

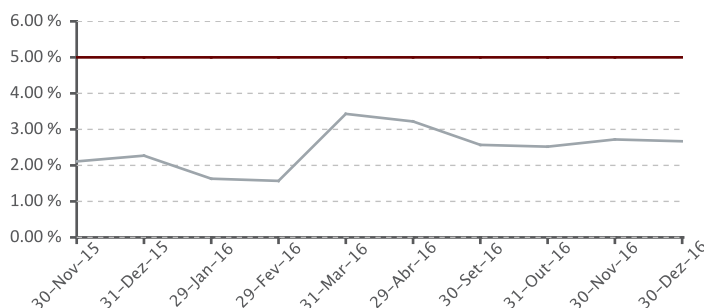
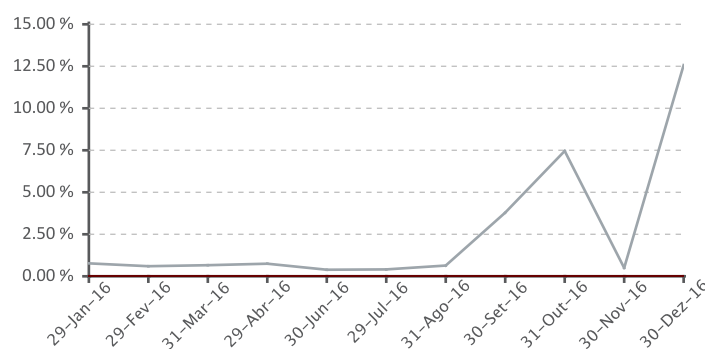
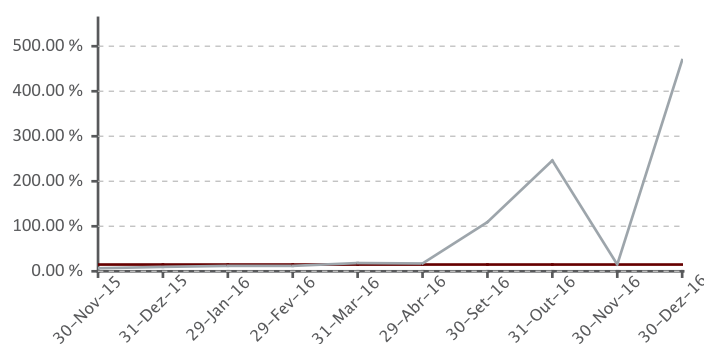
### RISCO DE MERCADO

VAR										
Mandato	PL Calculado	PL Informado	VaR	Limite	Status	Benchmark	VaR Rel.	Limite	Status	Stress
FEPREV PLANO CONSOLIDADO (SFS 21D - 252)	39,709,119.32	39,707,683.27	12.57%	-	-	-	-	-	-	(1.10)%

BVAR						
Mandato	PL Calculado	PL Informado	Benchmark	BVaR	Limite	Status
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	38,669,415.53	38,667,979.48	70%IMA-B + 30%CDI	2.67%	5.00%	✓
FEPREV PLANO CONSOLIDADO	1,039,703.79	1,039,703.79	Ibovespa Carteira Aberta	469.11%	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	2,349,622.36	100.00	5.92
Faixa 2	<= AA+	2,323,420.79	98.88	5.85
Faixa 3	<= A+	36,492.70	1.55	0.09
Faixa 4	<= BBB+	24,957.97	1.06	0.06
Faixa 5	<= BB+	22,998.76	0.98	0.06
-	Sem Nota	3,385.84	0.14	0.01
Outros (*)	-	0.00	0.00	0.00
<b>Total Crédito Privado</b>		<b>2,349,622.36</b>		

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

# Mapa Simplificado de Controle de Riscos



SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO 2016-12-30

30/12/2016

## LIMITES POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

	Total	Limite	Status
Total Crédito Privado	5.92	75.00	✓
Grau Especulativo	5.45	7.50	✓

## ATIVOS GRAU ESPECULATIVO

Ativo	Exposição	Origem	Nota	Agência	Veículo
DPGE_cdi	613.30	BCO BMG SA	Baa3.br	MOODY	JMALUCCELLI EXECUTIVO FI REF DI
DPGE_cdi	1,199.00	BARIGUI SA CFI	-	-	JMALUCCELLI EXECUTIVO FI REF DI
DPGE_cdi	1,111.26	BCO PINE SA	brBBB-	SP	JMALUCCELLI EXECUTIVO FI REF DI
CSNA15	4,181.54	CIA SIDERURGICA NACIONAL	brCCC+	SP	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
USIM16	173.27	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA	RD(bra)	FR	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
CMTR13	234.65	CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	brBBB+	SP	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
IPPT12	2,186.84	IPIRANGA PRODUTOS PETROLEO SA	-	-	SANTANDER FI II REFERENCIADO DI
FIDC Trendbank B.F.	15,258.12	FUNDO INVEST DIREITOS CREDITORIOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO
QT IPCA FIDC JUROS	2,138,832.29	QT IPCA FUNDO INVEST DIREITOS	-	-	SANTAFEPREV PLANO CONSOLIDADO

## CONTROLE DE LIQUIDEZ

Liquidez	Observado	Acumulado	Limite PI	Status
1	97.38%	97.38%	30.00%	✓
21	0.15%	97.53%	40.00%	✓
Longo	2.47%	100.00%	-	-

## ALOCAÇÃO POR SEGMENTO

Segmento	% Total	Mínimo PI	Máximo PI	Status
Renda Fixa	97.38%	0.00%	100.00%	✓
Renda Variável	2.62%	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 Aditus 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.