

Data de Geração: 05/01/2017 16:40:45

Informações da Entidade

Código: 45

Sigla: ALPHA

Exercício: 2017

Plano de Benefícios: 1999002474 - PLANO DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS BETA

Taxa Mínima Atuarial / Índice de Referência

Indexador por Plano/Segmento - Período de Referência: 01/2017 a 12/2017

Participação %	Plano/Segmento	Percentual Indexador	Indexador	Taxa de Juros %aa
100,00	PLANO	100,00	INPC	5,20
100,00	RENDA FIXA	100,00	DI-CETIP	0,00
100,00	RENDA VARIÁVEL	100,00	IBOVESPA	0,00
100,00	INVESTIMENTOS	100,00	DI-CETIP	2,00
100,00	INVESTIMENTOS NO	100,00	INPC	5,20
100,00	IMÓVEIS	100,00	INPC	5,20
100,00	EMPRÉSTIMOS E	100,00	INPC	5,20

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata: 83

Data: 19/12/2016

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2017 a 31/12/2017	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 apuração 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: 01/2017 a 12/2017			
Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
RENDA FIXA	45,00	100,00	87,83
RENDA VARIÁVEL	0,00	20,00	2,83
IMÓVEIS	0,00	5,00	2,40
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	15,00	3,76
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00	3,18
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

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	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: O % DO CAPITAL TOTAL DE UMA MESMA COMPANHIA ABERTA OU DE UMA MESMA SPE, O LIMITE PASSA A SER DE 30% PARA SPE CONSTITUÍDA EXCLUSIVAMENTE PARA ATUAR COMO CONCESSIONÁRIA, PERMISSIONÁRIA, ARRENDATÁRIA OU AUTORIZATÁRIA, CONFORME REDAÇÃO EXPRESSA NA RESOLUÇÃO BACEN 4275 DE 31 DE OUTUBRO DE 2013.

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: NO % DE UMA MESMA SÉRIE DE TÍTULOS OU VALORES MOBILIÁRIOS, EXCETO AÇÕES, BÔNUS DE SUBSCRIÇÃO DE AÇÕES, RECIBOS DE SUBSCRIÇÃO DE AÇÕES, CERTIFICADOS DE RECEBÍVEIS EMITIDOS COM ADOÇÃO DE REGIME FIDUCIÁRIO E DEBÊNTURES DE INFRAESTRUTURA.

Rentabilidade(%)

Plano/Segmento	2015	1º Sem 2016	2017	Não Aplica
PLANO	11,21	7,32	10,46	
RENDA FIXA	14,10	7,64	11,51	
RENDA VARIÁVEL	-36,97	3,39	14,87	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	10,08	8,21	13,72	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	44,00	-19,04	10,46	
IMÓVEIS	22,24	0,71	10,46	
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	16,35	8,55	10,46	

Observação: OS DADOS DE RENTABILIDADE FORAM PREENCHIDOS EM CONFORMIDADE COM O MANUAL DA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS E O CONSTANTE NO PORTAL SICADI. A RENTABILIDADE DE 2017 FOI PROJETADA. A METODOLOGIA ADOTADA FOI A TIR CONTÁBIL.

Observações

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

