

#sergus20

PLANO BD NÚMEROS

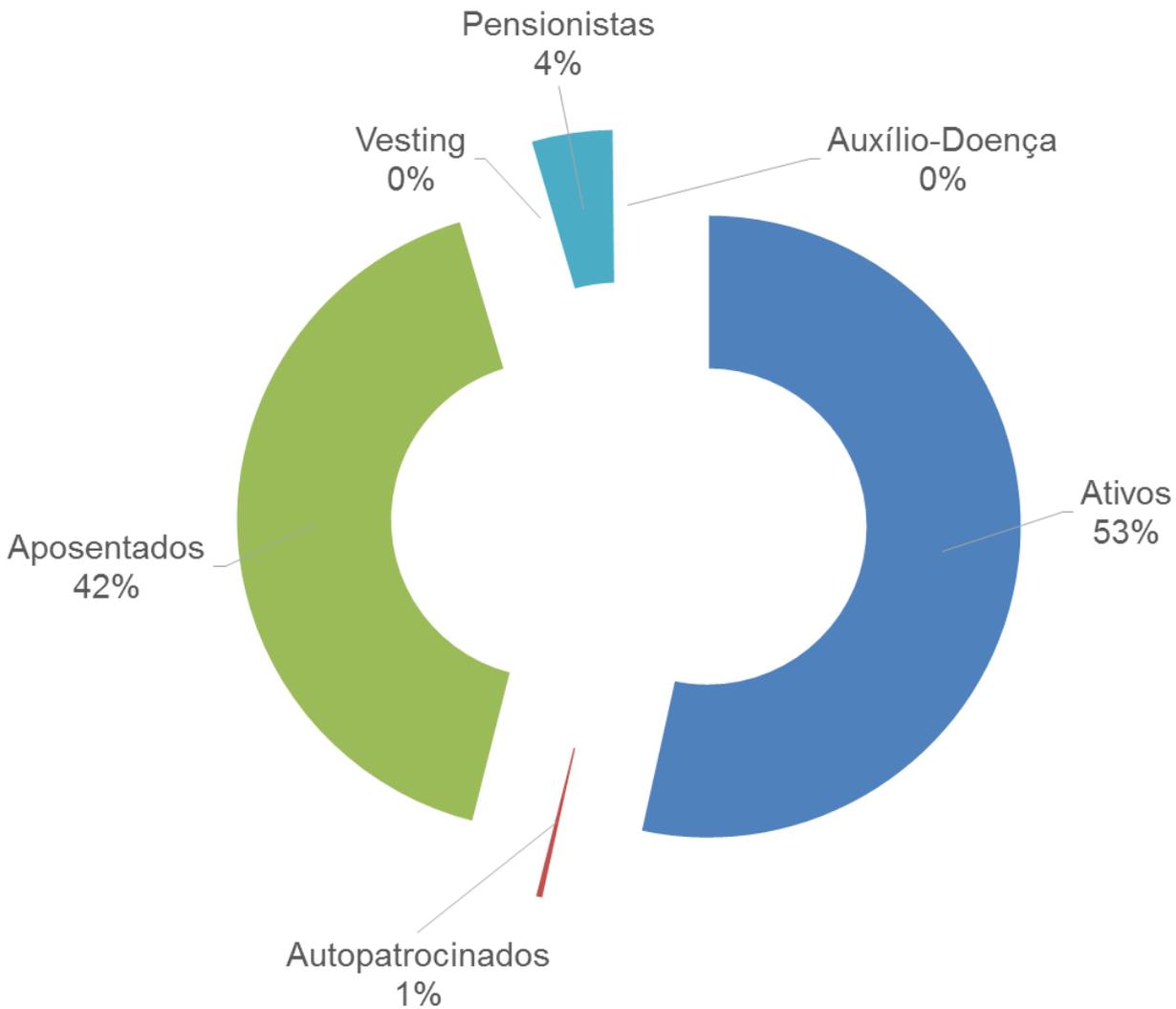
Os números do Plano BD, tem como finalidade estreitar o relacionamento entre entidade, patrocinadoras e participantes. Divulgar a situação financeira do Plano, demonstra maior transparência e mantém a estabilidade e sustentabilidade do Plano de Benefício.

