

#sergus 20

PLANO BD NÚMEROS

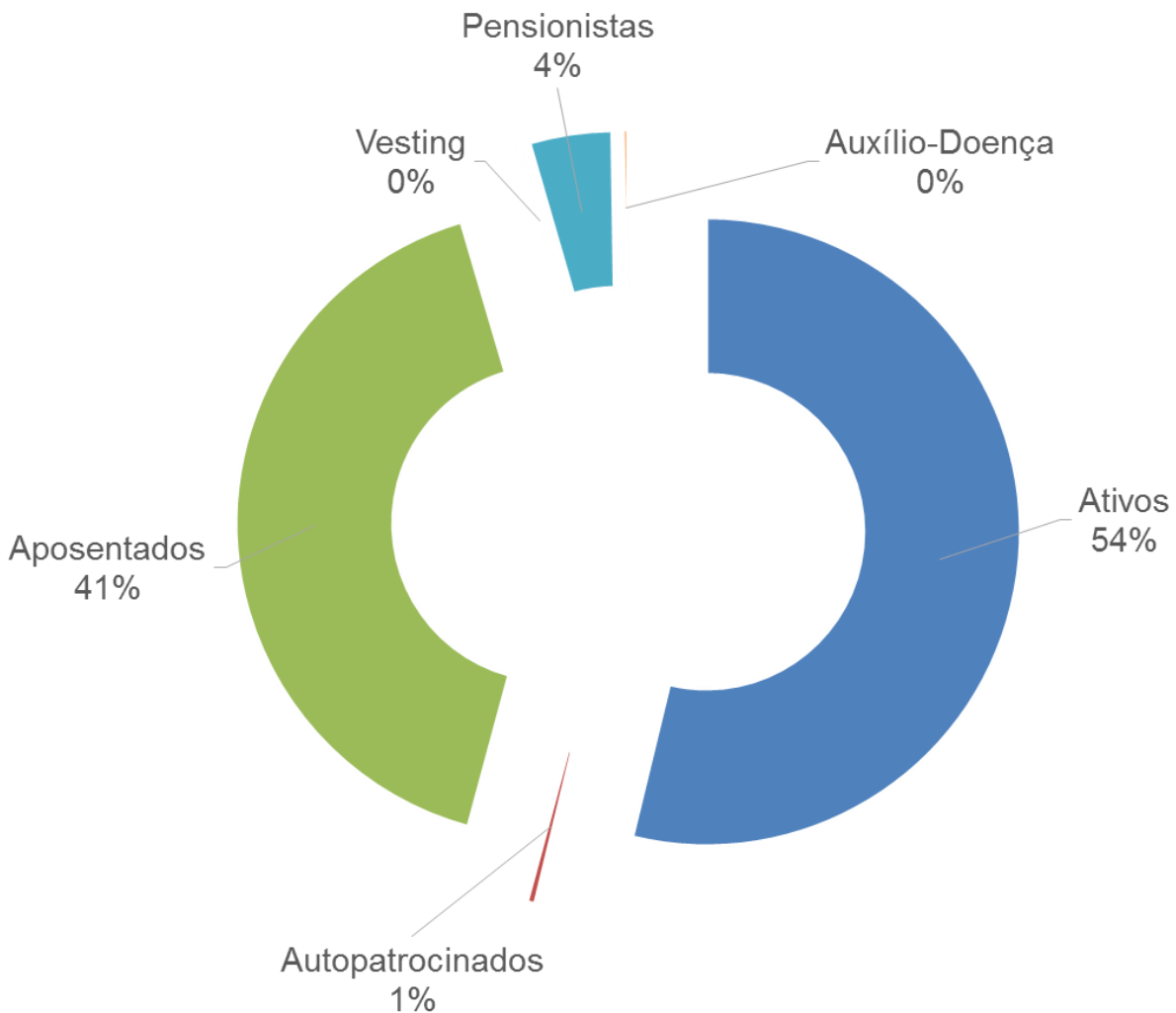
Os números do Plano BD, tem como finalidade estreitar o relacionamento entre entidade, patrocinadoras e participantes. Divulgar a situação financeira do Plano, demonstra maior transparência e mantém a estabilidade e sustentabilidade do Plano de Benefício.

