

Data de Geração: 20/02/2019 14:26:20

**Informações da Entidade**

Código: 2021 Sigla: SIAS Exercício: 2019  
Plano de Benefícios: 9970000000 - PLANO DE GESTÃO ADMINISTRATIVA

**Taxa Mínima Atuarial / Índice de Referência**

**Indexador por Plano/Segmento - Período de Referência: 01/2019 a 12/2019**

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: 006/2018

Data: 18/12/2018

**Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado**

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2019 a 31/12/2019	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: Não	

**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 e o B-VaR na avaliação do risco de mercado.

**Alocação dos Recursos**

**Período de Referência: 01/2019 a 12/2019**

Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
RENDA FIXA	0,00	100,00	91,62
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	15,00	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 na Resolução CMN 4.661. 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 4.661.

### 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 na Resolução CMN nº 4.661, respeitando os limites de alocação por emissor da legislação.

## 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 na Resolução CMN nº 4.661, respeitando os limites de alocação por emissor da legislação.

## 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	20,00	

**Observação:** São considerados elegíveis para compor a carteira de investimentos do plano de benefícios todos os ativos classificados nos segmentos de aplicação, conforme previsto na Resolução CMN nº 4.661, respeitando os limites de alocação por emissor da legislação.

## Rentabilidade(%)

Plano/Segmento	2017	1º Sem 2018	2019	Não Aplica
PLANO	10,27	10,15	9,90	
RENDA FIXA	9,02	10,17	9,90	
RENDA VARIÁVEL	31,18	6,84	12,50	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	13,88	5,86	10,42	
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.