Balancete Consolidado

Julho/2017			
Ativo	R\$	Passivo	R\$
Disponível	128.166,53	Exigível Operacional	-6.720.084,99
		Gestão Previdencial	-5.768.552,69
		Gestão Administrativa	-865.432,11
Realizável	717.572.149,36	Investimentos	-86.100,19
		Exigível Contingencial	-9.179.690,74
Gestão Previdencial	1.690.738,29	Gestão Previdencial	-9.173.849,69
Gestão Administrativa	64.865,09	Gestão Administrativa	-5.841,05
		Investimentos	0,00
Investimentos	715.816.545,98		
Títulos Públicos	348.102.625,40	Patrimônio Social	-701.971.236,23
Créditos Privados e Depósitos	89.441.816,56	Patrimônio de Cober. do Plano	-698.440.655,35
Ações	12.464.111,10	Provisões Matemáticas	-768.240.153,94
Fundo de Investimento	227.805.987,71	Benefícios Cencedidos	-391.299.865,64
Investimentos Imobiliários	29.501.629,99	Benefícios a Conceder	-378.393.885,05
Empréstimos	8.500.375,22	Provisões Matemáticas a Constituir	1.453.596,75
		Déficit Equacionado	1.453.596,75
		Equilíbrio Técnico	69.799.498,59
Permanente	170.696,07	Resultados Realizados	69.799.498,59
Imobilizado	133.203,08	Déficit Técnico Acumulado	69.799.498,59
Diferido	37.492,99	Até o Exercício Anterior	87.904.717,18
		No Exercício Atual	-18.105.218,59
