

#sergus 20

PLANO BD NÚMEROS

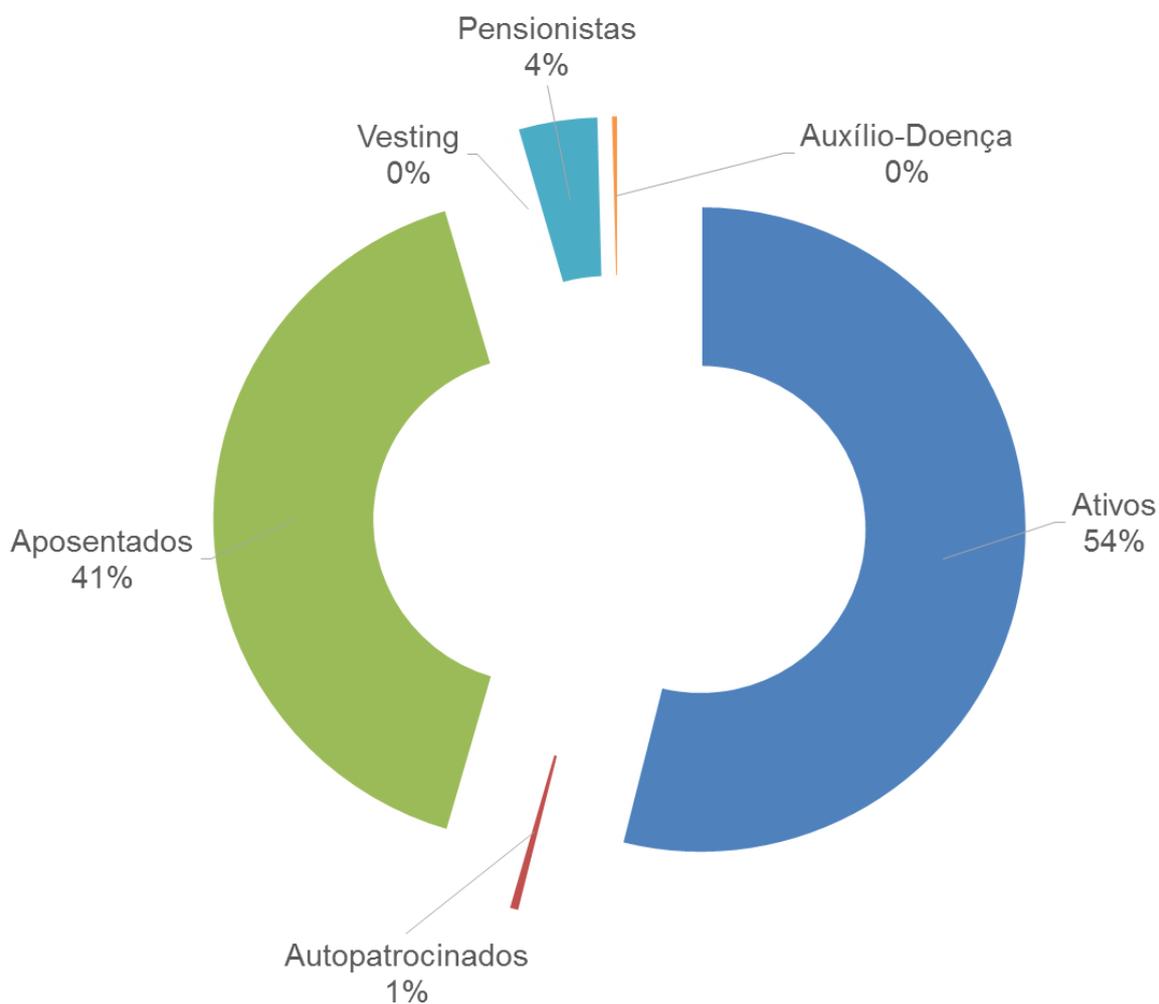
Os números do Plano BD, tem como finalidade estreitar o relacionamento entre entidade, patrocinadoras e participantes. Divulgar a situação financeira do Plano, demonstra maior transparência e mantém a estabilidade e sustentabilidade do Plano de Benefício.

