

#sergus 20

PLANO BD NÚMEROS

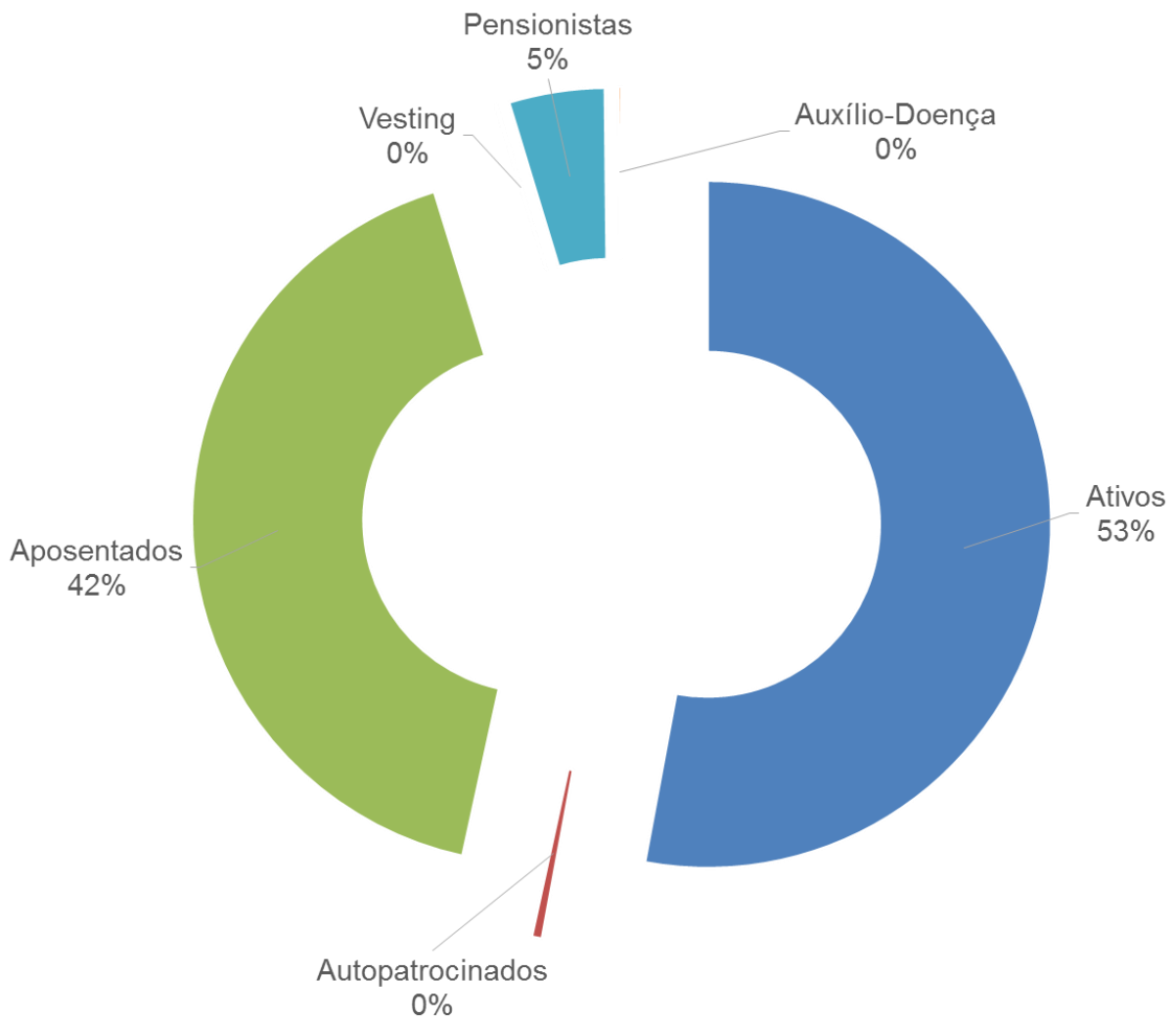
Os números do Plano BD, tem como finalidade estreitar o relacionamento entre entidade, patrocinadoras e participantes. Divulgar a situação financeira do Plano, demonstra maior transparência e mantém a estabilidade e sustentabilidade do Plano de Benefício.

