

Data de Geração: 11/01/2018 17:37:41

Informações da Entidade

Código: 45

Sigla: ALPHA

Exercício: 2018

Plano de Benefícios: 1999002474 - PLANO DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS BETA

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
100,00	PLANO	100,00	INPC	5,10
100,00	RENTA FIXA	100,00	DI-CETIP	0,00
100,00	RENTA VARIÁVEL	100,00	IBOVESPA	0,00
100,00	INVESTIMENTOS	100,00	DI-CETIP	2,00
100,00	INVESTIMENTOS NO	100,00	INPC	5,10
100,00	IMÓVEIS	100,00	INPC	5,10
100,00	EMPRÉSTIMOS E	100,00	INPC	5,10

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata: 88

Data: 13/12/2017

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2018 a 31/12/2018	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: 01/2018 a 12/2018			
Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
RENTA FIXA	45,00	100,00	86,83
RENTA VARIÁVEL	0,00	20,00	3,85
IMÓVEIS	0,00	5,00	2,12
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	15,00	3,68
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00	3,52
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 4.275 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: 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	2016	1º Sem 2017	2018	Não Aplica
PLANO	13,91	5,52	9,60	
RENTA FIXA	14,13	5,16	10,64	
RENTA VARIÁVEL	12,11	21,01	13,97	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	19,36	5,98	12,83	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	-9,34	7,73	9,60	
IMÓVEIS	1,46	0,85	9,60	
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	18,33	7,64	9,60	

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 2018 FOI PROJETADA. A METODOLOGIA ADOTADA FOI A TIR CONTÁBIL.

Observações

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

