

Data de Geração: 24/01/2013 14:53:23

Informações da Entidade

Código: 919

Sigla: SAO BERNARDO

Exercício: 2013

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

Taxa Mínima Atuarial / Índice de Referência

Indexador por Plano/Segmento - Período de Referência: 01/2013 a 12/2013

Participação %	Plano/Segmento	Percentual Indexador	Indexador	Taxa de Juros %aa
100,00	PLANO	100,00	IGP-DI	6,00
100,00	RENDA FIXA	100,00	IMA Geral	0,00
100,00	RENDA VARIÁVEL	100,00	IBOVESPA	0,00
100,00	IMÓVEIS	100,00	IGP-DI	6,00
100,00	EMPRÉSTIMOS E	100,00	SELIC	0,00

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata: null

Data: 28/12/2012

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2013 a 31/12/2013	PLANO	JOAO ALDO ARDITO	044.360.328-68	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: Sim	Dispõe de Manual: Não
Possui modelo proprietário de risco: Sim	Dispõe de Manual: Não
Realiza Estudos de ALM: Não	

Observação: 1) Todos os ativos são marcados a mercado. Como a gestão é totalmente terceirizada, a responsabilidade pelo apuração dos ativos é dos gestores e custodiantes. 2) 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: 01/2013 a 12/2013			
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
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 Política de Investimentos. 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 Política de Investimentos.

Perfis de Investimento

O plano possui Perfis de Investimentos? Sim			
Perfil	Segmento	Mínimo%	Máximo%
Conservador	RENDA FIXA	92,00	100,00
	IMÓVEIS	0,00	8,00
Moderado	RENDA FIXA	75,00	85,00
	RENDA VARIÁVEL	15,00	25,00
Agressivo	RENDA FIXA	52,00	68,00
	RENDA VARIÁVEL	32,00	48,00

Observação: Na Política de Investimentos os perfis estão denominados da seguinte forma Conservador = SB Zero / Moderado = SB 20 / Agressivo = SB 40

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			x
% DO PL DE FUNDOS DE ÍNDICE NO EXTERIOR NEGOCIADOS EM BOLSA DE VALORES NO BRASIL			x
% 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	2011	2012	2013	Não Aplica
PLANO	11,71	7,01	10,36	
RENDA FIXA	12,77	7,07	7,92	
RENDA VARIÁVEL	-14,34	0,00	22,85	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS				x
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR				x
IMÓVEIS	5,56	3,18	10,36	
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00	0,00	7,37	

Observação: As projeções são efetuadas através das premissas retradas do relatório FOCUS (BACEN) e utilizando modelo econométrico propretário da Towers Watson / A rentabilidade de 2012 refere-se ao 1º sem.

Observações

O bench. de Renda Fixa é IMA-Geral Ex C porém como este índice na lista de indexador, foi considerado o IMA-Geral. A Entidade atualmente não oferece Empréstimos e Financiamentos porém, se for oferecer durante 2013, a taxa de concessão deverá ser no mínimo maior que o bench de renda fixa (Taxa Selic) e a meta atuarial acrescida dos custos envolvidos com a gestão dos empréstimos.

