

Data de Geração: 18/12/2017 16:47:03

Informações da Entidade

Código: 2021

Sigla: SIAS

Exercício: 2018

Plano de Benefícios: 2013001118 - PLANO DE APOSENTADORIA SIAS

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 | INPC | 5,50 |

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: 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 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 | 91,62 |
| 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 | 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 concentração 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 concentração 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.

