

#sergus20

PLANO BD NÚMEROS

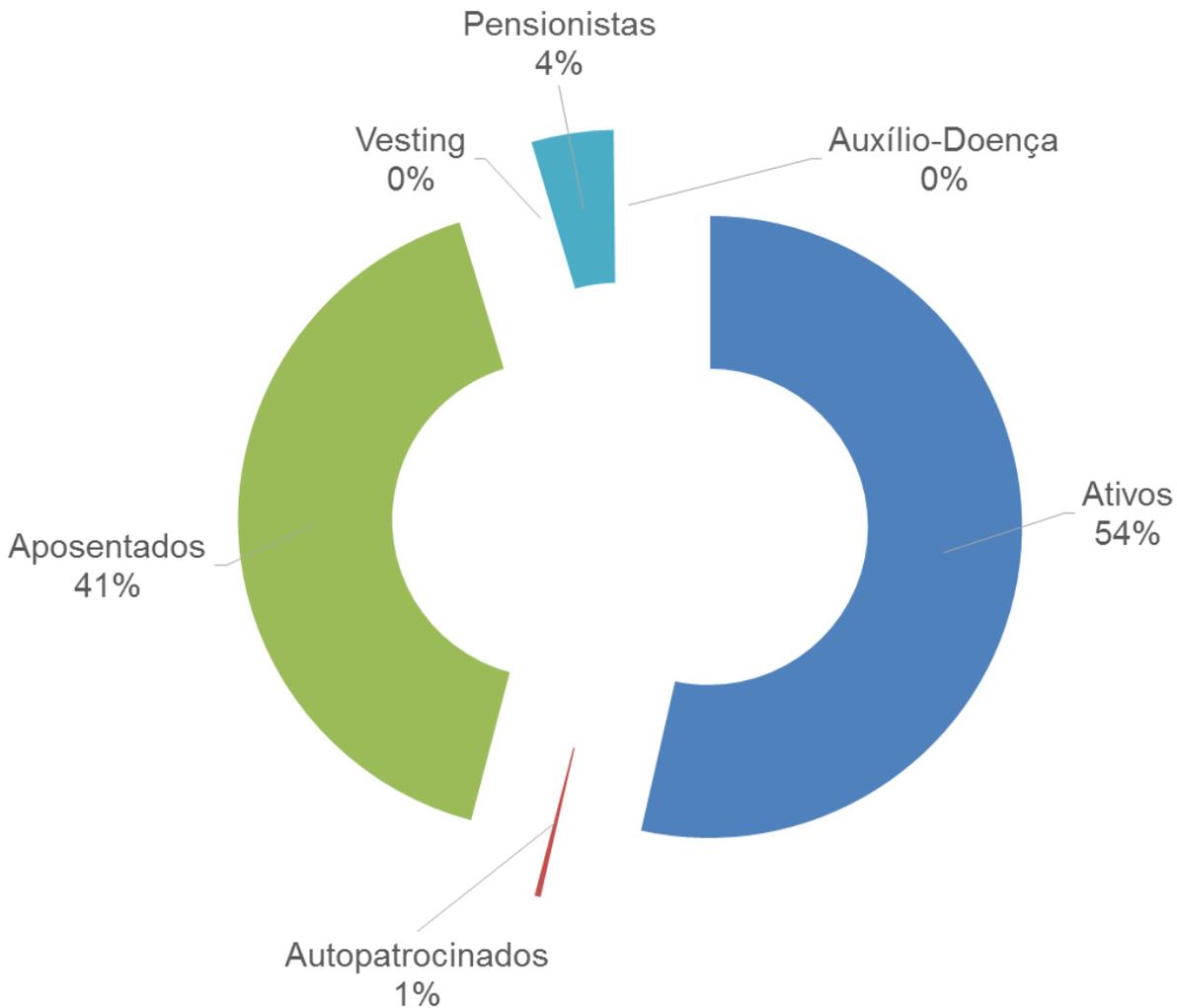
Os números do Plano BD, tem como finalidade estreitar o relacionamento entre entidade, patrocinadoras e participantes. Divulgar a situação financeira do Plano, demonstra maior transparência e mantém a estabilidade e sustentabilidade do Plano de Benefício.

