

Data de Geração: 24/01/2018 12:02:12

Informações da Entidade

Código: 919

Sigla: SAO BERNARDO

Exercício: 2018

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

Taxa Mínima Atuarial / Índice de Referência

Indexador por Plano/Segmento - Período de Referência: 01/2018 a 12/2018

Participação %	Plano/Segmento	Percentual Indexador	Indexador	Taxa de Juros %aa
80,00	RENDA FIXA	100,00	IMA-S	0,00
20,00	RENDA FIXA	100,00	IPCA	5,00
100,00	RENDA VARIÁVEL	100,00	IBrX	0,00
100,00	INVESTIMENTOS	100,00	DI-CETIP	0,00
100,00	IMÓVEIS	100,00	IPCA	5,54
100,00	PLANO	100,00	IMA-S	0,00

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata: null

Data: 28/12/2017

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2018 a 31/12/2018	PLANO	CLAUDIO JOSE DE SOUZA ROSA	076.454.898-04	DIRETOR

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, exceto os que fazem parte do perfil Renda Vitalícia. Como a gestão é totalmente terceirizada a responsabilidade do apuração dos ativos é dos gestores e custodiantes. Os controles de risco são realizados pelos gestores e acompanhados através de relatórios elaborados por consultoria especializada

Alocação dos Recursos

Período de Referência: 01/2018 a 12/2018			
Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
RENDA FIXA	33,00	100,00	81,00
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	5,00
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, como apoio de consultoria de investimentos no momento da definição da PI. A avaliação prévia dos riscos envolvidos na alocação dos 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	95,00	100,00
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	5,00
Moderado	RENDA FIXA	65,00	85,00
	RENDA VARIÁVEL	15,00	25,00
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00
Agressivo	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	5,00
	RENDA FIXA	42,00	68,00
	RENDA VARIÁVEL	32,00	48,00
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00
Outros	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	10,00
	RENDA FIXA	100,00	100,00

Observação: Na política de Investimentos os perfis são denominados como São Bernardo, SB Zero, SB20 e SB40

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	0,00	5,00	
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	2016	1º Sem 2017	2018	Não Aplica
PLANO	15,34	5,72	9,41	
RENTA FIXA	14,40	5,64	9,33	
RENTA VARIÁVEL	32,25	7,23	12,18	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	0,00	9,41	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR				X
IMÓVEIS	36,66	1,77	9,44	
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES				X

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

Observações

O Benchmark e o limite de risco para o Seg. de Inv. Exterior sera definido de acordo com cada estratégia de investimento no momento em que ocorrer uma aplicação. Para o seg. de Oper. com participantes o benchmark sera o maior entre o benchmark de RF e a meta atuarial