Balancete Consolidado

| Abril/2017 | | | |
|-------------------------------|-----------------------|---|------------------------|
| Ativo | R\$ | Passivo | R\$ |
| Disponível | 136.578,29 | Exigível Operacional | -5.985.357,92 |
| | | Gestão Previdencial | -5.082.720,87 |
| | | Gestão Administrativa | -768.747,55 |
| Realizável | 711.077.122,88 | Investimentos | -133.889,50 |
| | | Exigível Contingencial | -20.311.093,81 |
| Gestão Previdencial | 6.849.996,80 | Gestão Previdencial | -20.305.283,59 |
| Gestão Administrativa | 65.301,00 | Gestão Administrativa | -5.810,22 |
| | | Investimentos | 0,00 |
| Investimentos | 704.161.825,08 | | |
| Títulos Públicos | 310.709.457,98 | Patrimônio Social | -685.102.121,12 |
| Créditos Privados e Depósitos | 87.649.904,23 | Patrimônio de Cober. do Plano | -681.832.445,73 |
| Ações | 9.993.384,00 | Provisões Matemáticas | -756.969.770,32 |
| Fundo de Investimento | 258.461.114,97 | Benefícios Cencedidos | -387.227.864,58 |
| Investimentos Imobiliários | 29.514.867,50 | Benefícios a Conceder | -371.334.259,04 |
| Empréstimos | 7.833.096,40 | Provisões Matemáticas a Constituir | 1.592.353,30 |
| | | Déficit Equacionado | 1.592.353,30 |
| | | Equilíbrio Técnico | 75.137.324,59 |
| Permanente | 184.871,68 | Resultados Realizados | 75.137.324,59 |
| Imobilizado | 145.256,46 | Déficit Técnico Acumulado | 75.137.324,59 |
| Diferido | 39.615,22 | Até o Exercício Anterior | 87.904.717,18 |
| | | No Exercício Atual | -12.767.392,59 |
| | | Fundos | -3.269.675,39 |
| | | Fundo Administrativo | -2.336.309,06 |
| | | Fundos dos Investimentos | -933.366,33 |
| Total | 711.398.572,85 | Total | -711.398.572,85 |

Quadro de Participantes

| Abril/2017 | |
|------------------|--------------|
| Participantes | Quantidade |
| Ativos | 660 |
| Autopatrocínados | 05 |
| Aposentados | 506 |
| Vesting | 01 |
| Pensionistas | 52 |
| Auxílio-Doença | 03 |
| Total | 1.227 |