Balancete Consolidado

| Junho/2017 | | | |
|-------------------------------|-----------------------|---|------------------------|
| Ativo | R\$ | Passivo | R\$ |
| Disponível | 110.749,42 | Exigível Operacional | -6.501.274,03 |
| | | Gestão Previdencial | -5.505.738,78 |
| | | Gestão Administrativa | -891.032,86 |
| Realizável | 711.692.009,22 | Investimentos | -104.502,39 |
| | | Exigível Contingencial | -8.742.065,57 |
| Gestão Previdencial | 2.329.194,34 | Gestão Previdencial | -8.736.234,43 |
| Gestão Administrativa | 66.025,38 | Gestão Administrativa | -5.831,14 |
| | | Investimentos | 0,00 |
| Investimentos | 709.296.789,50 | | |
| Títulos Públicos | 346.578.469,06 | Patrimônio Social | -696.734.594,60 |
| Créditos Privados e Depósitos | 89.183.485,26 | Patrimônio de Cober. do Plano | -693.297.251,84 |
| Ações | 11.448.229,02 | Provisões Matemáticas | -765.893.052,30 |
| Fundo de Investimento | 224.502.590,18 | Benefícios Cencedidos | -391.240.984,52 |
| Investimentos Imobiliários | 29.501.629,99 | Benefícios a Conceder | -376.154.482,38 |
| Empréstimos | 8.082.385,99 | Provisões Matemáticas a Constituir | 1.502.414,60 |
| | | Déficit Equacionado | 1.502.414,60 |
| | | | |
| | | Equilíbrio Técnico | 72.595.800,46 |
| Permanente | 175.175,56 | Resultados Realizados | 72.595.800,46 |
| Imobilizado | 136.975,16 | Déficit Técnico Acumulado | 72.595.800,46 |
| Diferido | 38.200,40 | Até o Exercício Anterior | 87.904.717,18 |
| | | No Exercício Atual | -15.308.916,72 |
| | | | |
| | | Fundos | -3.437.342,76 |
| | | Fundo Administrativo | -2.476.864,01 |
| | | Fundos dos Investimentos | -960.478,75 |
| Total | 711.977.934,20 | Total | -711.977.934,20 |

Quadro de Participantes

| Junho/2017 | |
|------------------|--------------|
| Participantes | Quantidade |
| Ativos | 656 |
| Autopatrocinados | 06 |
| Aposentados | 506 |
| Vesting | 01 |
| Pensionistas | 54 |
| Auxílio-Doença | 02 |
| Total | 1.226 |



