

Data de Geração: 03/01/2018 17:41:13

**Informações da Entidade**

Código: 415

Sigla: FASERN

Exercício: 2018

Plano de Benefícios: 1998006565 - PLANO MISTO DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS Nº 001

**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 |
|----------------|------------------|----------------------|-----------|-------------------|
| 60,00          | RENDA FIXA       | 60,00                | DI-CETIP  | 0,00              |
| 40,00          | RENDA FIXA       | 40,00                | IMA-B     | 0,00              |
| 100,00         | RENDA VARIÁVEL   | 100,00               | IBrX      | 0,00              |
| 100,00         | EMPRÉSTIMOS E    | 100,00               | INPC      | 4,85              |
| 100,00         | IMÓVEIS          | 100,00               | INPC      | 0,00              |
| 100,00         | INVESTIMENTOS    | 100,00               | INPC      | 5,50              |
| 100,00         | INVESTIMENTOS NO | 100,00               | INPC      | 5,50              |

**Documentação/Responsáveis**

**Documentação**

Nº da Ata: 109ª\_RO

Data: 29/12/2017

**Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado**

| Período                 | Segmento | Nome                         | CPF            | Cargo              |
|-------------------------|----------|------------------------------|----------------|--------------------|
| 01/01/2018 a 31/12/2018 | PLANO    | PAULO CESAR SOARES DOS ANJOS | 230.388.374-15 | DIRETOR FINANCEIRO |

**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: Sim |
| Possui modelo proprietário de risco: Sim      | Dispõe de Manual: Sim |
| Realiza Estudos de ALM: Não                   |                       |

**Observação:** O índice de referência do segmento de renda fixa do plano CD possui mandato híbrido igual a 60% CDI + 40% IMA-B.

**Alocação dos Recursos**

**Período de Referência: 01/2018 a 12/2018**

| Segmento   | Mínimo % | Máximo % | Alvo % |
|--|----------|----------|--------|
| RENDA FIXA   | 40,00    | 93,30    | 75,59  |
| RENDA VARIÁVEL   | 6,70     | 60,00    | 21,79  |
| IMÓVEIS  | 0,00     | 4,00     | 0,00   |
| EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS   | 0,00     | 8,00     | 2,62   |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS   | 0,00     | 10,00    | 0,00   |
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR  | 0,00     | 5,00     | 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 com instrumentos derivativos com os recursos do Plano CD é permitida para proteção das carteiras e dos ativos, podendo haver exposição de até 100%, observado os limites e condições estabelecidos no Artigo 44 da Resolução CMN nº 3.792 e alterações posteriores.

**Perfis de Investimento**

O plano possui Perfis de Investimentos? Sim

| Perfil      | Segmento                     | Mínimo% | Máximo% |
|-------------|------------------------------|---------|---------|
| Conservador | RENDA FIXA                   | 90,00   | 93,30   |
|             | RENDA VARIÁVEL               | 6,70    | 10,00   |
|             | EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS | 0,00    | 8,00    |
| Moderado    | RENDA FIXA                   | 80,00   | 86,60   |
|             | RENDA VARIÁVEL               | 13,40   | 20,00   |
|             | EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS | 0,00    | 8,00    |
| Agressivo   | RENDA FIXA                   | 60,00   | 73,30   |
|             | RENDA VARIÁVEL               | 26,70   | 40,00   |
|             | EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS | 0,00    | 8,00    |
| Outros      | RENDA FIXA                   | 70,00   | 80,00   |
|             | RENDA VARIÁVEL               | 20,00   | 30,00   |
|             | EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS | 0,00    | 8,00    |

**Observação:** Os dados informados para Outros no quadro acima refere-se ao Perfil Moderado Plus.  
 Perfil Agressivo Plus  
 Renda Fixa - Min% 40,00% Máx% 60,00%; Renda Variável - Min% 40,00% Máx% 60,00%; Empréstimos e Financiamentos - Min% 0,00% Máx% 8,00%.

## Alocação por Emissor

| Emissor  | Mínimo% | Máximo% | Não Aplica |
|--|---------|---------|------------|
| TESOURO NACIONAL   | 0,00    | 93,30   |            |
| INSTITUIÇÃO FINANCEIRA   | 0,00    | 20,00   |            |
| TESOURO ESTADUAL OU MUNICIPAL                                    |         |         | x          |
| COMPANHIA ABERTA COM REGISTRO NA CVM                             | 0,00    | 10,00   |            |
| ORGANISMO MULTILATERAL   |         |         | x          |
| COMPANHIA SECURITIZADORA   |         |         | x          |
| 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:

## Concentração por Emissor

| Emissor  | Mínimo% | Máximo% | Não Aplica |
|--|---------|---------|------------|
| % DO CAPITAL VOTANTE DE UMA MESMA CIA ABERTA   | 0,00    | 10,00   |            |
| % DO CAPITAL TOTAL DE UMA MESMA CIA ABERTA OU DE UMA SPE                                 | 0,00    | 10,00   |            |
| % 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 | 0,00    | 5,00    |            |
| % 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    | 5,00    |            |

Observação:

## Concentração por Investimento

| Emissor  | Mínimo% | Máximo% | Não Aplica |
|--|---------|---------|------------|
| % DE UMA SÉRIE DE TÍTULOS OU VALORES MOBILIÁRIOS | 0,00    | 15,00   |            |
| % 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                     | 2016  | 1º Sem 2017 | 2018  | Não Aplica |
|------------------------------------|-------|-------------|-------|------------|
| <b>PLANO</b>                       | 22,01 | 5,42        | 8,15  |            |
| <b>RENDA FIXA</b>                  | 18,25 | 5,47        | 6,90  |            |
| <b>RENDA VARIÁVEL</b>              | 39,54 | 5,31        | 12,35 |            |
| <b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>  | 0,00  | 0,00        | 10,18 |            |
| <b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>   | 0,00  | 0,00        | 10,18 |            |
| <b>IMÓVEIS</b>                     | 0,00  | 0,00        | 6,17  |            |
| <b>OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES</b> | 13,93 | 4,56        | 9,51  |            |

**Observação:** A rentabilidade é calculada pelo método da Cotação Adaptada.

## Observações

Os prestadores de serviços de gestão de recursos do plano CD deverão realizar a avaliação prévia dos riscos envolvidos nas operações com derivativos, observando os limites e condições estabelecidos no disposto do Artigo 44, da Resolução nº 3.792 e de suas alterações subsequentes.