Balancete Consolidado

Janeiro/2017			
Ativo	R\$	Passivo	R\$
Disponível	124.565,99	Exigível Operacional	-5.242.960,74
		Gestão Previdencial	-4.485.597,81
		Gestão Administrativa	-560.567,89
Realizável	692.069.201,74	Investimentos	-196.795,04
		EXIGÍVEL CONTINGENCIAL	-19.773.116,82
Gestão Previdencial	490.319,31	Gestão Previdencial	-19.767.343,62
Gestão Administrativa	37.522,05	Gestão Administrativa	-5.773,20
		Investimentos	0,00
Investimentos	691.541.360,38		
Títulos Públicos	305.396.821,83	Patrimônio Social	-667.376.108,62
Créditos Privados e Depósitos	82.325.274,45	Patrimônio de Cober. do Plano	-664.349.845,15
Ações	7.572.711,60	Provisões Matemáticas	-749.355.540,17
Fundo de Investimento	258.836.595,39	Benefícios Cencedidos	-383.446.177,65
Investimentos Imobiliários	29.507.629,99	Benefícios a Conceder	-367.627.489,25
Empréstimos	7.902.327,12	Provisões Matemáticas a Constituir	1.718.126,73
		Déficit Equacionado	1.718.126,73
		Equilíbrio Técnico	85.005.695,02
Permanente	198.418,45	Resultados Realizados	85.005.695,02
Imobilizado	156.681,00	Déficit Técnico Acumulado	85.005.695,02
Diferido	41.737,45	Até o Exercício Anterior	87.904.717,18
		No Exercício Atual	-2.899.022,16
		Fundos	-3.026.263,47
		Fundo Administrativo	-2.144.574,43
		Fundos dos Investimentos	-881.689,04
Total	692.392.186,18	Total	-692.392.186,18

Quadro de Participantes

Janeiro/2017	
Participantes	Quantidade
Ativos	663
Autopatrocínados	7
Aposentados	504
Vesting	01
Pensionistas	50
Auxílio-Doença	5
Total	1.230



Fluxo de Recursos

Discriminação	Exercício 2017	
	Janeiro	Acumulado No Exercício
Adições (Contribuições Recebidas) (A)	2.516.890	2.516.890
Patronais (A.1)	1.056.605	1.056.605
Participantes (A.2)	1.398.224	1.398.224
Ativos	1.056.605	1.056.605
Assistidos	341.619	341.619
Autofinanciados (A.3)	62.061	62.061
Deduções (Benefícios Pagos) (B)	2.343.781	2.343.781
Prestação Continuada	2.303.342	2.303.342
Aposentadoria Programada	2.091.983	2.091.983
Invalidez	113.370	113.370
Pensões	82.850	82.850
Auxílio-doença	15.139	15.139
Prestação Única	40.439	40.439
Pecúlio	40.439	40.439
Institutos	0	0
Resgate de Contribuição/ Portabilidade	0	0
(=) Resultado do Fluxo	173.109	173.109
Contrib. Patronais X Particip. Ativos	100%	100%
Contrib. Recebidas X Benefícios Pagos (A/B)	107%	107%

Enquadramento

Aplicações	Janeiro/2017		Política Investimentos Plano SERGUS de Benefício 2017		Resolução CMN nº 3.792/2009
	Saldos (R\$)	Enquadramento s/Recursos Garantidores	Alvos ¹	Limites Máximos	
Renda Fixa	615.577.338	89,31%	85,74%	100,00%	100,00%
Notas do Tesouro Nacional "B" - NTN-B	305.396.822	44,31%			
Letras Financeiras Subordinadas	77.037.351	11,19%			
Letras Financeiras	5.287.924	0,77%			
Fundos de Investimento - FI	227.855.241	33,04%			
Investimentos Estruturados	16.084.772	2,34%	2,98%	10,00%	20,00%
Fundos de Invest. Multimercados - FIM	16.084.772	2,34%			
Investimentos no Exterior	-	-	1,99%	2,50%	10,00%
Renda Variável	20.319.583	2,95%	2,69%	20,00%	70,00%
Ações	7.572.712	1,10%			
Fundos de Investimento em Ações - FIA	12.746.872	1,85%			
Imóveis	29.501.630	4,28%	5,52%	7,00%	8,00%
Empréstimos	7.902.327	1,15%	1,08%	14,00%	15,00%
= Total dos Investimentos	689.391.650	100,03%	100,00%	-	-
(+) Disponível	121.967	0,02%	-	-	-
(-) Exigível Operacional	(310.752)	(0,05%)	-	-	-
= Total Recursos Garantidores ²	689.202.865	100,00%	-	-	-

