

Data de Geração: 17/03/2015 15:31:35

Informações da Entidade

Código: 922

Sigla: SAO FRANCISCO

Exercício: 2015

Plano de Benefícios: 1981001018 - PLANO DE BENEFICIOS I

Taxa Mínima Atuarial / Índice de Referência

Período de Referência	Indexador	Taxa de Juros
01/2015 a 12/2015	INPC	5,25

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata: 54º

Data: 15/12/2014

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2015 a 31/12/2015	PLANO	MARCOS ANDRE PRANDI	152.433.621-15	DIRETOR DE FINANÇAS

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:

Alocação dos Recursos

Período de Referência: 01/2015 a 12/2015

Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
RENDA FIXA	40,00	100,00	60,00
RENDA VARIÁVEL	0,00	70,00	20,00
IMÓVEIS	0,00	2,00	1,00
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	5,00	2,00
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	20,00	16,00
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	1,00	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: As operações nos mercados de derivativos serão realizadas tanto para proteção de carteira (hedge) como para exposição direcional, nos mandatos dos Fundos Exclusivos. Na Carteira Própria não são utilizados.

Perfis de Investimento

O plano possui Perfis de Investimentos? Não

Observação:

Alocação por Emissor

Emissor	Mínimo%	Máximo%	Não Aplica
TESOURO NACIONAL	10,00	100,00	
INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	0,00	20,00	
TESOURO ESTADUAL OU MUNICIPAL	0,00	10,00	
COMPANHIA ABERTA COM REGISTRO NA CVM	0,00	10,00	
ORGANISMO MULTILATERAL	0,00	10,00	
COMPANHIA SECURITIZADORA	0,00	10,00	
PATROCINADOR DO PLANO DE BENEFÍCIO			x
FIDC/FICFIDC	0,00	10,00	
FUNDOS DE ÍNDICE REFERENCIADO EM CESTA DE AÇÕES DE CIA ABERTA	0,00	10,00	
SOCIEDADE DE PROPÓSITO ESPECÍFICO - SPE	0,00	10,00	
FI/FICFI CLASSIFICADOS NO SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00	

Observação: Ajuste no percentual máximo dos Fundos de Índice Referenciado em Cesta de Ações de Cia. Aberta de 35% para 10% conforme a Resolução 3792/2009, na presente data de 17/03/2015.

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	30,00	
% 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			x
% DO PL DE FUNDOS DE ÍNDICE NO EXTERIOR NEGOCIADOS EM BOLSA DE VALORES NO BRASIL	0,00	25,00	
% DO PATRIMÔNIO SEPARADO DE CERTIFICADOS DE RECEBÍVEIS COM REGIME FIDUCIÁRIO	0,00	25,00	

Observação:

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			x
% DE UM MESMO EMPREENDIMENTO IMOBILIÁRIO			x

Observação:

Rentabilidade(%)

Plano/Segmento	2013	1º Sem 2014	2015	Não Aplica
PLANO	5,88	5,06	13,24	
RENDA FIXA	15,22	7,81	14,64	
RENDA VARIÁVEL	-10,39	1,32	12,91	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	-2,12	-0,41	7,94	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	0,00	0,00	
IMÓVEIS	6,18	-0,55	0,00	
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	19,61	13,35	22,99	

Observação:

Observações

- A rentabilidade descrita para o exercício de 2015, trata-se de valores estimados, com base no cenário econômico.
- A Fundação utiliza o cálculo da cota modificada para apuração da rentabilidade das carteiras dos planos.
- O indexador (INPC) utilizado refere-se ao do mês anterior.

