

Data de Geração: 03/01/2018 16:12:32

Informações da Entidade

Código: 415

Sigla: FASERN

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 | RENDA FIXA | 100,00 | SELIC | 0,00 |

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 apreçamento de ativos financeiros: Sim | Dispõe de Manual: Sim |
| Possui modelo proprietário de risco: Sim | Dispõe de Manual: Sim |
| Realiza Estudos de ALM: Não | |

Observação:

Alocação dos Recursos

| Período de Referência: 01/2018 a 12/2018 | | | |
|--|----------|----------|--------|
| Segmento | Mínimo % | Máximo % | Alvo % |
| RENDA FIXA | 0,00 | 100,00 | 100,00 |
| 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: A realização de operações com instrumentos derivativos com os recursos do PGA é permitida para proteção das carteiras dos ativos até o limite das posições à vista, observado os limites estabelecidos no Artigo nº 44 da Resolução nº 3.792 do CMN e suas alterações subsequentes.

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 | | | X |
| TESOURO ESTADUAL OU MUNICIPAL | | | X |
| COMPANHIA ABERTA COM REGISTRO NA CVM | | | X |
| ORGANISMO MULTILATERAL | | | X |
| COMPANHIA SECURITIZADORA | | | X |
| PATROCINADOR DO PLANO DE BENEFÍCIO | | | X |
| FIDC/FICFIDC | | | X |
| FUNDOS DE ÍNDICE REFERENCIADO EM CESTA DE AÇÕES DE CIA ABERTA | | | X |
| SOCIEDADE DE PROPÓSITO ESPECÍFICO - SPE | | | X |
| FI/FICFI CLASSIFICADOS NO SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | | | X |

Observação:

Concentração por Emissor

| Emissor | Mínimo% | Máximo% | Não Aplica |
|--|---------|---------|------------|
| % DO CAPITAL VOTANTE DE UMA MESMA CIA ABERTA | | | X |
| % DO CAPITAL TOTAL DE UMA MESMA CIA ABERTA OU DE UMA SPE | | | X |
| % DO PL DE UMA MESMA INSTITUIÇÃO FINANCEIRA | | | X |
| % DO PL DE FUNDO DE ÍNDICE REFERENCIADO EM CESTA DE AÇÕES DE CIA ABERTA | | | X |
| % DO PL DE FUNDO DE INVESTIMENTO CLASSIFICADO NO SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | | | X |
| % 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 | | | X |
| % DO PATRIMÔNIO SEPARADO DE CERTIFICADOS DE RECEBÍVEIS COM REGIME FIDUCIÁRIO | | | X |

Observação:

Concentração por Investimento

| Emissor | Mínimo% | Máximo% | Não Aplica |
|--|---------|---------|------------|
| % DE UMA SÉRIE DE TÍTULOS OU VALORES MOBILIÁRIOS | 0,00 | 5,00 | |
| % DE UMA MESMA CLASSE OU SÉRIE DE COTAS DE FIDC | | | X |
| % DE UM MESMO EMPREENDIMENTO IMOBILIÁRIO | | | X |

Observação:

Rentabilidade(%)

| Plano/Segmento | 2016 | 1º Sem 2017 | 2018 | Não Aplica |
|-----------------------------|-------|-------------|------|------------|
| PLANO | 13,78 | 5,65 | 7,00 | |
| RENDA FIXA | 13,78 | 5,65 | 7,00 | |
| RENDA VARIÁVEL | | | | X |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | | | | X |
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | | | | X |
| IMÓVEIS | | | | X |
| OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES | | | | X |

Observação: A rentabilidade é calculada pelo método da Cotização Adaptada.

Observações