Fluxo de Recursos

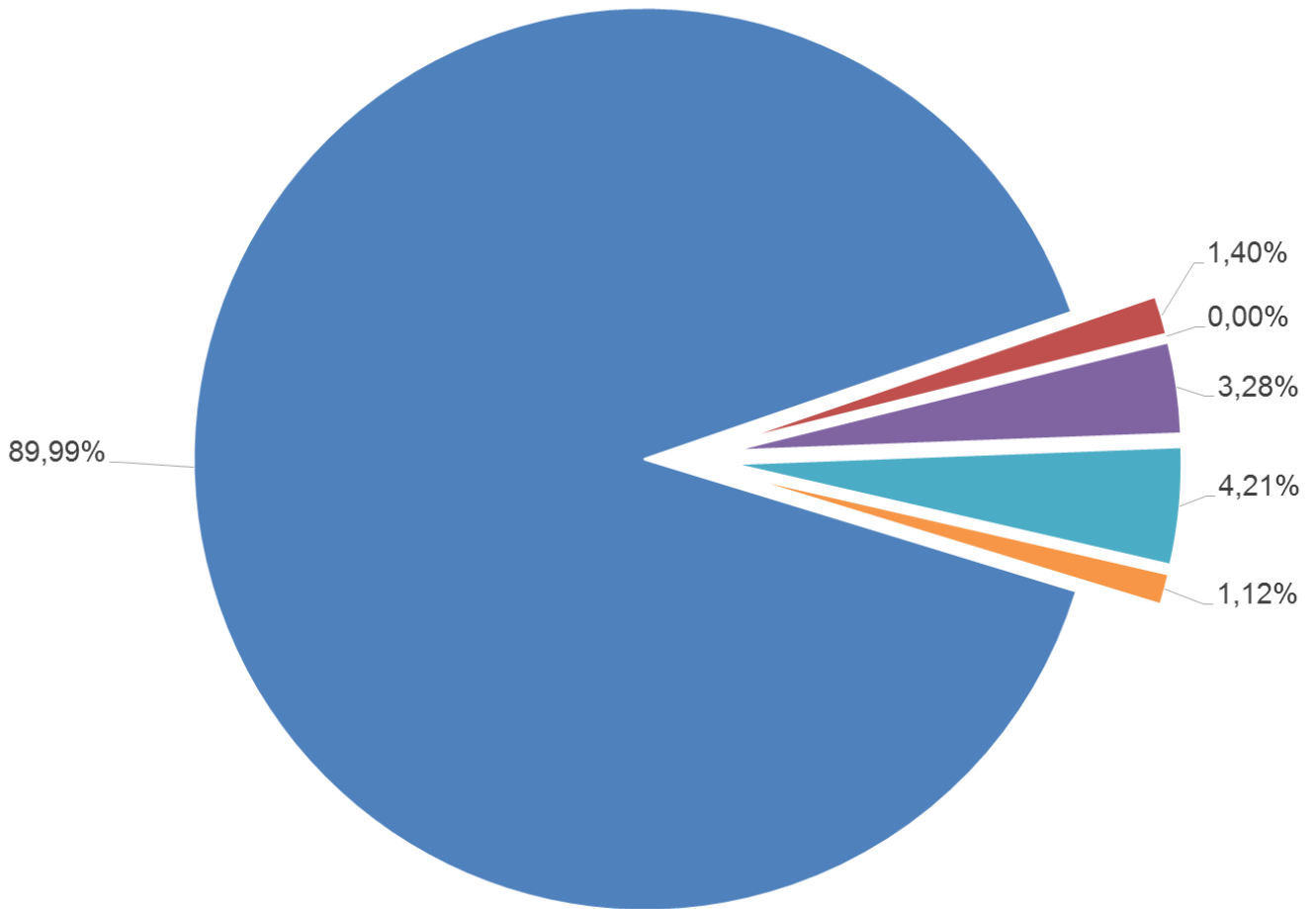
| Discriminação | Exercício 2017 | |
|---|------------------|------------------------|
| | Abril | Acumulado No Exercício |
| Adições (Contribuições Recebidas) (A) | 1.520.734 | 7.093.114 |
| Patronais (A.1) | 564.512 | 2.743.245 |
| Participantes (A.2) | 924.825 | 4.156.516 |
| Ativos | 564.512 | 2.743.245 |
| Assistidos | 360.313 | 1.413.271 |
| Autofinanciados (A.3) | 31.397 | 193.353 |
| Deduções (Benefícios Pagos) (B) | 2.500.873 | 9.607.482 |
| Prestação Continuada | 2.329.630 | 9.231.614 |
| Aposentadoria Programada | 2.095.384 | 8.380.801 |
| Invalidez | 114.616 | 458.505 |
| Pensões | 109.040 | 356.202 |
| Auxílio-doença | 10.590 | 36.106 |
| Prestação Única | 141.359 | 328.308 |
| Pecúlio | 141.359 | 328.308 |
| Institutos | 29.884 | 47.560 |
| Resgate de Contribuição/ Portabilidade | 29.884 | 47.560 |
| (=) Resultado do Fluxo | (980.139) | (2.514.368) |
| Contrib. Patronais X Particip. Ativos | 100% | 100% |
| Contrib. Recebidas X Benefícios Pagos (A/B) | 61% | 74% |