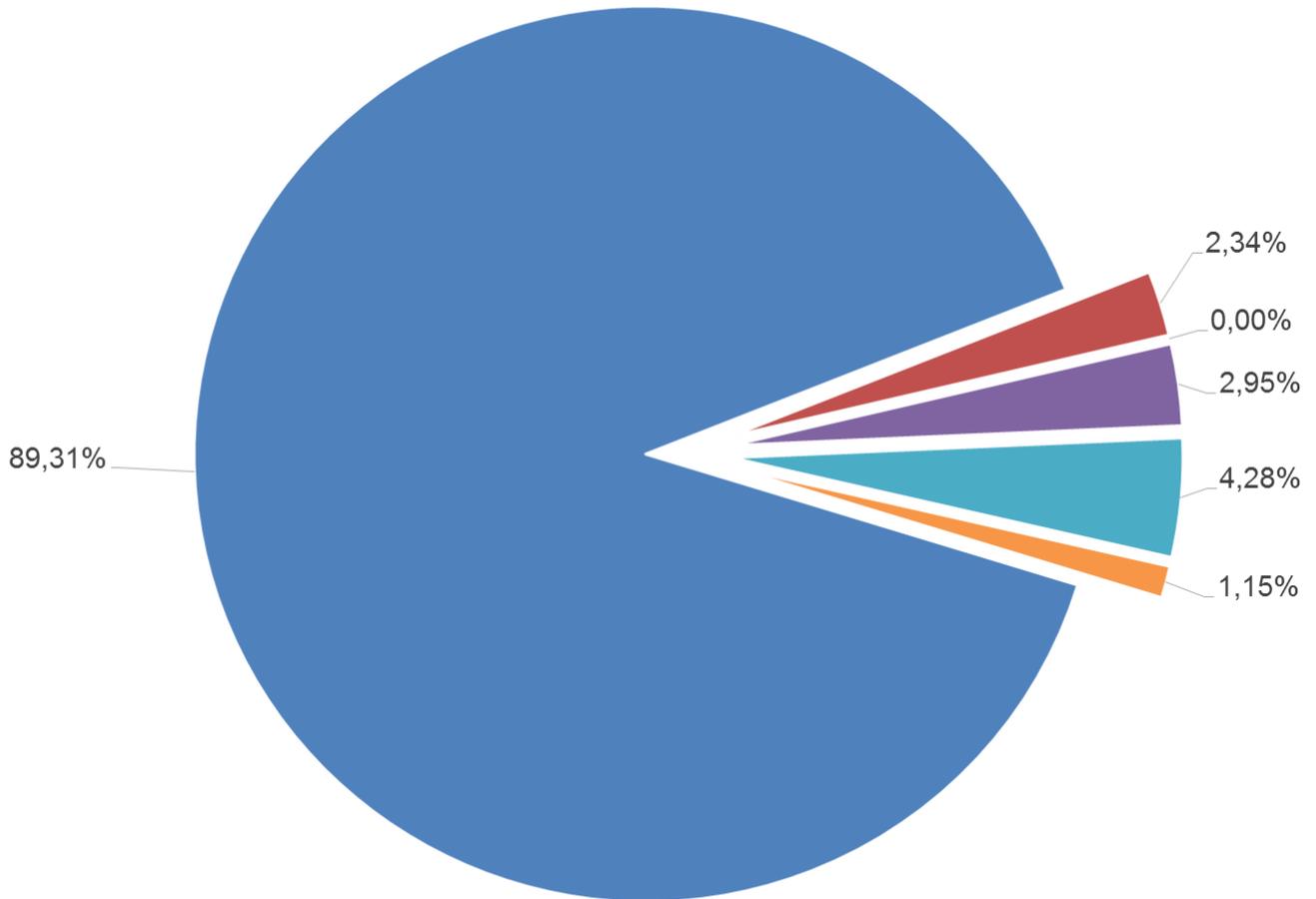
Observações:

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 Estruturados
- Investimentos no Exterior
- Renda Variável
- Imóveis
- Empréstimos