Balancete Consolidado

Dezembro/2017			
Ativo	R\$	Passivo	R\$
Disponível	9.590,56	Exigível Operacional	-5.610.486,98
		Gestão Previdencial	-4.749.992,95
		Gestão Administrativa	-813.763,14
Realizável	743.770.181,00	Investimentos	-46.730,89
		Exigível Contingencial	-357.269,00
Gestão Previdencial	1.288.242,41	Gestão Previdencial	-351.380,52
Gestão Administrativa	24.327,13	Gestão Administrativa	-5.888,48
		Investimentos	0,00
Investimentos	742.457.611,46		
Títulos Públicos	366.687.581,91	Patrimônio Social	-737.963.737,42
Créditos Privados e Depósitos	93.189.578,59	Patrimônio de Cober. do Plano	-733.838.662,68
Ações	15.665.048,52	Provisões Matemáticas	-781.382.275,76
Fundo de Investimento	225.134.021,24	Benefícios Cencedidos	-397.861.430,70
Investimentos Imobiliários	32.792.006,71	Benefícios a Conceder	-384.689.823,06
Empréstimos	8.989.374,49	Provisões Matemáticas a Constituir	1.168.978,00
		Déficit Equacionado	1.168.978,00
		Equilíbrio Técnico	47.543.613,08
Permanente	151.721,84	Resultados Realizados	47.543.613,08
Imobilizado	117.765,90	Déficit Técnico Acumulado	47.543.613,08
Diferido	33.955,94	Até o Exercício Anterior	87.904.717,18
		No Exercício Atual	-40.361.104,10
		Fundos	-4.125.074,74
		Fundo Coletivo	-1.010,49
		Fundo Administrativo	-3.064.992,42
		Fundos dos Investimentos	-1.059.071,83
Total	743.931.493,40	Total	-743.931.493,40

Quadro de Participantes

Dezembro/2017	
Participantes	Quantidade
Ativos	644
Autopatrocínados	06
Aposentados	509
Vesting	01
Pensionistas	55
Auxílio-Doença	02
Total	1.217



Fluxo de Recursos

Discriminação	Exercício 2017	
	Dezembro	Acumulado no Exercício
Adições (Contribuições Recebidas) (A)	1.903.900	22.071.217
Patronais (A.1)	566.006	8.429.546
Participantes (A.2)	1.307.521	13.167.188
Ativos	566.006	8.429.546
Assistidos	741.515	4.737.643
Autofinanciados (A.3)	30.373	474.483
Deduções (Benefícios Pagos) (B)	4.794.144	31.269.052
Prestação Continuada	4.794.144	30.725.204
Aposentadoria Programada	4.363.607	27.912.088
Invalidez	228.885	1.482.794
Pensões	191.752	1.236.993
Auxílio-doença	9.900	93.330
Prestação Única	0	478.536
Pecúlio	0	478.536
Institutos	0	65.312
Resgate de Contribuição/ Portabilidade	0	65.312
(=) Resultado do Fluxo	(2.890.244)	(9.197.833)
Contrib. Patronais X Particip. Ativos	100%	100%
Contrib. Recebidas X Benefícios Pagos (A/B)	40%	71%

Enquadramento

Aplicações	Dezembro/2017		Política Investimentos Plano SERGUS de Benefício 2017		Resolução CMN nº 3.792/2009
	Saldos (R\$)	Enquadramen to s/Recursos Garantidores	Alvos ¹	Limites Máximos	
Renda Fixa	635.156.650	86,03%	85,74%	100,00%	100,00%
Notas do Tesouro Nacional "B" - NTN-B	366.687.582	49,67%			
Letras Financeiras Subordinadas	87.387.359	11,83%			
Letras Financeiras	5.802.220	0,79%			
Fundos de Investimento - FI	175.279.490	23,74%			
Investimentos Estruturados	20.597.140	2,79%	2,98%	10,00%	20,00%
Fundos de Invest. Multimercados - FIM	20.597.140	2,79%			
Investimentos no Exterior	-	-	1,99%	2,50%	10,00%
Renda Variável	40.856.614	5,53%	2,69%	20,00%	70,00%
Ações	15.665.049	2,12%			
Fundos de Investimento em Ações - FIA	25.191.566	3,41%			
Imóveis	32.792.007	4,44%	5,52%	7,00%	8,00%
Empréstimos	8.989.374	1,22%	1,08%	14,00%	15,00%
= Total dos Investimentos	738.391.786	100,01%	100,00%	-	-
(+) Disponível	9.149	0,00%	-	-	-
(-) Exigível Operacional	(102.005)	(0,01%)	-	-	-
= Total Recursos Garantidores ²	738.298.930	100,00%	-	-	-

Observações:

¹ Alvos: Metas a serem alcançadas em 2017 .

² Total dos Recursos Garantidores, conforme Resolução CMN nº 3.792/2009 - Art. 3º.