Enquadramento

| Aplicações | Abril/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 | 631.348.374 | 89,99% | 85,74% | 100,00% | 100,00% |
| Notas do Tesouro Nacional "B" - NTN-B | 310.709.458 | 44,29% | | | |
| Letras Financeiras Subordinadas | 82.228.846 | 11,72% | | | |
| Letras Financeiras | 5.421.059 | 0,77% | | | |
| Fundos de Investimento - FI | 232.989.011 | 33,21% | | | |
| Investimentos Estruturados | 9.799.021 | 1,40% | 2,98% | 10,00% | 20,00% |
| Fundos de Invest. Multimercados - FIM | 9.799.021 | 1,40% | | | |
| Investimentos no Exterior | - | - | 1,99% | 2,50% | 10,00% |
| Renda Variável | 23.012.975 | 3,28% | 2,69% | 20,00% | 70,00% |
| Ações | 9.993.384 | 1,42% | | | |
| Fundos de Investimento em Ações - FIA | 13.019.591 | 1,86% | | | |
| Imóveis | 29.501.630 | 4,21% | 5,52% | 7,00% | 8,00% |
| Empréstimos | 7.833.096 | 1,12% | 1,08% | 14,00% | 15,00% |
| = Total dos Investimentos | 701.508.334 | 100,00% | 100,00% | - | - |
| (+) Disponível | 133.919 | 0,03% | - | - | - |
| (-) Exigível Operacional | (249.083) | (0,03%) | - | - | - |
| = Total Recursos Garantidores ² | 701.393.170 | 100,00% | - | - | - |

