

Data de Geração: 14/01/2019 11:21:39

Informações da Entidade

Código: 3602

Sigla: BRF PREVIDÊNCIA

Exercício: 2019

Plano de Benefícios: 2009000511 - PLANO BENEFÍCIOS II

Taxa Mínima Atuarial / Índice de Referência

Indexador por Plano/Segmento - Período de Referência: 01/2019 a 12/2019

Participação %	Plano/Segmento	Percentual Indexador	Indexador	Taxa de Juros %aa
100,00	PLANO	100,00	IPCA	5,00
100,00	RENDA FIXA	100,00	IPCA	5,80
100,00	RENDA VARIÁVEL	100,00	IPCA	8,00
100,00	INVESTIMENTOS	100,00	IPCA	5,00
100,00	IMÓVEIS	100,00	IPCA	5,40
100,00	EMPRÉSTIMOS E	100,00	IPCA	6,00
100,00	INVESTIMENTOS NO	100,00	IPCA	5,20

Documentação/Responsáveis

Documentação

Nº da Ata: 6ª Reunião Ordinária

Data: 19/12/2018

Administrador Estatutário Tecnicamente Qualificado

Período	Segmento	Nome	CPF	Cargo
01/01/2019 a 31/12/2019	PLANO	ROBERTO FRANCISCO CASAGRANDE HERDEIRO	057.225.288-97	Diretor de Investimentos

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: Sim	

Observação:

Alocação dos Recursos

Período de Referência: 01/2019 a 12/2019

Segmento	Mínimo %	Máximo %	Alvo %
RENDA FIXA	89,00	100,00	95,00
RENDA VARIÁVEL	0,00	5,00	2,00
IMÓVEIS	0,00	2,00	0,00
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	0,00	2,00	0,00
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	6,00	3,00
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	0,00	2,00	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: Acima limites de alocação por segmento para classe BD e abaixo classe CD.

Segmento	Mínimo	Máximo	Alvo
Renda Fixa:	60%	89%	73,7%
Renda Variável:	6%	20%	13%
Imobiliário:	0%	2%	0,3%
Oper.c/ Participantes:	0%	2%	0,5%
Estruturados:	5%	20%	12%
Exterior:	0%	2%	0,5%

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	5,00	
COMPANHIA ABERTA COM REGISTRO NA CVM	0,00	10,00	
ORGANISMO MULTILATERAL	0,00	5,00	
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	5,00	
SOCIEDADE DE PROPÓSITO ESPECÍFICO - SPE	0,00	10,00	
FI/FICFI CLASSIFICADOS NO SEGMENTO DE INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	0,00	6,00	

Observação: Em limites de alocação por emissor existem duas classes, sendo citada acima os limites da classe BD e abaixo a classe CD.

Emissor	Legal	Política(CD)
Tesouro Nacional	100%	89%
Fundos Índice Ref Cesta Ações Cia Aberta	10%	10%
FI/FIC Classificados Invest. Estruturados	10%	10%

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	15,00	
% 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	15,00	
% DO PL DE FUNDOS DE ÍNDICE NO EXTERIOR NEGOCIADOS EM BOLSA DE VALORES NO BRASIL	0,00	15,00	
% 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	15,00	
% DE UM MESMO EMPREENDIMENTO IMOBILIÁRIO			x

Observação:

Rentabilidade(%)

Plano/Segmento	2017	1º Sem 2018	2019	Não Aplica
PLANO	9,10	6,00	9,30	
RENDA FIXA	11,10	8,70	10,10	
RENDA VARIÁVEL	0,50	-9,80	12,40	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	14,50	10,70	9,30	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR				x
IMÓVEIS	0,00	0,00	9,70	
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	10,00	9,40	10,30	

Observação: As rentabilidades dos investimentos para 2019 por classe, sendo acima a rentabilidade da classe BD e abaixo a classe CD.

Classe Contribuição Definida:
 Plano: 9,3%
 Renda Fixa: 9,2%
 Renda Variável: 12,4%
 Estruturado: 9,3%
 Imobiliário: 9,7%
 Op. Participantes: 10,3%
 Exterior: 9,5%

- 1) Para o cálculo de rentabilidade foi utilizado o método de cotação adaptada,
- 2) Rentabilidade de 2018 até outubro,

Observações

O Plano II possui duas classes (BD e CD), sendo que apenas o índice de referência para o segmento de renda fixa é distinto, sendo igual a IPCA+4,9% a.a. para classe CD.