

#sergus 20

PLANO BD NÚMEROS

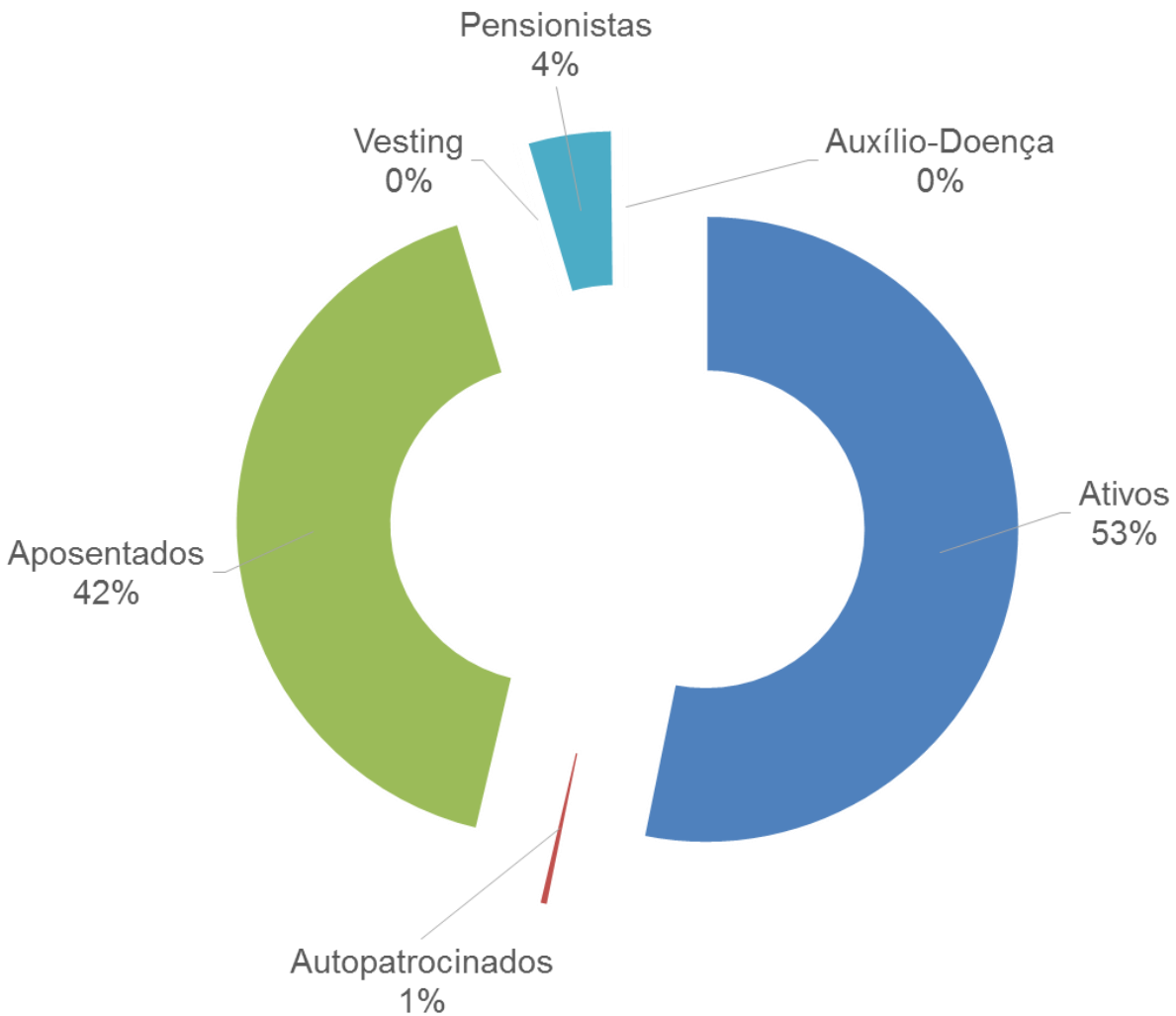
Os números do Plano BD, tem como finalidade estreitar o relacionamento entre entidade, patrocinadoras e participantes. Divulgar a situação financeira do Plano, demonstra maior transparência e mantém a estabilidade e sustentabilidade do Plano de Benefício.

