

Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2016-01-29

29/01/2016

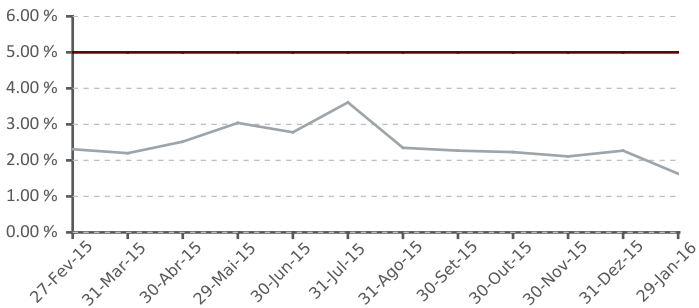
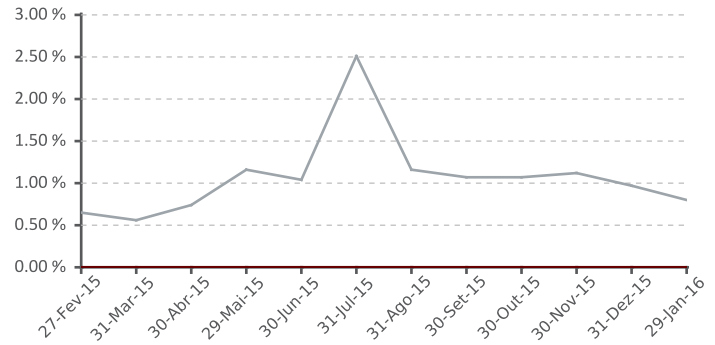
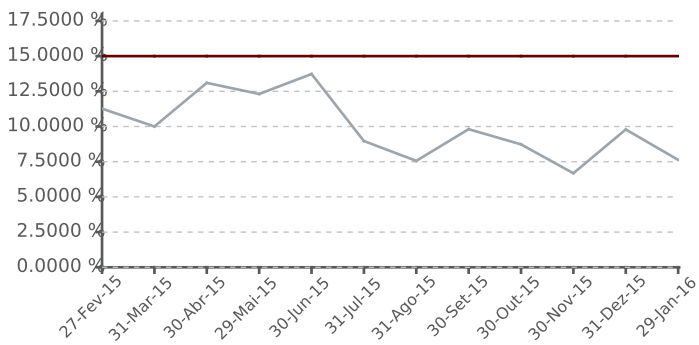
RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	30,326,791.59	30,332,265.60	0.80%	-	-	-	-	-	-	(1.25)%

BVAR						
Mandato	PL Calculado	PL Informado	Benchmark	BVaR	Limite	Status
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	30,189,180.84	30,194,654.85	70%IMA-B + 30%CDI	1.63%	5.00%	✓
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	137,610.75	137,610.75	Ibovespa Carteira Aberta	7.63%	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



RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.
Faixa 1	<= AAA	2,153,950.93	100.00	7.10
Faixa 2	<= AA+	2,082,638.83	96.69	6.87
Faixa 3	<= A+	32,732.29	1.52	0.11
Faixa 4	<= BBB+	28,961.69	1.34	0.10
Faixa 5	<= BB+	23,304.30	1.08	0.08
-	Sem Nota	5,158.13	0.24	0.02
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
Total Crédito Privado		2,153,950.93		

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

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 2016-01-29

29/01/2016

LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	7.10	75.00	✓
Grau Especulativo	6.35	7.50	✓

ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
IPPT12	3,046.74	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
USIM16	260.97	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA	brCCC+	SP	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
CSNA15	5,657.39	CIA SIDERURGICA NACIONAL	brBBB-	SP	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
VEBM17	1,631.19	VOTORANTIM CIMENTOS SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
DPGE_cdi	480.20	BARIGUI SA CFI	-	-	JMALUCELLI EXECUTIVO FI REFERENCIADO
QT IPCA FIDC JUROS	1,897,834.53	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
FIDC TREND BANK	18,146.17	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITARIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	99.16%	99.16%	30.00%	✓
21	0.10%	99.26%	40.00%	✓
Longo	0.74%	100.00%	-	-

ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	99.55%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	0.45%	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.