Fluxo de Recursos

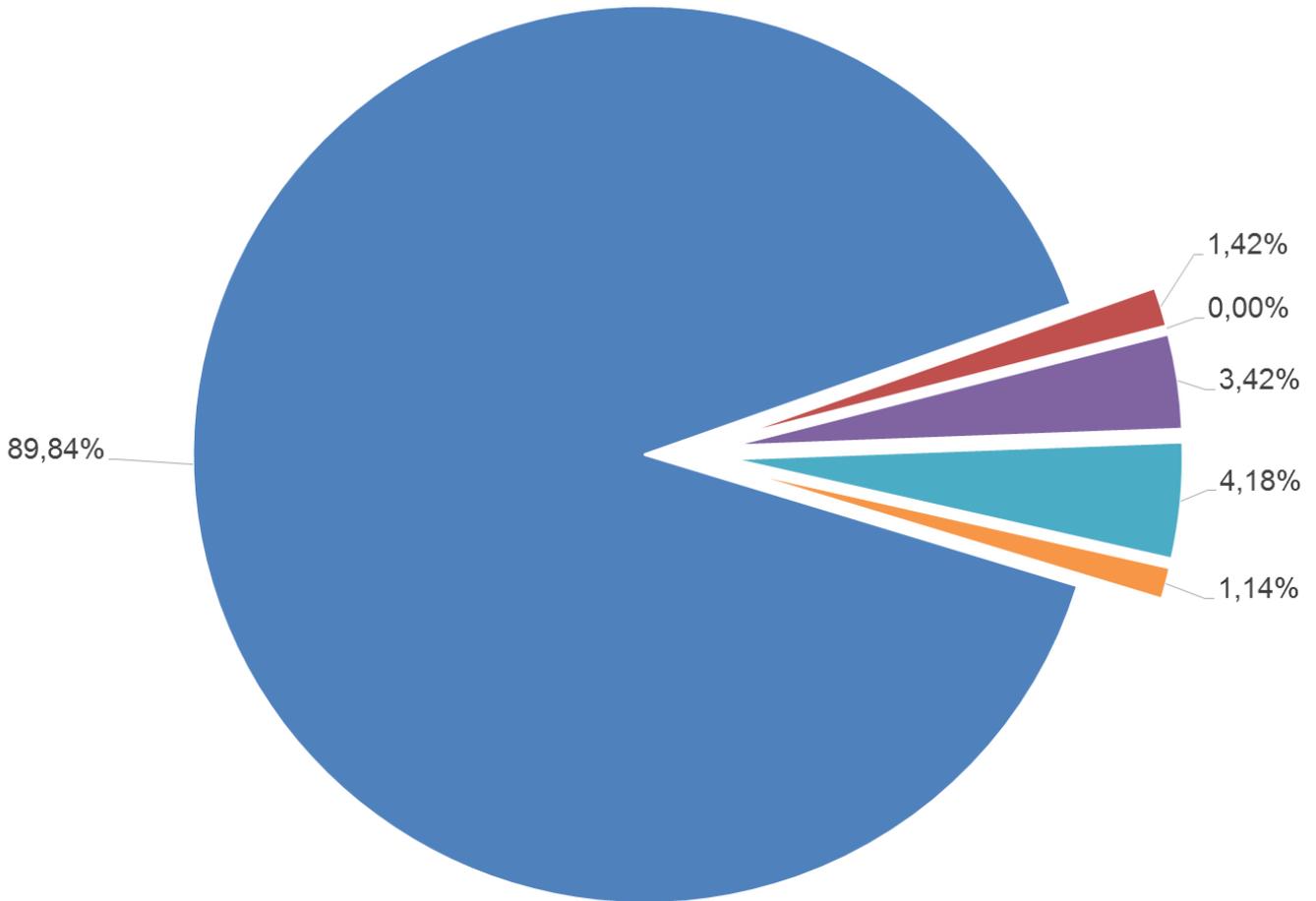
| Discriminação | Exercício 2017 | |
|---|------------------|------------------------|
| | Junho | Acumulado No Exercício |
| Adições (Contribuições Recebidas) (A) | 1.513.818 | 10.118.995 |
| Patronais (A.1) | 566.135 | 3.869.668 |
| Participantes (A.2) | 934.282 | 6.007.940 |
| Ativos | 566.135 | 3.869.668 |
| Assistidos | 368.147 | 2.138.272 |
| Autofinanciados (A.3) | 13.401 | 241.387 |
| Deduções (Benefícios Pagos) (B) | 2.380.514 | 14.377.409 |
| Prestação Continuada | 2.380.488 | 13.918.948 |
| Aposentadoria Programada | 2.175.764 | 12.644.552 |
| Invalidez | 112.563 | 685.283 |
| Pensões | 91.845 | 550.760 |
| Auxílio-doença | 316 | 38.353 |
| Prestação Única | 0 | 397.062 |
| Pecúlio | 0 | 397.062 |
| Institutos | 26 | 61.399 |
| Resgate de Contribuição/ Portabilidade | 26 | 61.399 |
| (=) Resultado do Fluxo | (866.696) | (4.258.414) |
| Contrib. Patronais X Particip. Ativos | 100% | 100% |
| Contrib. Recebidas X Benefícios Pagos (A/B) | 64% | 70% |