Enquadramento

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



Carteira Própria

| Carteira Própria | | | | 28/04/2017 |
|---|------------|--------------------------|---------------|-----------------------|
| NTN-B | | | | |
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| 20/08/2007 | 15/05/2017 | 5.982.919,89 | IPCA + 7,28% | |
| 14/10/2008 | 15/05/2017 | 10.271.134,85 | IPCA + 9,20% | |
| Total 2017 | | | | 16.254.054,74 |
| 20/05/2015 | 15/05/2019 | 46.948.969,73 | IPCA + 6,62% | |
| 14/08/2015 | 15/05/2019 | 22.241.230,24 | IPCA + 7,07% | |
| 26/08/2015 | 15/05/2019 | 11.429.292,84 | IPCA + 7,20% | |
| 16/12/2015 | 15/05/2019 | 28.120.821,73 | IPCA + 7,51% | |
| Total 2019 | | | | 108.740.314,54 |
| 03/08/2016 | 15/05/2021 | 10.368.816,75 | IPCA + 6,23% | |
| 31/08/2016 | 15/05/2021 | 10.215.381,39 | IPCA + 6,23% | |
| Total 2021 | | | | 20.584.198,14 |
| 06/12/2006 | 15/08/2024 | 20.038.525,55 | IPCA + 7,91% | |
| Total 2024 | | | | 20.038.525,55 |
| 10/08/2011 | 15/08/2030 | 14.466.998,89 | IPCA + 6,30% | |
| Total 2030 | | | | 14.466.998,89 |
| 15/08/2013 | 15/08/2040 | 26.449.783,15 | IPCA + 5,59% | |
| 28/11/2013 | 15/08/2040 | 4.652.468,35 | IPCA + 6,35% | |
| Total 2040 | | | | 31.102.251,50 |
| 20/08/2007 | 15/05/2045 | 13.839.511,27 | IPCA + 6,85% | |
| 13/11/2007 | 15/05/2045 | 9.046.396,76 | IPCA + 6,42% | |
| 11/01/2008 | 15/05/2045 | 11.544.140,12 | IPCA + 6,51% | |
| 29/05/2008 | 15/05/2045 | 14.044.585,24 | IPCA + 6,73% | |
| 10/09/2008 | 15/05/2045 | 13.548.289,19 | IPCA + 7,03% | |
| 14/10/2008 | 15/05/2045 | 17.398.015,12 | IPCA + 7,78% | |
| 24/10/2008 | 15/05/2045 | 4.604.798,54 | IPCA + 8,48% | |
| 24/10/2008 | 15/05/2045 | 4.836.297,09 | IPCA + 8,50% | |
| 21/11/2008 | 15/05/2045 | 5.561.296,12 | IPCA + 8,03% | |
| 17/05/2010 | 15/05/2045 | 5.099.785,17 | IPCA + 6,20% | |
| Total 2045 | | | | 99.523.114,62 |
| Total Aplicado | | | | 310.709.457,98 |
| Letra Financeira Subordinada - Banese | | | | 28/04/2017 |
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| 24/07/2015 | 24/07/2023 | 60.796.354,15 | INPC + 8,45% | |
| Total Aplicado | | | | 60.796.354,15 |
| Letra Financeira Subordinada - BRB | | | | 28/04/2017 |
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| 29/04/2013 | 29/04/2020 | 17.011.446,19 | IPCA + 6,70% | |
| Total Aplicado | | | | 17.011.446,19 |
| Letra Financeira Subordinada - Itaú | | | | 28/04/2017 |
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| 27/07/2015 | 14/11/2022 | 1.414.347,24 | IPCA + 6,70% | |
| Total Aplicado | | | | 1.414.347,24 |
| Letra Financeira - Banco Original | | | | 28/04/2017 |
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| 02/08/2016 | 02/08/2018 | 5.421.058,72 | IPCA + 8,10% | |
| Total Aplicado | | | | 5.421.058,72 |
| Letra Financeira Subordinada - Banco Votorantim | | | | 28/04/2017 |
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| 18/04/2017 | 17/04/2023 | 3.006.697,93 | IPCA + 6,20% | |
| Total Aplicado | | | | 3.006.697,93 |
| Ações - Banese | | | | 28/04/2017 |
| Código/Papel | Quantidade | Cotação (valor unitário) | Valor Líquido | |
| BGIP3 - Banese ON | 337.290,00 | 24,00 | 8.094.960,00 | |
| BGIP4 - Banese PN | 74.448,00 | 25,50 | 1.898.424,00 | |
| Total Aplicado | | | | 9.993.384,00 |
| Imóveis | | | | 29.514.867,50 |
| Empréstimos | | | | 7.833.096,40 |
| Total Carteira Própria Sergus | | | | 445.700.710,11 |

Vencimentos

| Carteira Terceirizada | | | 28/04/2017 |
|---|---------------------------|--------------------------------|------------|
| Vencimento | Valor (R\$) | Fundos | |
| D+0 | 80.708.179,66 | Bozano Acaju | |
| D+1 | 142.804.619,26 | Fator Pirambu eNovero Poxim | |
| D+13 | 13.019.591,21 | Studio FIC FIA | |
| D+16 | 8.670.940,20 | Brasil Plural Institucional 15 | |
| D+20 | 9.799.021,28 | Oceana Long Short | |
| Total Aplicado | R\$ 255.002.351,61 | | |
| 2018 | 805.272,32 | BTG Emissões Primárias II | |
| Total Aplicado | 805.272,32 | | |
| Total Carteira Terceirizada Sergus | R\$ 255.807.623,93 | | |

Rentabilidade Total dos Investimentos

| Aplicações | Mensal |
|--------------------------------|--------------|
| Total dos Investimentos | 0,78% |
| Renda Fixa | 0,72% |
| Investimentos Estruturados | 0,75% |
| Renda Variável | 2,69% |
| Imóveis | 0,46% |
| Empréstimos | 1,04% |

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 | 711.399 | 03,77 |

¹ Referente a Abril

Evolução

