

Data de Geração: 08/12/2017 12:11:57

Informações da Entidade

Código: 1818

Sigla: PREVI NOVARTIS

Exercício: 2018

Plano de Benefícios: 2002000174 - PLANO DE BENEFÍCIOS D

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	IGP-DI	4,00
55,00	RENDA FIXA	100,00	IMA-S	0,00
20,00	RENDA FIXA	100,00	IMA-B 5	0,00
15,00	RENDA FIXA	100,00	IRF-M	0,00
10,00	RENDA FIXA	100,00	IMA-B 5+	0,00
100,00	INVESTIMENTOS	100,00	DI-CETIP	0,00
100,00	RENDA VARIÁVEL	100,00	IBrX	0,00
50,00	INVESTIMENTOS NO	100,00	DI-CETIP	0,00
50,00	INVESTIMENTOS NO	100,00	MSCI-World	0,00

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata: null

Data: 08/11/2017

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2018 a 31/12/2018	PLANO	MUCIO DE CAMPOS MAIA NETO	064.357.868-44	DIRETOR

Controle de Risco

Risco de Mercado

Risco de Liquidez

Risco de Contraparte

Risco Legal

Risco Operacional

Outros

Realiza o apreamento de ativos financeiros: Não	Dispõe de Manual: Não
Possui modelo proprietário de risco: Sim	Dispõe de Manual: Não
Realiza Estudos de ALM: Sim	

Observação: Todos os ativos são marcados a Mercado, exceto os que fazem parte do perfil Renda Vitalícia. Como a gestão é totalmente terceirizada a responsabilidade do apreamento dos ativos é dos gestores e custodiantes. Os controles de risco são realizados pelos gestores e acompanhados através de relatórios elaborados por consultoria especializada

Alocação dos Recursos

Período de Referência: 01/2018 a 12/2018

Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
RENDA FIXA	30,00	100,00	71,00
RENDA VARIÁVEL	0,00	40,00	15,00
IMÓVEIS	0,00	5,00	0,00
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	5,00	0,00
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00	7,00
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	10,00	7,00
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 Entidade realiza avaliação prévia dos riscos envolvidos na definição da alocação estratégica nas diferentes classes de ativos, como apoio de consultoria de investimentos no momento da definição da PI. A avaliação prévia dos riscos envolvidos na alocação dos ativos e derivativos é de responsabilidade dos gestores de recursos, devendo seguir as diretrizes definidas na PI

Perfis de Investimento

O plano possui Perfis de Investimentos? Sim

Perfil	Segmento	Mínimo%	Máximo%
Conservador	RENDA FIXA	77,00	100,00
	IMÓVEIS	0,00	5,00
	EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	5,00
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	10,00
Moderado	RENDA FIXA	50,00	100,00
	RENDA VARIÁVEL	0,00	20,00
	IMÓVEIS	0,00	5,00
	EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	5,00
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00
Agressivo	RENDA FIXA	30,00	100,00
	RENDA VARIÁVEL	0,00	40,00
	IMÓVEIS	0,00	5,00
	EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	5,00
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00
Outros	RENDA FIXA	80,00	100,00
	IMÓVEIS	0,00	5,00
	EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	5,00
	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00

Observação: O perfil Outros refere-se ao perfil Super Conservador. A entidade também possui um perfil denominada Renda Vitalícia destinada aos ativos concedidos e a conceder sob forma de Benefício Definido

Alocação por Emissor

Emissor	Mínimo%	Máximo%	Não Aplica
TESOURO NACIONAL	0,00	100,00	
INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	0,00	20,00	
TESOURO ESTADUAL OU MUNICIPAL			x
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			x
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	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	10,00	
% 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:

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	5,00	

Observação:

Rentabilidade(%)

Plano/Segmento	2016	1º Sem 2017	2018	Não Aplica
PLANO	16,02	5,38	8,50	
RENTA FIXA	15,76	5,33	9,89	
RENTA VARIÁVEL	34,43	6,48	12,18	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	18,60	6,41	9,41	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	-13,55	11,88	10,66	
IMÓVEIS				X
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES				X

Observação: As projeções são efetuadas através de premissas retiradas do relatório FOCUS (BACEN) e utilizando modelo econométrico proprietário da Willis Towers Watson

Observações

--