Enquadramento

| Aplicações | Junho/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 | 634.516.293 | 89,84% | 85,74% | 100,00% | 100,00% |
| Notas do Tesouro Nacional "B" - NTN-B | 346.578.469 | 49,07% | | | |
| Letras Financeiras Subordinadas | 83.682.368 | 11,85% | | | |
| Letras Financeiras | 5.501.117 | 0,78% | | | |
| Fundos de Investimento - FI | 198.754.339 | 28,14% | | | |
| Investimentos Estruturados | 10.040.137 | 1,42% | 2,98% | 10,00% | 20,00% |
| Fundos de Invest. Multimercados - FIM | 10.040.137 | 1,42% | | | |
| Investimentos no Exterior | - | - | 1,99% | 2,50% | 10,00% |
| Renda Variável | 24.150.387 | 3,42% | 2,69% | 20,00% | 70,00% |
| Ações | 11.448.229 | 1,62% | | | |
| Fundos de Investimento em Ações - FIA | 12.702.158 | 1,80% | | | |
| Imóveis | 29.501.630 | 4,18% | 5,52% | 7,00% | 8,00% |
| Empréstimos | 8.082.386 | 1,14% | 1,08% | 14,00% | 15,00% |
| = Total dos Investimentos | 706.290.832 | 100,00% | 100,00% | - | - |
| (+) Disponível | 109.822 | 0,03% | - | - | - |
| (-) Exigível Operacional | (217.878) | (0,03%) | - | - | - |
| = Total Recursos Garantidores ² | 706.182.776 | 100,00% | - | - | - |

