

Data de Geração: 12/01/2016 14:53:12

Informações da Entidade

Código: 1818

Sigla: PREVI NOVARTIS

Exercício: 2016

Plano de Benefícios: 1997001365 - PLANO DE BENEFÍCIOS A

Taxa Mínima Atuarial / Índice de Referência

Indexador por Plano/Segmento - Período de Referência: 01/2016 a 12/2016

Participação %	Plano/Segmento	Percentual Indexador	Indexador	Taxa de Juros %aa
100,00	PLANO	100,00	IGP-DI	4,00
100,00	RENDA FIXA	100,00	IMA-S	0,00
100,00	RENDA VARIÁVEL	100,00	IBrX	0,00
100,00	INVESTIMENTOS	100,00	DI-CETIP	0,00
100,00	INVESTIMENTOS NO	100,00	MSCI-World	0,00

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata: null

Data: 15/12/2015

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2016 a 31/12/2016	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 apuração 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 de Renda Vitalícia. Como a gestão é totalmente terceirizada, a responsabilidade pelo apuração dos ativos é dos gestores e custodiantes. Os controles de riscos são realizados pelos gestores de recursos e acompanhados através de relatórios elaborados por consultoria especializada.

Alocação dos Recursos

Período de Referência: 01/2016 a 12/2016			
Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
RENDA FIXA	30,00	100,00	75,00
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	5,00
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	10,00	5,00
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, com o apoio da consultoria de investimentos no momento da definição da PI. A avaliação prévia dos riscos envolvidos na alocação de 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
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	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	10,00
	RENDA FIXA	30,00	100,00
	RENDA VARIÁVEL	0,00	40,00
	IMÓVEIS	0,00	5,00
	EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	5,00
Outros	INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	10,00
	INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	10,00
	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 denominado 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	3,00	
% 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	2014	1º Sem 2015	2016	Não Aplica
PLANO	11,19	6,93	10,11	
RENDA FIXA	11,73	6,93	13,93	
RENDA VARIÁVEL	2,27	6,27	10,37	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	6,67	13,93	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	0,00	10,89	
IMÓVEIS				X
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES				X

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

Observações

A entidade possui dois benchmarks de Renda Fixa sendo o IMA-S para o Perfil Super Conservador e o bench Composto (20% IMA-S) + (14,4% IRF-M1) + (25,6% IRF-M1+) + (30% IMA-B5) + (10% IMA-B5+) para os perfis Conservador, Moderado e Agressivo.