Balancete Consolidado

Agosto/2017			
Ativo	R\$	Passivo	R\$
Disponível	30.903,96	Exigível Operacional	-6.966.123,37
		Gestão Previdencial	-6.016.921,49
		Gestão Administrativa	-886.906,14
Realizável	725.956.767,13	Investimentos	-62.295,74
		Exigível Contingencial	-8.333.054,19
Gestão Previdencial	2.008.436,80	Gestão Previdencial	-8.327.213,14
Gestão Administrativa	62.376,19	Gestão Administrativa	-5.841,05
		Investimentos	0,00
Investimentos	723.885.954,14		
Títulos Públicos	348.899.315,48	Patrimônio Social	-710.854.710,23
Créditos Privados e Depósitos	90.337.479,65	Patrimônio de Cober. do Plano	-707.241.457,58
Ações	15.382.890,60	Provisões Matemáticas	-770.850.109,36
Fundo de Investimento	231.068.021,76	Benefícios Cencedidos	-391.491.869,57
Investimentos Imobiliários	29.601.339,50	Benefícios a Conceder	-380.769.978,13
Empréstimos	8.596.907,15	Provisões Matemáticas a Constituir	1.411.738,34
		Déficit Equacionado	1.411.738,34
		Equilíbrio Técnico	63.608.651,78
Permanente	166.216,70	Resultados Realizados	63.608.651,78
Imobilizado	129.431,12	Déficit Técnico Acumulado	63.608.651,78
Diferido	36.785,58	Até o Exercício Anterior	87.904.717,18
		No Exercício Atual	-24.296.065,40
		Fundos	-3.613.252,65
		Fundo Administrativo	-2.615.080,32
		Fundos dos Investimentos	-998.172,33
Total	726.153.887,79	Total	-726.153.887,79

Quadro de Participantes

Agosto/2017	
Participantes	Quantidade
Ativos	649
Autopatrocínados	06
Aposentados	508
Vesting	01
Pensionistas	54
Auxílio-Doença	02
Total	1.226



Fluxo de Recursos

Discriminação	Exercício 2017	
	Agosto	Acumulado no Exercício
Adições (Contribuições Recebidas) (A)	1.517.927	14.238.098
Patronais (A.1)	556.241	5.510.660
Participantes (A.2)	930.964	8.385.253
Ativos	556.241	5.510.660
Assistidos	374.723	2.874.595
Autofinanciados (A.3)	30.721	342.185
Deduções (Benefícios Pagos) (B)	2.491.055	19.212.256
Prestação Continuada	2.423.439	18.679.738
Aposentadoria Programada	2.188.982	16.957.907
Invalidez	112.563	910.409
Pensões	118.645	760.637
Auxílio-doença	3.251	50.786
Prestação Única	27.473	478.536
Pecúlio	27.473	478.536
Institutos	40.143	53.982
Resgate de Contribuição/ Portabilidade	40.143	53.982
(=) Resultado do Fluxo	(973.128)	(4.974.157)
Contrib. Patronais X Particip. Ativos	100%	100%
Contrib. Recebidas X Benefícios Pagos (A/B)	61%	74%

Enquadramento

Aplicações	Agosto/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	640.931.070	88,96%	85,74%	100,00%	100,00%
Notas do Tesouro Nacional "B" - NTN-B	348.899.315	48,43%			
Letras Financeiras Subordinadas	84.731.611	11,76%			
Letras Financeiras	5.605.869	0,78%			
Fundos de Investimento - FI	201.694.275	27,99%			
Investimentos Estruturados	10.234.456	1,43%	2,98%	10,00%	20,00%
Fundos de Invest. Multimercados - FIM	10.234.456	1,43%			
Investimentos no Exterior	-	-	1,99%	2,50%	10,00%
Renda Variável	31.265.648	4,34%	2,69%	20,00%	70,00%
Ações	15.382.891	2,14%			
Fundos de Investimento em Ações - FIA	15.882.757	2,20%			
Imóveis	29.501.630	4,09%	5,52%	7,00%	8,00%
Empréstimos	8.596.907	1,19%	1,08%	14,00%	15,00%
= Total dos Investimentos	720.629.420	100,02%	100,00%	-	-
(+) Disponível	25.302	0,00%	-	-	-
(-) Exigível Operacional	(175.731)	(0,02%)	-	-	-
= Total Recursos Garantidores ²	720.478.991	100,00%	-	-	-

