

Data de Geração: 18/12/2017 16:40:34

Informações da Entidade

Código: 2021 Sigla: SIAS Exercício: 2018
Plano de Benefícios: 9970000000 - PLANO DE GESTÃO ADMINISTRATIVA

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	DI-CETIP	1,00

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata: 007/2017

Data: 14/12/2017

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2018 a 31/12/2018	PLANO	LUIZ AUGUSTO B DE MACEDO	597.717.637-68	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: Não
Possui modelo proprietário de risco: Sim	Dispõe de Manual: Não
Realiza Estudos de ALM: Sim	

Observação: O Modelo Próprio de Risco, assessorado por consultoria externa, contempla questões técnicas acerca do risco de mercado, de crédito e liquidez dos investimentos do plano. Além disso, contempla um relatório de performance informando a rentabilidade dos investimentos, do plano e a meta atuarial. A SIAS adotou o VaR na avaliação do risco de mercado.

Alocação dos Recursos

Período de Referência: 01/2018 a 12/2018

Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
RENDA FIXA	0,00	100,00	91,61
RENDA VARIÁVEL	0,00	20,00	4,97
IMÓVEIS	0,00	8,00	0,05
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	15,00	0,00
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00	3,36
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	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: Os limites para investimentos em títulos e valores mobiliários de emissão e/ou coobrigação de uma mesma pessoa jurídica devem respeitar os limites legais estabelecidos nas Resoluções CMN 3.792 e 4.611 e na Resolução BACEN nº 4.275. A SIAS não realizará operações de derivativos, via carteira própria. Caso tais operações venham a ser realizadas por gestores externos, as mesmas devem respeitar os limites legais estabelecidos pela Resolução CMN nº 3.792 e na Resolução BACEN nº 4.275.

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	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	0,00	10,00	
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: São considerados elegíveis para compor a carteira de investimentos do plano de benefícios todos os ativos classificados nos segmentos de aplicação, conforme previsto nas Resoluções CMN nº 3.792 e 4.611 e na Resolução BACEN nº 4.275, respeitando os limites de alocação por emissor das legislações.

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	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: São considerados elegíveis para compor a carteira de investimentos do plano de benefícios todos os ativos classificados nos segmentos de aplicação, conforme previsto nas Resoluções CMN nº 3.792 e 4.611 e na Resolução BACEN nº 4.275, respeitando os limites de alocação por emissor das legislações.

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: São considerados elegíveis para compor a carteira de investimentos do plano de benefícios todos os ativos classificados nos segmentos de aplicação, conforme previsto nas Resoluções CMN nº 3.792 e 4.611 e na Resolução BACEN nº 4.275, respeitando os limites de alocação por emissor das legislações.

Rentabilidade(%)

Plano/Segmento	2016	1º Sem 2017	2018	Não Aplica
PLANO	13,20	4,81	9,98	
RENDA FIXA	13,17	4,58	9,98	
RENDA VARIÁVEL	-1,94	11,35	16,21	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	18,79	4,50	12,76	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	0,00	0,00	
IMÓVEIS	0,00	0,00	0,00	
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	0,00	0,00	0,00	

Observação: A rentabilidade dos investimentos é calculada pelo método de Cotização Adaptada.

Observações

A rentabilidade dos investimentos é calculada pelo método de Cotização Adaptada. O método e as fontes de referência adotadas para apuração dos ativos pela Entidade são os mesmos estabelecidos pelo agente custodiante e estão disponíveis no Manual de Apuração do mesmo.

