

Data de Geração: 07/01/2016 14:18:57

**Informações da Entidade**

Código: 45

Sigla: ALPHA

Exercício: 2016

Plano de Benefícios: 1999002474 - PLANO DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS BETA

**Taxa Mínima Atuarial / Índice de Referência**

**Indexador por Plano/Segmento - Período de Referência: 01/2016 a 12/2016**

Participação %	Plano/Segmento	Percentual Indexador	Indexador	Taxa de Juros %aa
100,00	PLANO	100,00	INPC	5,30
100,00	RENDA FIXA	100,00	DI-CETIP	0,00
100,00	RENDA VARIÁVEL	100,00	SMLL	0,00
100,00	IMÓVEIS	100,00	INPC	5,30
100,00	EMPRÉSTIMOS E	100,00	INPC	5,30
100,00	INVESTIMENTOS	100,00	DI-CETIP	0,00
100,00	INVESTIMENTOS NO	100,00	INPC	5,30

**Documentação/Responsáveis**

**Documentação**

Nº da Ata: 80

Data: 17/12/2015

**Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado**

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2016 a 31/12/2016	PLANO	LUIS CARLOS FELISBERTO MAIA	621.689.679-20	Diretor Administrativo e Financeiro

**Controle de Risco**

Risco de Mercado

Risco de Liquidez

Risco de Contraparte

Risco Legal

Risco Operacional

Outros

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

**Observação:** EXISTE CONTRATO COM CONSULTORIA PARA GERENCIAMENTO DE RISCOS DA CARTEIRA

**Alocação dos Recursos**

**Período de Referência: 01/2016 a 12/2016**

<b>Segmento</b>	<b>Mínimo %</b>	<b>Máximo %</b>	<b>Alvo %</b>
RENDA FIXA	45,00	100,00	86,65
RENDA VARIÁVEL	0,00	20,00	3,80
IMÓVEIS	0,00	5,00	2,37
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	15,00	3,89
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00	3,29
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	5,00	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:

**Perfis de Investimento**

O plano possui Perfis de Investimentos? Não

Observação:

**Alocação por Emissor**

<b>Emissor</b>	<b>Mínimo%</b>	<b>Máximo%</b>	<b>Não Aplica</b>
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	10,00	
ORGANISMO MULTILATERAL	0,00	2,50	
COMPANHIA SECURITIZADORA	0,00	2,50	
PATROCINADOR DO PLANO DE BENEFÍCIO	0,00	10,00	
FIDC/FICFIDC	0,00	2,50	
FUNDOS DE ÍNDICE REFERENCIADO EM CESTA DE AÇÕES DE CIA ABERTA	0,00	5,00	
SOCIEDADE DE PROPÓSITO ESPECÍFICO - SPE	0,00	5,00	
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	25,00	
% DO CAPITAL TOTAL DE UMA MESMA CIA ABERTA OU DE UMA SPE	0,00	25,00	
% DO PL DE UMA MESMA INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	0,00	25,00	
% DO PL DE FUNDO DE ÍNDICE REFERENCIADO EM CESTA DE AÇÕES DE CIA ABERTA	0,00	25,00	
% DO PL DE FUNDO DE INVESTIMENTO CLASSIFICADO NO SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	25,00	
% 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:** DE ACORDO COM A RESOLUÇÃO Nº 4.275, DE 31 DE OUTUBRO DE 2013, O LIMITE DE 25% DE PARTICIPAÇÃO NO CAPITAL DE UMA SPE PODE SER ELEVADO PARA 30% CASO A SPE SEJA CONSTITUÍDA EXCLUSIVAMENTE PARA ATUAR COMO CONCESSIONÁRIA, PERMISSONÁRIA, ARRENDATÁRIA OU AUTORIZATÁRIA

## Concentração por Investimento

Emissor	Mínimo%	Máximo%	Não Aplica
% DE UMA SÉRIE DE TÍTULOS OU VALORES MOBILIÁRIOS	0,00	25,00	
% DE UMA MESMA CLASSE OU SÉRIE DE COTAS DE FIDC	0,00	25,00	
% DE UM MESMO EMPREENDIMENTO IMOBILIÁRIO	0,00	25,00	

**Observação:**

## Rentabilidade(%)

Plano/Segmento	2014	1º Sem 2015	2016	Não Aplica
PLANO	9,58	5,34	12,23	
RENDA FIXA	13,26	7,56	12,14	
RENDA VARIÁVEL	-20,37	-22,94	14,27	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	4,67	4,34	12,14	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	23,32	15,50	12,14	
IMÓVEIS	1,25	0,71	12,14	
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	14,32	7,34	12,14	

**Observação:** OS DADOS DE RENTABILIDADE FORAM PREENCHIDOS EM CONFORMIDADE COM O MANUAL DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS E O CONSTANTE NO PORTAL SICAD. A RENTABILIDADE DE 2016 FOI PROJETADA. A METODOLOGIA UTILIZADA PARA CÁLCULO FOI A TIR CONTÁBIL.

## Observações

PARA OS DADOS DA RENTABILIDADE, FOI UTILIZADA A METODOLOGIA DO CÁLCULO PELA TIR CONTÁBIL.

