

Data de Geração: 22/12/2016 09:56:14

Informações da Entidade

Código: 922 Sigla: SAO FRANCISCO Exercício: 2017
Plano de Benefícios: 2013000847 - PLANO DE BENEFÍCIOS II

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 | 3,50 |

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata: 62ª

Data: 20/12/2016

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

| Período | Segmento | Nome | CPF | Cargo |
|-------------------------|----------|---------------------|----------------|---------------------|
| 01/01/2017 a 31/12/2017 | 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: Não |
| Possui modelo proprietário de risco: Não | Dispõe de Manual: Não |
| Realiza Estudos de ALM: Não | |

Observação:

Alocação dos Recursos

| Período de Referência: 01/2017 a 12/2017 | | | |
|--|----------|----------|--------|
| Segmento | Mínimo % | Máximo % | Alvo % |
| RENDA FIXA | 65,00 | 100,00 | 70,00 |
| RENDA VARIÁVEL | 0,00 | 20,00 | 20,00 |
| EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS | 0,00 | 10,00 | 10,00 |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | 0,00 | 5,00 | 3,00 |
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | 0,00 | 10,00 | 4,00 |
| A EFPC observa os princípios de responsabilidade socioambiental? Sim | | | |
| Utiliza derivativos? Não | | | |

Observação:

| 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 | | | x |
| SOCIEDADE DE PROPÓSITO ESPECÍFICO - SPE | 0,00 | 10,00 | |
| FI/FICFI CLASSIFICADOS NO SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | 0,00 | 10,00 | |

Observação: - Debêntures de Infraestrutura/Inciso IX - Artigo 18, Resolução nº 4.449, de 20.11.2015 - Mínimo: 0,00% e Máximo: 15,00%.

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 | 0,00 | 25,00 | |
| % 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 | 0,00 | 25,00 | |
| % DE UM MESMO EMPREENDIMENTO IMOBILIÁRIO | 0,00 | 25,00 | |

Observação:

Rentabilidade(%)

| Plano/Segmento | 2015 | 1º Sem 2016 | 2017 | Não Aplica |
|------------------------------------|-------|-------------|-------|------------|
| PLANO | 16,42 | 11,23 | 14,75 | |
| RENDA FIXA | 16,57 | 11,24 | 14,86 | |
| RENDA VARIÁVEL | 0,00 | 0,00 | 15,14 | |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | 12,99 | 6,68 | 12,53 | |
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | | | | x |
| IMÓVEIS | | | | x |
| OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES | | | | x |

Observação:

Observações

A rentabilidade descrita para o exercício de 2017, trata-se de valores estimados, com base no cenário macroeconômico 2017/2021.

- A Fundação utiliza o cálculo da cota modificada para apuração da rentabilidade das carteiras dos planos.
- O Indexador de Referência é o INPC relativo ao mês de apuração.