		Fundos	-3.530.580,88
		Fundo Administrativo	-2.552.668,69
		Fundos dos Investimentos	-977.912,19
Total	717.871.011,96	Total	-717.871.011,96

Quadro de Participantes

Julho/2017	
Participantes	Quantidade
Ativos	653
Autopatrocínados	06
Aposentados	507
Vesting	01
Pensionistas	53
Auxílio-Doença	02
Total	1.226



Fluxo de Recursos

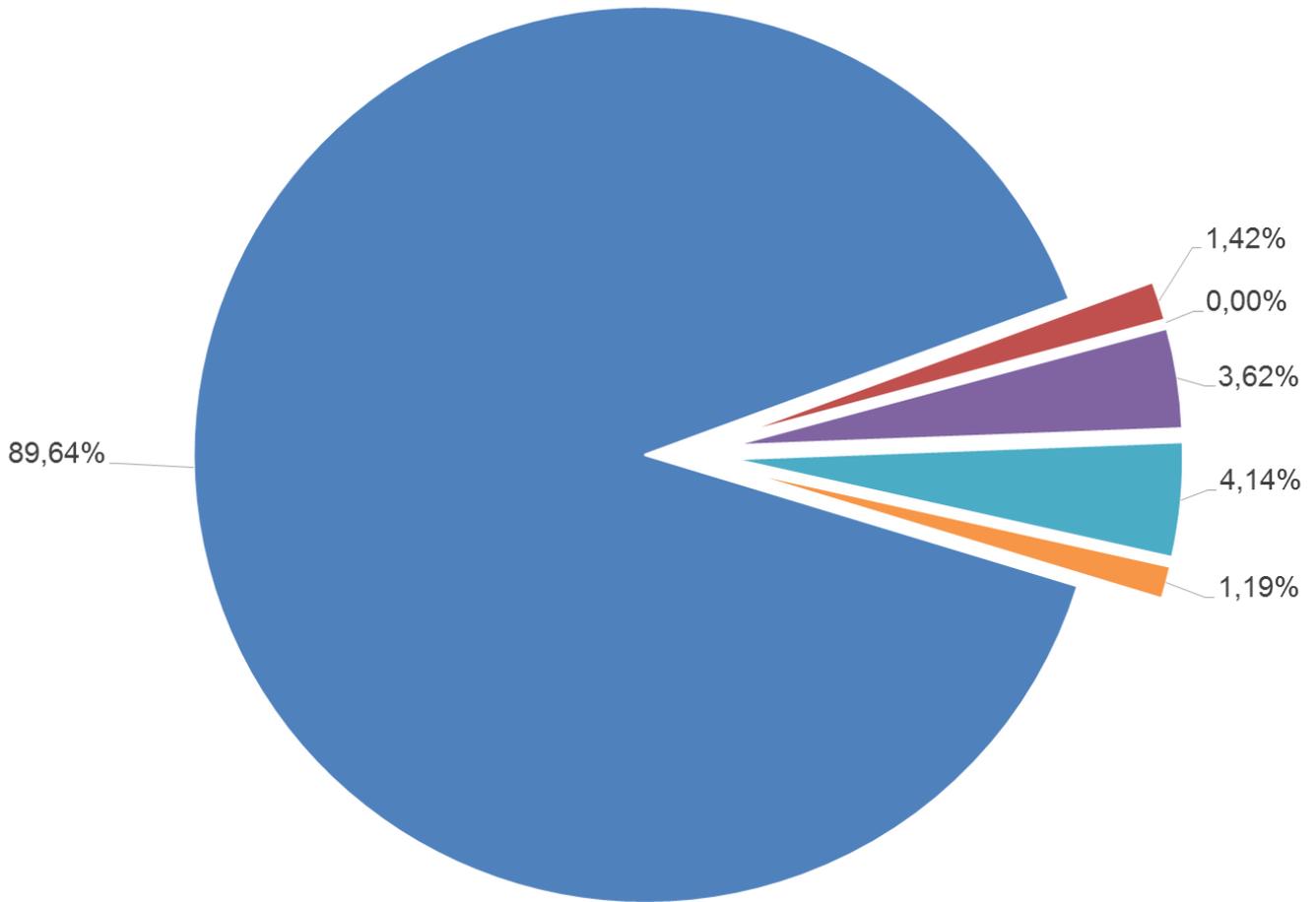
Discriminação	Exercício 2017	
	Julho	Acumulado no Exercício
Adições (Contribuições Recebidas) (A)	2.600.465	12.719.460
Patronais (A.1)	1.084.751	4.954.419
Participantes (A.2)	1.446.351	7.454.291
Ativos	1.084.751	4.954.419
Assistidos	361.600	2.499.872
Autofinanciados (A.3)	69.363	310.750
Deduções (Benefícios Pagos) (B)	2.403.527	16.780.936
Prestação Continuada	2.337.350	16.256.298
Aposentadoria Programada	2.124.373	14.768.925
Invalidez	112.563	797.846
Pensões	91.232	641.992
Auxílio-doença	9.182	47.535
Prestação Única	54.001	451.063
Pecúlio	54.001	451.063
Institutos	12.176	73.575
Resgate de Contribuição/ Portabilidade	12.176	73.575
(=) Resultado do Fluxo	196.938	(4.061.476)
Contrib. Patronais X Particip. Ativos	100%	100%
Contrib. Recebidas X Benefícios Pagos (A/B)	108%	76%