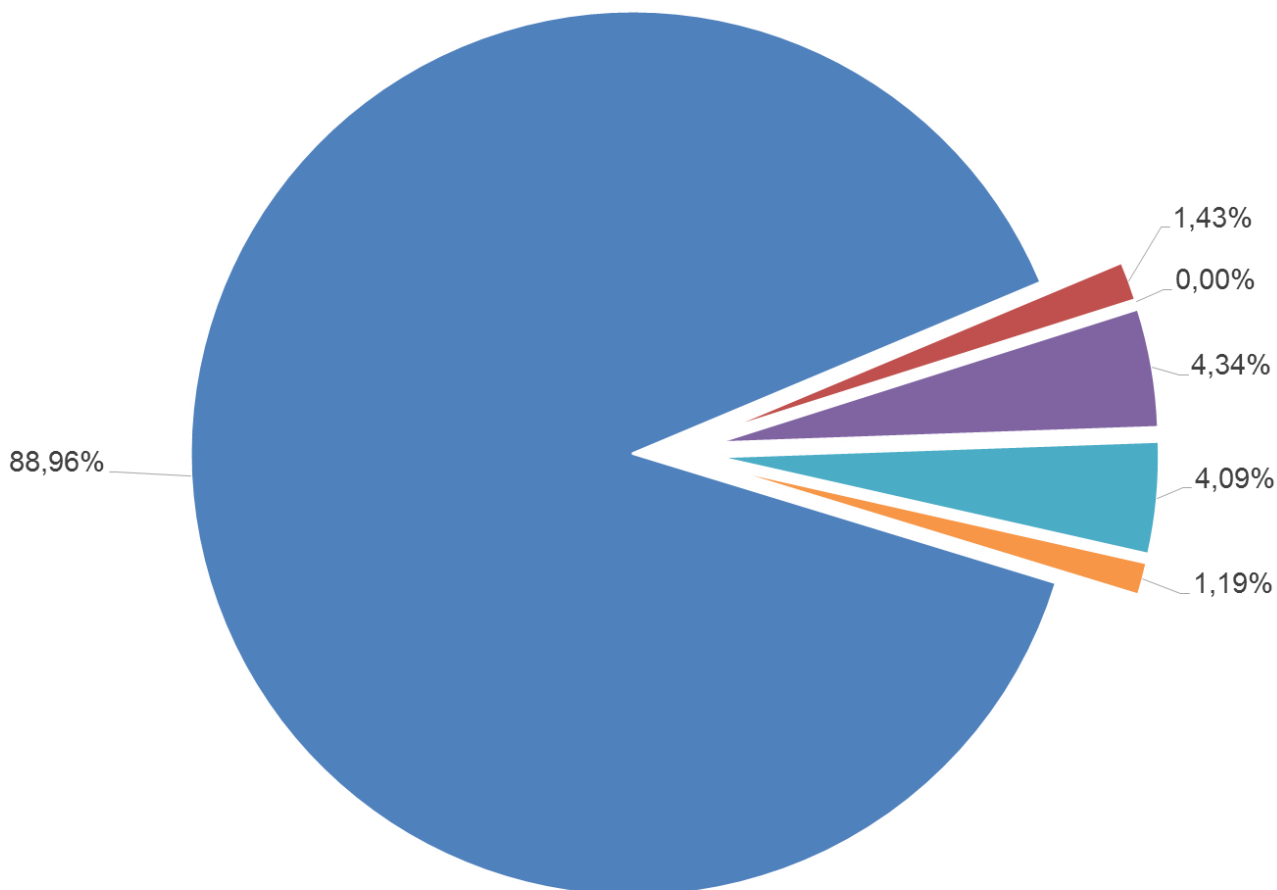
Observações:

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				31/08/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
NTN-B				
20/05/2015	15/05/2019	46.887.577,26	IPCA + 6,62%	
14/08/2015	15/05/2019	22.239.522,22	IPCA + 7,07%	
26/08/2015	15/05/2019	11.432.397,93	IPCA + 7,20%	
16/12/2015	15/05/2019	28.151.714,02	IPCA + 7,51%	
Total 2019				108.711.211,43
03/08/2016	15/05/2021	10.337.854,36	IPCA + 6,22%	
31/08/2016	15/05/2021	10.189.051,37	IPCA + 6,23%	
Total 2021				20.526.905,73
22/05/2017	15/08/2022	4.938.113,43	IPCA + 5,91%	
24/05/2017	15/08/2022	4.861.915,82	IPCA + 5,84%	
Total 2022				9.800.029,25
23/05/2017	15/05/2023	10.206.390,31	IPCA + 5,89%	
Total 2023				10.206.390,31
06/12/2006	15/08/2024	20.040.165,02	IPCA + 7,91%	
Total 2024				20.040.165,02
31/05/2017	15/08/2026	9.880.240,77	IPCA + 5,66%	
Total 2026				9.880.240,77
10/08/2011	15/08/2030	14.427.575,04	IPCA + 6,30%	
Total 2030				14.427.575,04
19/05/2017	15/05/2035	10.184.030,60	IPCA + 5,50%	
Total 2035				10.184.030,60
15/08/2013	15/08/2040	26.373.817,78	IPCA + 5,59%	
28/11/2013	15/08/2040	4.638.401,51	IPCA + 6,35%	
Total 2040				31.012.219,29
20/08/2007	15/05/2045	13.791.582,48	IPCA + 6,85%	
13/11/2007	15/05/2045	9.017.665,47	IPCA + 6,42%	
11/01/2008	15/05/2045	11.506.829,23	IPCA + 6,51%	
29/05/2008	15/05/2045	13.997.139,63	IPCA + 6,73%	
10/09/2008	15/05/2045	13.499.608,97	IPCA + 7,03%	
14/10/2008	15/05/2045	17.324.787,07	IPCA + 7,78%	
24/10/2008	15/05/2045	4.582.336,23	IPCA + 8,48%	
24/10/2008	15/05/2045	4.812.607,64	IPCA + 8,50%	
21/11/2008	15/05/2045	5.536.626,24	IPCA + 8,03%	
17/05/2010	15/05/2045	5.084.252,22	IPCA + 6,20%	
29/06/2017	15/05/2045	9.997.921,97	IPCA + 5,73%	
Total 2045				109.151.357,15
22/05/2017	15/08/2050	4.959.190,89	IPCA + 5,65%	
Total 2050				4.959.190,89
Total Aplicado				348.899.315,48
Letra Financeira Subordinada - Banese				31/08/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
24/07/2015	24/07/2023	62.703.596,65	INPC + 8,45%	
Total Aplicado				62.703.596,65
Letra Financeira Subordinada - BRB				31/08/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
29/04/2013	29/04/2020	17.484.898,60	IPCA + 6,70%	
Total Aplicado				17.484.898,60
Letra Financeira Subordinada - Itaú				31/08/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
27/07/2015	14/11/2022	1.455.425,34	IPCA + 6,70%	
Total Aplicado				1.455.425,34
Letra Financeira - Banco Original				31/08/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
02/08/2016	02/08/2018	5.605.868,98	IPCA + 8,10%	
Total Aplicado				5.605.868,98
Letra Financeira Subordinada - Banco Votorantim				31/08/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
18/04/2017	17/04/2023	3.087.690,08	IPCA + 6,20%	
Total Aplicado				3.087.690,08
Ações - Banese				31/08/2017
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	32,20	2.397.225,60	
Total Aplicado			15.382.890,60	
Carteira Própria				31/08/2017
Imóveis				29.601.339,50
Empréstimos				8.596.907,15
Total Carteira Própria Sergus				492.817.932,38

Vencimentos

Carteira Terceirizada		31/08/2017
Vencimento	Valor (R\$)	Fundos
D+0	73.827.483,20	Bozano Acaju
D+1	118.584.497,73	Fator Pirambu e Novero Poxim
D+4	1.994.322,81	Icatu Vanguarda Dividendos FIA
D+13	13.888.434,55	Studio FIC FIA
D+16	8.926.699,65	Brasil Plural Institucional 15
D+20	10.234.455,71	Oceana Long Short
Total Aplicado	R\$ 227.455.893,65	
2018	355.593,97	BTG Emissões Primárias II
Total Aplicado	355.593,97	
Total Carteira Terceirizada Sergus	R\$ 227.811.487,62	

Rentabilidade Total dos Investimentos

Aplicações	Mensal
Total dos Investimentos	1,41%
Renda Fixa	0,98%
Investimentos Estruturados	0,93%
Renda Variável	13,85%
Imóveis	0,12%
Empréstimos	0,77%

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	726.154	05,92

¹ Referente a Agosto

Evolução