Enquadramento

■ Renda Fixa

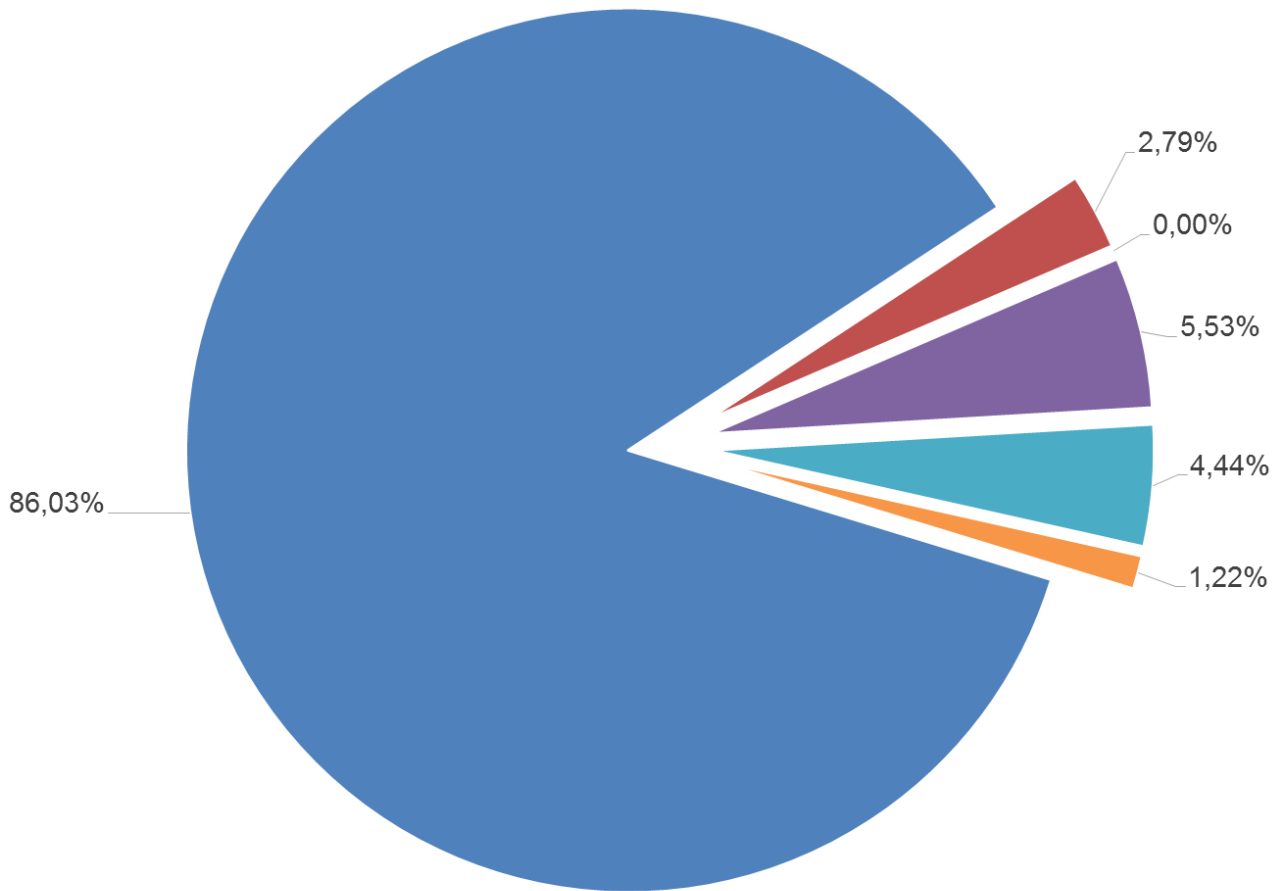
■ Investimentos no Exterior

■ Imóveis

■ Investimentos Estruturados

■ Renda Variável

■ Empréstimos



Carteira Própria

Carteira Própria				29/12/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
NTN-B				
20/05/2015	15/05/2019	46.927.384,72	IPCA + 6,62%	
14/08/2015	15/05/2019	22.284.883,37	IPCA + 7,07%	
26/08/2015	15/05/2019	11.459.571,37	IPCA + 7,20%	
16/12/2015	15/05/2019	28.241.159,37	IPCA + 7,51%	
Total 2019				108.912.998,83
03/08/2016	15/05/2021	10.335.085,21	IPCA + 6,22%	
31/08/2016	15/05/2021	10.186.097,98	IPCA + 6,23%	
Total 2021				20.521.183,19
22/05/2017	15/08/2022	5.078.582,79	IPCA + 5,91%	
24/05/2017	15/08/2022	4.999.095,96	IPCA + 5,84%	
Total 2022				10.077.678,75
23/05/2017	15/05/2023	10.196.653,15	IPCA + 5,89%	
Total 2023				10.196.653,15
06/12/2006	15/08/2024	20.734.310,06	IPCA + 7,91%	
Total 2024				20.734.310,06
31/05/2017	15/08/2026	10.153.638,90	IPCA + 5,66%	
Total 2026				10.153.638,90
10/08/2011	15/08/2030	14.855.519,93	IPCA + 6,30%	
Total 2030				14.855.519,93
19/05/2017	15/05/2035	10.176.099,35	IPCA + 5,50%	
Total 2035				10.176.099,35
15/08/2013	15/08/2040	27.097.650,75	IPCA + 5,59%	
28/11/2013	15/08/2040	4.776.701,87	IPCA + 6,35%	
Total 2040				31.874.352,62
20/08/2007	15/05/2045	13.772.089,29	IPCA + 6,85%	
13/11/2007	15/05/2045	9.008.259,40	IPCA + 6,42%	
11/01/2008	15/05/2045	11.493.983,92	IPCA + 6,51%	
29/05/2008	15/05/2045	13.978.872,54	IPCA + 6,73%	
10/09/2008	15/05/2045	13.478.313,56	IPCA + 7,03%	
14/10/2008	15/05/2045	17.284.300,83	IPCA + 7,78%	
24/10/2008	15/05/2045	4.567.946,63	IPCA + 8,48%	
24/10/2008	15/05/2045	4.797.379,14	IPCA + 8,50%	
21/11/2008	15/05/2045	5.522.167,97	IPCA + 8,03%	
17/05/2010	15/05/2045	5.079.826,76	IPCA + 6,20%	
29/06/2017	15/05/2045	9.992.539,92	IPCA + 5,73%	
03/11/2017	15/05/2045	10.099.545,36	IPCA + 5,30%	
Total 2045				119.075.225,32
22/05/2017	15/08/2050	5.096.182,28	IPCA + 5,65%	
07/12/2017	15/08/2050	5.013.739,53	IPCA + 5,49%	
Total 2050				10.109.921,81
Total Aplicado				366.687.581,91
Letra Financeira Subordinada - Banese				29/12/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
24/07/2015	24/07/2023	64.673.499,45	INPC + 8,45%	
Total Aplicado				64.673.499,45
Letra Financeira Subordinada - BRB				29/12/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