Enquadramento

Aplicações	Julho/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	638.745.857	89,64%	85,74%	100,00%	100,00%
Notas do Tesouro Nacional "B" - NTN-B	348.102.625	48,85%			
Letras Financeiras Subordinadas	83.903.653	11,77%			
Letras Financeiras	5.538.163	0,78%			
Fundos de Investimento - FI	201.201.415	28,24%			
Investimentos Estruturados	10.140.143	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	25.765.704	3,62%	2,69%	20,00%	70,00%
Ações	12.464.111	1,75%			
Fundos de Investimento em Ações - FIA	13.301.593	1,87%			
Imóveis	29.501.630	4,14%	5,52%	7,00%	8,00%
Empréstimos	8.500.375	1,19%	1,08%	14,00%	15,00%
= Total dos Investimentos	712.653.709	100,01%	100,00%	-	-
(+) Disponível	123.109	0,02%	-	-	-
(-) Exigível Operacional	(186.970)	(0,03%)	-	-	-
= Total Recursos Garantidores ²	712.589.848	100,00%	-	-	-

Enquadramento

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



Carteira Própria

Carteira Própria				31/07/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
NTN-B				
20/05/2015	15/05/2019	46.426.068,47	IPCA + 6,62%	
14/08/2015	15/05/2019	22.012.084,21	IPCA + 7,07%	
26/08/2015	15/05/2019	11.314.239,32	IPCA + 7,20%	
16/12/2015	15/05/2019	27.853.495,75	IPCA + 7,51%	
Total 2019				107.605.887,75
03/08/2016	15/05/2021	10.239.446,93	IPCA + 6,23%	
31/08/2016	15/05/2021	10.092.148,78	IPCA + 6,23%	
Total 2021				20.331.595,71
22/05/2017	15/08/2022	5.036.397,65	IPCA + 5,92%	
24/05/2017	15/08/2022	4.958.566,56	IPCA + 5,85%	
Total 2022				9.994.964,21
23/05/2017	15/05/2023	10.112.237,23	IPCA + 5,90%	
Total 2023				10.112.237,23
06/12/2006	15/08/2024	20.469.588,98	IPCA + 7,91%	
Total 2024				20.469.588,98
31/05/2017	15/08/2026	10.073.598,11	IPCA + 5,68%	
Total 2026				10.073.598,11
10/08/2011	15/08/2030	14.722.022,00	IPCA + 6,30%	
Total 2030				14.722.022,00
19/05/2017	15/05/2035	10.093.506,68	IPCA + 5,50%	
Total 2035				10.093.506,68
15/08/2013	15/08/2040	26.870.247,92	IPCA + 5,59%	
28/11/2013	15/08/2040	4.735.044,04	IPCA + 6,35%	
Total 2040				31.605.291,96
20/08/2007	15/05/2045	13.653.078,27	IPCA + 6,85%	
13/11/2007	15/05/2045	8.930.405,97	IPCA + 6,42%	
11/01/2008	15/05/2045	11.394.610,36	IPCA + 6,51%	
29/05/2008	15/05/2045	13.858.011,80	IPCA + 6,73%	
10/09/2008	15/05/2045	13.362.007,58	IPCA + 7,03%	
14/10/2008	15/05/2045	17.137.281,64	IPCA + 7,78%	
24/10/2008	15/05/2045	4.530.055,04	IPCA + 8,48%	
24/10/2008	15/05/2045	4.757.619,12	IPCA + 8,50%	
21/11/2008	15/05/2045	5.475.553,49	IPCA + 8,03%	
17/05/2010	15/05/2045	5.036.005,51	IPCA + 6,20%	
29/06/2017	15/05/2045	9.907.073,57	IPCA + 5,73%	
Total 2045				108.041.702,35
22/05/2017	15/08/2050	5.052.230,42	IPCA + 5,65%	
Total 2050				5.052.230,42
Total Aplicado				348.102.625,40
Letra Financeira Subordinada - Banese				31/07/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
24/07/2015	24/07/2023	62.069.825,80	INPC + 8,45%	
Total Aplicado				62.069.825,80
Letra Financeira Subordinada - BRB				31/07/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
29/04/2013	29/04/2020	17.333.953,65	IPCA + 6,70%	
Total Aplicado				17.333.953,65
Letra Financeira Subordinada - Itaú				31/07/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
27/07/2015	14/11/2022	1.440.786,27	IPCA + 6,70%	
Total Aplicado				1.440.786,27
Letra Financeira - Banco Original				31/07/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
02/08/2016	02/08/2018	5.538.163,31	IPCA + 8,10%	
Total Aplicado				5.538.163,31
Letra Financeira Subordinada - Banco Votorantim				31/07/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
18/04/2017	17/04/2023	3.059.087,53	IPCA + 6,20%	
Total Aplicado				3.059.087,53
Ações - Banese				31/07/2017
Código/Papel	Quantidade	Cotação (valor unitário)	Valor Líquido	
BGIP3 - Banese ON	337.290,00	30,95	10.439.125,50	
BGIP4 - Banese PN	74.448,00	27,20	2.024.985,60	
Total Aplicado			12.464.111,10	
Imóveis			29.501.629,99	
Empréstimos			8.500.375,22	
Total Carteira Própria Sergus			488.010.558,27	

Vencimentos

Carteira Terceirizada		31/07/2017
Vencimento	Valor (R\$)	Fundos
D+0	73.024.877,73	Bozano Acaju
D+1	118.985.363,32	Fator Pirambu e Novero Poxim
D+13	13.301.592,50	Studio FIC FIA
D+16	8.840.427,09	Brasil Plural Institucional 15
D+20	10.140.143,34	Oceana Long Short
Total Aplicado	R\$ 224.292.403,98	
2018	350.752,28	BTG Emissões Primárias II
Total Aplicado	350.752,28	
Total Carteira Terceirizada Sergus	R\$ 224.643.156,26	

Rentabilidade Total dos Investimentos

Aplicações	Mensal
Total dos Investimentos	0,97%
Renda Fixa	0,77%
Investimentos Estruturados	1,00%
Renda Variável	6,69%
Imóveis	0,45%
Empréstimos	1,02%

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	717.871	04,71

¹ Referente a Julho

Evolução

