

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2016-05-31

31/05/2016

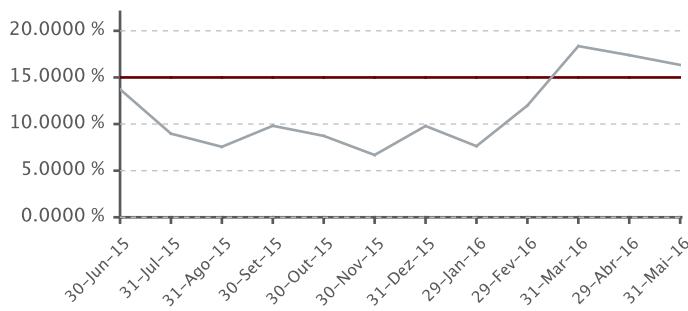
RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	34,247,657.19	34,246,017.13	0.34%	-	-	-	-	-	-	(1.16)%

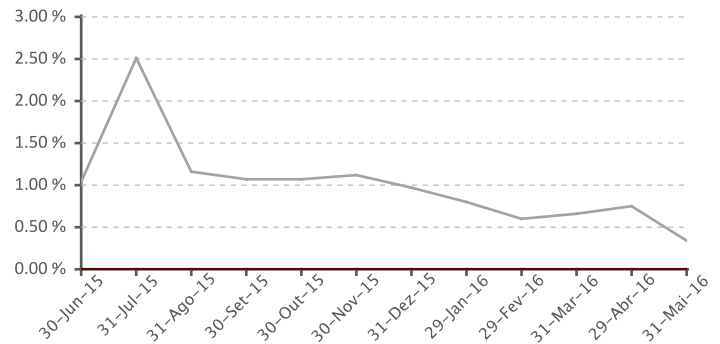
BVAR						
Mandato	PL Calculado	PL Informado	Benchmark	BVaR	Limite	Status
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	33,199,831.26	33,198,191.20	70%IMA-B + 30%CDI	3.15%	5.00%	✓
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	1,047,825.93	1,047,825.93	Ibovespa Carteira Aberta	16.34%	15.00%	✗

* VaR Rel. representa o % de valor em risco (VaR), em relação ao risco da carteira teórica (IBOVESPA, IBX, IBX50 e outros).

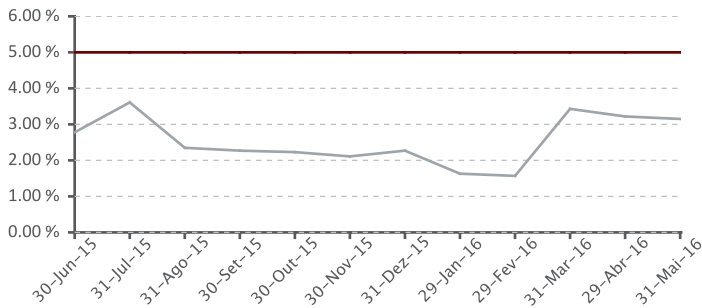
EVOLUÇÃO GRÁFICA



— 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

RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.
Faixa 1	<= AAA	2,182,829.05	100.00	6.37
Faixa 2	<= AA+	2,158,090.69	98.87	6.30
Faixa 3	<= A+	37,657.49	1.73	0.11
Faixa 4	<= BBB+	23,519.69	1.08	0.07
Faixa 5	<= BB+	22,889.04	1.05	0.07
-	Sem Nota	2,868.38	0.13	0.01
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total Crédito Privado		2,182,829.05		

*Contempla o financeiro dos Swaps intermediados pela BM&FBovespa e/ou com garantia.

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2016-05-31

31/05/2016

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	6.37	75.00	✓
Grau Especulativo	5.90	7.50	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
LF CDI	519.16	CIA CREDITO FINANC INVEST RCI BRASIL	RETIRADO	MOODY	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
CSNA15	3,758.83	CIA SIDERURGICA NACIONAL	B3.br	MOODY	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
IPPT12	2,131.40	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
USIM16	168.03	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA	brC	SP	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
DPGE_cdi	217.82	BARIGUI SA CFI	-	-	JMALUCCELLI EXECUTIVO FI REF DI
CDB_cdi	111.33	BCO BMG SA	Baa3.br	MOODY	JMALUCCELLI EXECUTIVO FI REF DI
FIDC TREND BANK	16,093.80	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
QT IPCA FIDC JUROS	1,998,831.54	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	96.86%	96.86%	30.00%	✓
21	0.16%	97.02%	40.00%	✓
Longo	2.98%	100.00%	-	-

ALOCÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	96.94%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	3.06%	0.00%	30.00%	✓

* Os valores percentuais de alocação por segmento são calculados com base na abertura dos fundos em nível de ativos (salvas exceções previstas na legislação vigente para fundos de investimento no exterior e fundos de investimento enquadrados no segmento de investimentos estruturados). Desta forma, não são consideradas as classificações dos fundos em si.

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.