29/04/2013	29/04/2020	18.034.970,99	IPCA + 6,70%	
Total Aplicado				18.034.970,99
Letra Financeira Subordinada - Itaú				29/12/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
27/07/2015	14/11/2022	1.500.328,59	IPCA + 6,70%	
Total Aplicado				1.500.328,59
Letra Financeira - Banco Original				29/12/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
02/08/2016	02/08/2018	5.802.219,59	IPCA + 8,10%	
Total Aplicado				5.802.219,59
Letra Financeira Subordinada - Banco Votorantim				29/12/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
18/04/2017	17/04/2023	3.178.559,97	IPCA + 6,20%	
Total Aplicado				3.178.559,97
Ações - Banese				29/12/2017
Código/Papel	Quantidade	Cotação (valor unitário)	Valor Líquido	
BGIP3 - Banese ON	337.290,00	38,50	12.985.665,00	
BGIP4 - Banese PN	74.448,00	35,99	2.679.383,52	
Total Aplicado			15.665.048,52	
Carteira Própria				29/12/2017
Imóveis				32.792.006,71
Empréstimos				8.989.374,49
Total Carteira Própria Sergus				517.323.590,22

Vencimentos

Carteira Terceirizada

29/12/2017

Vencimento	Valor (R\$)	Fundos
D+0	60.930.029,38	Bozano Acaju
D+1	114.201.895,11	Fator Pirambu e Novero Poxim
D+5	3.111.331,25	Icatu Vanguarda Dividendos FIA
D+5	10.158.713,20	SulAmérica Endurance FIM
D+8	3.032.651,90	Oceana Selection FIA
D+13	16.065.039,31	Studio FIC FIA
D+20	10.438.426,85	Oceana Long Short
D+33	2.982.543,12	Kondor Equities Institucional FIA
Total Aplicado	R\$ 220.920.630,11	
2018	147.565,25	BTG Emissões Primárias II
Total Aplicado	147.565,25	
Total Carteira Terceirizada Sergus	R\$ 221.068.195,36	

Rentabilidade Total dos Investimentos

Aplicações	Mensal
Total dos Investimentos	1,29%
Renda Fixa	0,65%
Investimentos Estruturados	0,63%
Renda Variável	4,40%
Imóveis	11,47%
Empréstimos	0,95%

Evolução

Ano	Patrimônio R\$	%
1994	30.142	-
1995	38.409	27,43
1996	47.919	24,76
1997	57.146	19,26
1998	63.311	10,79
1999	85.377	34,85
2000	97.855	14,62
2001	110.169	12,58
2002	115.514	04,85
2003	142.781	23,60
2004	164.305	15,07
2005	198.141	20,59
2006	234.540	18,37
2007	264.193	12,64
2008	285.292	07,99
2009	326.401	14,41
2010	361.860	10,86
2011	415.553	14,84
2012	468.637	12,77
2013	502.656	07,26
2014	558.067	11,02
2015	618.671	10,86
2016	685.550	10,81
2017¹	743.931	08,52

¹ Referente a Dezembro

Evolução