Carteira Própria

Carteira Própria				31/01/2017
Aplicação	Vencimento	NTN-B	Valor Líquido	Taxa
20/08/2007	15/05/2017		5.839.220,32	IPCA + 7,28%
14/10/2008	15/05/2017		9.982.995,79	IPCA + 9,20%
Total 2017				15.822.216,11
20/05/2015	15/05/2019		45.888.382,99	IPCA + 6,62%
14/08/2015	15/05/2019		21.717.183,76	IPCA + 7,07%
26/08/2015	15/05/2019		11.156.853,74	IPCA + 7,20%
16/12/2015	15/05/2019		27.432.166,17	IPCA + 7,51%
Total 2019				106.194.586,66
03/08/2016	15/05/2021		10.143.176,21	IPCA + 6,23%
31/08/2016	15/05/2021		9.993.018,21	IPCA + 6,23%
Total 2021				20.136.194,42
06/12/2006	15/08/2024		20.172.880,53	IPCA + 7,91%
Total 2024				20.172.880,53
10/08/2011	15/08/2030		14.578.376,21	IPCA + 6,30%
Total 2030				14.578.376,21
15/08/2013	15/08/2040		26.636.688,66	IPCA + 5,59%
28/11/2013	15/08/2040		4.689.900,93	IPCA + 6,35%
Total 2040				31.326.589,59
20/08/2007	15/05/2045		13.519.873,75	IPCA + 6,85%
13/11/2007	15/05/2045		8.845.848,46	IPCA + 6,42%
11/01/2008	15/05/2045		11.286.001,59	IPCA + 6,51%
29/05/2008	15/05/2045		13.723.871,03	IPCA + 6,73%
10/09/2008	15/05/2045		13.230.222,69	IPCA + 7,03%
14/10/2008	15/05/2045		16.961.846,43	IPCA + 7,78%
24/10/2008	15/05/2045		4.482.533,15	IPCA + 8,48%
24/10/2008	15/05/2045		4.707.681,68	IPCA + 8,50%
21/11/2008	15/05/2045		5.418.954,08	IPCA + 8,03%
17/05/2010	15/05/2045		4.989.145,45	IPCA + 6,20%
Total 2045				97.165.978,31
Total Aplicado				305.396.821,83
Letra Financeira Subordinada - Banese				31/01/2017
Aplicação	Vencimento		Valor Líquido	Taxa
24/07/2015	24/07/2023		59.053.783,05	INPC + 8,45%
Total Aplicado				59.053.783,05
Letra Financeira Subordinada - BRB				31/01/2017
Aplicação	Vencimento		Valor Líquido	Taxa
29/04/2013	29/04/2020		16.601.322,84	IPCA + 6,70%
Total Aplicado				16.601.322,84
Letra Financeira Subordinada - Itaú				31/01/2017
Aplicação	Vencimento		Valor Líquido	Taxa
27/07/2015	14/11/2022		1.382.244,78	IPCA + 6,70%
Total Aplicado				1.382.244,78
Letra Financeira - Banco Original				31/01/2017
Aplicação	Vencimento		Valor Líquido	Taxa
02/08/2016	02/08/2018		5.287.923,78	IPCA + 8,10%
Total Aplicado				5.287.923,78
Ações - Banese				31/01/2017
Código/Papel	Quantidade	Cotação (valor unitário)	Valor Líquido	
BGIP3 - Banese ON	337.290,00	18,60	6.273.594,00	
BGIP4 - Banese PN	74.448,00	17,45	1.299.117,60	
Total Aplicado			7.572.711,60	
Imóveis (01/2017)			29.507.629,99	
Empréstimos (01/2017)			7.902.327,12	
Total Carteira Própria Sergus			432.704.764,99	

Vencimentos

Carteira Terceirizada		31/01/2017
Vencimento	Valor (R\$)	Fundos
D+0	84.313.001,85	Bozano Acaju e Bozano Rendimento
D+1	114.023.446,15	Fator Pirambu e Novero Poxim
D+13	12.746.871,51	Studio FIC FIA
D+16	8.466.536,14	Brasil Plural Institucional 15
D+20	9.480.193,79	Oceana Long Short
D+31	6.604.578,19	Brasil Plural Equity Hedge 30
Total Aplicado	R\$ 235.634.627,64	
2018	788.609,42	BTG Emissões Primárias II
2019	22.413.358,34	NTN-B (Fundo Novero Poxim)
Total Aplicado	23.201.967,76	
Total Carteira Terceirizada Sergus	R\$ 258.836.595,40	

Rentabilidade Total dos Investimentos

Aplicações	Mensal
Total dos Investimentos	1,15%
Renda Fixa	1,05%
Investimentos Estruturados	1,80%
Renda Variável	5,12%
Imóveis	0,43%
Empréstimos	0,91%

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	692.392	01,00

¹ Referente a Janeiro

Evolução

