

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2015-12-31

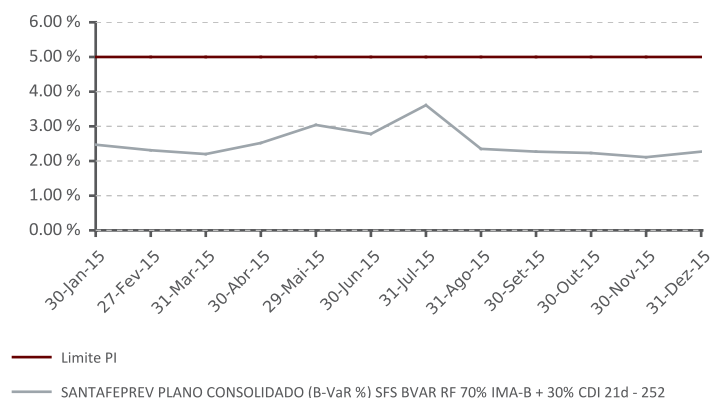
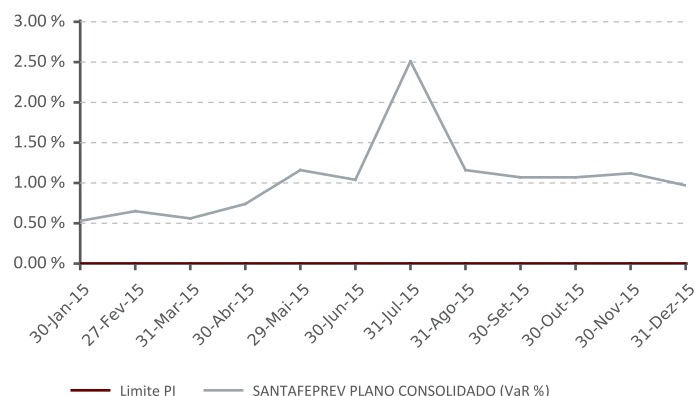
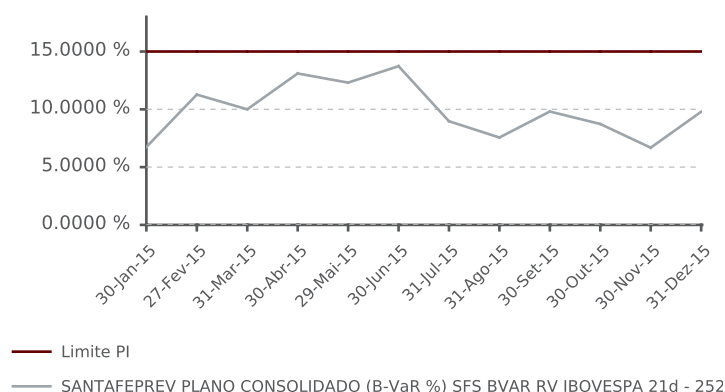
31/12/2015

## RISCO DE MERCADO

Mandato	Benchmark	PL Calculado	PL Informado	VaR/BVaR	Limite PI	Status	Stress	Stress %
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	-	29,378,569.40	29,381,334.02	0.97%	-	-	(334,132.22)	(1.14)%
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	70%IMA-B + 30%CDI	28,382,785.89	28,385,550.51	2.27%	5.00%	✓	-	-
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	Ibovespa Carteira Aberta	995,783.51	995,783.51	9.79%	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



## RISCO DE CRÉDITO

	Rating	MtM Inf.	% Crédito Acum.	% Total Acum.
Faixa 1	<= AAA	2,147,271.90	100.00	7.31
Faixa 2	<= AA+	2,080,156.16	96.87	7.08
Faixa 3	<= A+	34,455.75	1.60	0.12
Faixa 4	<= BBB+	30,350.86	1.41	0.10
Faixa 5	<= BB+	24,283.58	1.13	0.08
-	Sem Nota	5,443.68	0.25	0.02
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00

**Total Crédito Privado 2,147,271.90**

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

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	7.31	75.00	✓
Grau Especulativo	6.47	7.50	✓

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 2015-12-31

31/12/2015

## ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	600.45	BARIGUI SA CFI	-	-	JMALUCELLI EXECUTIVO FI REFERENCIADO
CSNA15	6,067.28	CIA SIDERURGICA NACIONAL	Baa3.br	MOODY	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
VEBM17	1,688.72	VOTORANTIM CIMENTOS SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
USIM16	267.43	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA	Ba2.br	MOODY	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
IPPT12	3,154.51	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
FIDC TRENBANK	18,839.90	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
QT IPCA FIDC JUROS	1,869,107.12	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	96.28%	96.28%	30.00%	✓
21	0.15%	96.43%	40.00%	✓
Longo	3.57%	100.00%	-	-

## ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	96.61%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	3.39%	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.