

Data de Geração: 30/04/2015 16:46:01

Informações da Entidade

Código: 919

Sigla: SAO BERNARDO

Exercício: 2015

Plano de Benefícios: 1980000719 - PLANO DE PREVIDÊNCIA COMPLEMENTAR SÃO BERNARDO

Taxa Mínima Atuarial / Índice de Referência

Indexador por Plano/Segmento - Período de Referência: 01/2015 a 12/2015

Participação %	Plano/Segmento	Percentual Indexador	Indexador	Taxa de Juros %aa
100,00	PLANO	100,00	IGP-DI	5,50
100,00	RENDA VARIÁVEL	100,00	IBOVESPA	0,00
100,00	IMÓVEIS	100,00	IGP-DI	5,50
80,00	RENDA FIXA	100,00	IMA-S	0,00
20,00	RENDA FIXA	100,00	IMA-B	0,00

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata: null

Data: 23/04/2015

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2015 a 31/12/2015	PLANO	CARLOS WILLIAM MACEDO	045.745.918-20	DIRETOR SUPERINTENDENTE

Controle de Risco

Risco de Mercado

Risco de Liquidez

Risco de Contraparte

Risco Legal

Risco Operacional

Outros

Realiza o apuração de ativos financeiros: Não	Dispõe de Manual: Não
Possui modelo proprietário de risco: Sim	Dispõe de Manual: Não
Realiza Estudos de ALM: Não	

Observação: Todos os ativos são marcados a mercado, com exceção dos ativos destinados à parcela de benefício definido que devem ser marcados na curva. Como a gestão é totalmente terceirizada, a responsabilidade pelo apuração dos ativos é dos gestores e custodiantes. Os controles de riscos são realizados pelos gestores de recursos e acompanhados através de relatórios elaborados por consultoria especializada.

Alocação dos Recursos

Período de Referência: 01/2015 a 12/2015

Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
RENDA FIXA	33,00	100,00	86,00
RENDA VARIÁVEL	0,00	48,00	10,00
IMÓVEIS	0,00	8,00	4,00
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	1,00	0,00
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00	0,00
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	10,00	0,00
A EFPC observa os princípios de responsabilidade socioambiental? Sim			
Utiliza derivativos? Sim			
Avaliação prévia dos riscos envolvidos? Sim			
Existência de sistemas de controles internos? Sim			

Observação: A Entidade realiza avaliação prévia dos riscos envolvidos na definição da alocação estratégica nas diferentes classes de ativos, com o apoio da consultoria de investimentos no momento da definição da PI. A avaliação prévia dos riscos envolvidos na alocação de ativos e derivativos é de responsabilidade dos gestores de recursos, devendo seguir as diretrizes definidas na PI.

Perfis de Investimento

O plano possui Perfis de Investimentos? Sim			
Perfil	Segmento	Mínimo%	Máximo%
Conservador	RENDA FIXA	100,00	100,00
Moderado	RENDA FIXA	75,00	85,00
	RENDA VARIÁVEL	15,00	25,00
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	5,00
Agressivo	RENDA FIXA	52,00	68,00
	RENDA VARIÁVEL	32,00	48,00
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	10,00
Outros	RENDA FIXA	100,00	100,00

Observação: Na política de investimentos os perfis são denominados da seguinte maneira: SB Pós = Outros / SB Zero = Conservador / SB 20 = Moderado / SB 40 = Agressivo

Alocação por Emissor

Emissor	Mínimo%	Máximo%	Não Aplica
TESOURO NACIONAL	0,00	100,00	
INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	0,00	10,00	
TESOURO ESTADUAL OU MUNICIPAL			x
COMPANHIA ABERTA COM REGISTRO NA CVM	0,00	5,00	
ORGANISMO MULTILATERAL	0,00	5,00	
COMPANHIA SECURITIZADORA			x
PATROCINADOR DO PLANO DE BENEFÍCIO	0,00	5,00	
FIDC/FICFIDC	0,00	5,00	
FUNDOS DE ÍNDICE REFERENCIADO EM CESTA DE AÇÕES DE CIA ABERTA	0,00	10,00	
SOCIEDADE DE PROPÓSITO ESPECÍFICO - SPE			x
FI/FICFI CLASSIFICADOS NO SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	5,00	

Observação:

Concentração por Emissor

Emissor	Mínimo%	Máximo%	Não Aplica
% DO CAPITAL VOTANTE DE UMA MESMA CIA ABERTA	0,00	20,00	
% DO CAPITAL TOTAL DE UMA MESMA CIA ABERTA OU DE UMA SPE	0,00	20,00	
% DO PL DE UMA MESMA INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	0,00	10,00	
% DO PL DE FUNDO DE ÍNDICE REFERENCIADO EM CESTA DE AÇÕES DE CIA ABERTA	0,00	10,00	
% DO PL DE FUNDO DE INVESTIMENTO CLASSIFICADO NO SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00	
% DO PL DE FUNDO DE INVESTIMENTOS CLASSIFICADOS NO SEGMENTO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	10,00	
% DO PL DE FUNDOS DE ÍNDICE NO EXTERIOR NEGOCIADOS EM BOLSA DE VALORES NO BRASIL	0,00	10,00	
% DO PATRIMÔNIO SEPARADO DE CERTIFICADOS DE RECEBÍVEIS COM REGIME FIDUCIÁRIO	0,00	10,00	

Observação:

Concentração por Investimento

Emissor	Mínimo%	Máximo%	Não Aplica
% DE UMA SÉRIE DE TÍTULOS OU VALORES MOBILIÁRIOS	0,00	10,00	
% DE UMA MESMA CLASSE OU SÉRIE DE COTAS DE FIDC	0,00	10,00	
% DE UM MESMO EMPREENDIMENTO IMOBILIÁRIO	0,00	10,00	

Observação:

Rentabilidade(%)

Plano/Segmento	2013	1º Sem 2014	2015	Não Aplica
PLANO	1,91	5,36	11,17	
RENDA FIXA	1,58	5,51	11,20	
RENDA VARIÁVEL	-0,46	3,08	11,32	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS				x
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR				x
IMÓVEIS	31,42	1,43	11,17	
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES				x

Observação: As projeções são efetuadas através das premissas retiradas do relatório FOCUS (BACEN) e utilizando modelo econométrico proprietário da Towers Watson .

Observações

O benchmark e o limite de risco para os Seg de Inv. Exterior e Inv. Estruturados serão definidos de acordo com cada estratégia de investimento no momento em que ocorrer uma aplicação. Para o Seg. de Oper. Participantes o benchmark será o maior entre o bench de RF e a Meta Atuarial