Enquadramento

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



Carteira Própria

| Carteira Própria | | | | 30/06/2017 |
|--|------------|--------------------------|---------------|-----------------------|
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| NTN-B | | | | |
| 20/05/2015 | 15/05/2019 | 46.225.868,00 | IPCA + 6,62% | |
| 14/08/2015 | 15/05/2019 | 21.909.404,55 | IPCA + 7,07% | |
| 26/08/2015 | 15/05/2019 | 11.260.332,94 | IPCA + 7,20% | |
| 16/12/2015 | 15/05/2019 | 27.714.194,37 | IPCA + 7,51% | |
| Total 2019 | | | | 107.109.799,86 |
| 03/08/2016 | 15/05/2021 | 10.198.335,53 | IPCA + 6,23% | |
| 31/08/2016 | 15/05/2021 | 10.051.709,12 | IPCA + 6,23% | |
| Total 2021 | | | | 20.250.044,65 |
| 22/05/2017 | 15/08/2022 | 5.017.455,72 | IPCA + 5,92% | |
| 24/05/2017 | 15/08/2022 | 4.940.204,71 | IPCA + 5,85% | |
| Total 2022 | | | | 9.957.660,43 |
| 23/05/2017 | 15/05/2023 | 10.074.368,15 | IPCA + 5,90% | |
| Total 2023 | | | | 10.074.368,15 |
| 06/12/2006 | 15/08/2024 | 20.360.892,76 | IPCA + 7,91% | |
| Total 2024 | | | | 20.360.892,76 |
| 31/05/2017 | 15/08/2026 | 10.037.672,22 | IPCA + 5,68% | |
| Total 2026 | | | | 10.037.672,22 |
| 10/08/2011 | 15/08/2030 | 14.662.161,15 | IPCA + 6,30% | |
| Total 2030 | | | | 14.662.161,15 |
| 19/05/2017 | 15/05/2035 | 10.058.822,29 | IPCA + 5,50% | |
| Total 2035 | | | | 10.058.822,29 |
| 15/08/2013 | 15/08/2040 | 26.775.946,64 | IPCA + 5,59% | |
| 28/11/2013 | 15/08/2040 | 4.715.607,22 | IPCA + 6,35% | |
| Total 2040 | | | | 31.491.553,86 |
| 20/08/2007 | 15/05/2045 | 13.591.698,48 | IPCA + 6,85% | |
| 13/11/2007 | 15/05/2045 | 8.893.260,03 | IPCA + 6,42% | |
| 11/01/2008 | 15/05/2045 | 11.346.420,92 | IPCA + 6,51% | |
| 29/05/2008 | 15/05/2045 | 13.797.020,35 | IPCA + 6,73% | |
| 10/09/2008 | 15/05/2045 | 13.300.092,04 | IPCA + 7,03% | |
| 14/10/2008 | 15/05/2045 | 17.047.959,84 | IPCA + 7,78% | |
| 24/10/2008 | 15/05/2045 | 4.504.004,84 | IPCA + 8,48% | |
| 24/10/2008 | 15/05/2045 | 4.730.187,59 | IPCA + 8,50% | |
| 21/11/2008 | 15/05/2045 | 5.445.969,78 | IPCA + 8,03% | |
| 17/05/2010 | 15/05/2045 | 5.015.923,23 | IPCA + 6,20% | |
| 29/06/2017 | 15/05/2045 | 9.868.683,87 | IPCA + 5,73% | |
| Total 2045 | | | | 107.541.220,97 |
| 22/05/2017 | 15/08/2050 | 5.034.272,72 | IPCA + 5,65% | |
| Total 2050 | | | | 5.034.272,72 |
| Total Aplicado | | | | 346.578.469,06 |
| Letra Financeira Subordinada - Banese | | | | 30/06/2017 |
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| 24/07/2015 | 24/07/2023 | 61.922.005,50 | INPC + 8,45% | |
| Total Aplicado | | | | 61.922.005,50 |
| Letra Financeira Subordinada - BRB | | | | 30/06/2017 |
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| 29/04/2013 | 29/04/2020 | 17.278.938,77 | IPCA + 6,70% | |
| Total Aplicado | | | | 17.278.938,77 |
| Letra Financeira Subordinada - Itaú | | | | 30/06/2017 |
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| 27/07/2015 | 14/11/2022 | 1.434.273,27 | IPCA + 6,70% | |
| Total Aplicado | | | | 1.434.273,27 |
| Letra Financeira - Banco Original | | | | 30/06/2017 |
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| 02/08/2016 | 02/08/2018 | 5.501.117,27 | IPCA + 8,10% | |
| Total Aplicado | | | | 5.501.117,27 |
| Letra Financeira Subordinada - Banco Votorantim | | | | 30/06/2017 |
| Aplicação | Vencimento | Valor Líquido | Taxa | |
| 18/04/2017 | 17/04/2023 | 3.047.150,45 | IPCA + 6,20% | |
| Total Aplicado | | | | 3.047.150,45 |
| Ações - Banese | | | | 30/06/2017 |
| Código/Papel | Quantidade | Cotação (valor unitário) | Valor Líquido | |
| BGIP3 - Banese ON | 337.290,00 | 28,15 | 9.494.713,50 | |
| BGIP4 - Banese PN | 74.448,00 | 26,24 | 1.953.515,52 | |
| Total Aplicado | | | | 11.448.229,02 |
| Imóveis (06/2017) | | | | 29.501.629,99 |
| Empréstimos (06/2017) | | | | 8.082.385,93 |
| Total Carteira Própria Sergus | | | | 484.794.199,26 |

Vencimentos

| Carteira Terceirizada | | 30/06/2017 |
|---|---------------------------|--------------------------------|
| Vencimento | Valor (R\$) | Fundos |
| D+0 | 72.356.496,10 | Bozano Acaju |
| D+1 | 117.315.504,68 | Fator Pirambu e Novero Poxim |
| D+13 | 12.702.157,85 | Studio FIC FIA |
| D+16 | 8.735.014,56 | Brasil Plural Institucional 15 |
| D+20 | 10.040.136,52 | Oceana Long Short |
| Total Aplicado | R\$ 221.149.309,71 | |
| 2018 | 347.323,43 | BTG Emissões Primárias II |
| Total Aplicado | 347.323,43 | |
| Total Carteira Terceirizada Sergus | R\$ 221.496.633,14 | |

Rentabilidade Total dos Investimentos

| Aplicações | Mensal |
|--------------------------------|--------------|
| Total dos Investimentos | 0,77% |
| Renda Fixa | 0,60% |
| Investimentos Estruturados | 1,31% |
| Renda Variável | 5,13% |
| Imóveis | 0,80% |
| Empréstimos | 0,93% |

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 | 711.978 | 03,85 |

¹ Referente a Junho

Evolução

