALPA14	55.11	ALUPAR INVESTIMENTO S.A	RETIRADO	MOODY	SANTANDER FI REFERENCIADO DI
NP_cdi	587.12	ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	-	-	SANTANDER FI REFERENCIADO DI
IPPT12	1,157.05	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI REFERENCIADO DI
VEBM17	614.06	VOTORANTIM CIMENTOS SA	-	-	SANTANDER FI REFERENCIADO DI
QT IPCA FIDC JUROS	1,629,383.12	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
FIDC TREND BANK	21,492.98	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	95.89%	95.89%	30.00%	✓
21	0.04%	95.93%	40.00%	✓
Longo	4.07%	100.00%	-	-

ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.43%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.57%	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.