

#sergus20

PLANO BD NÚMEROS

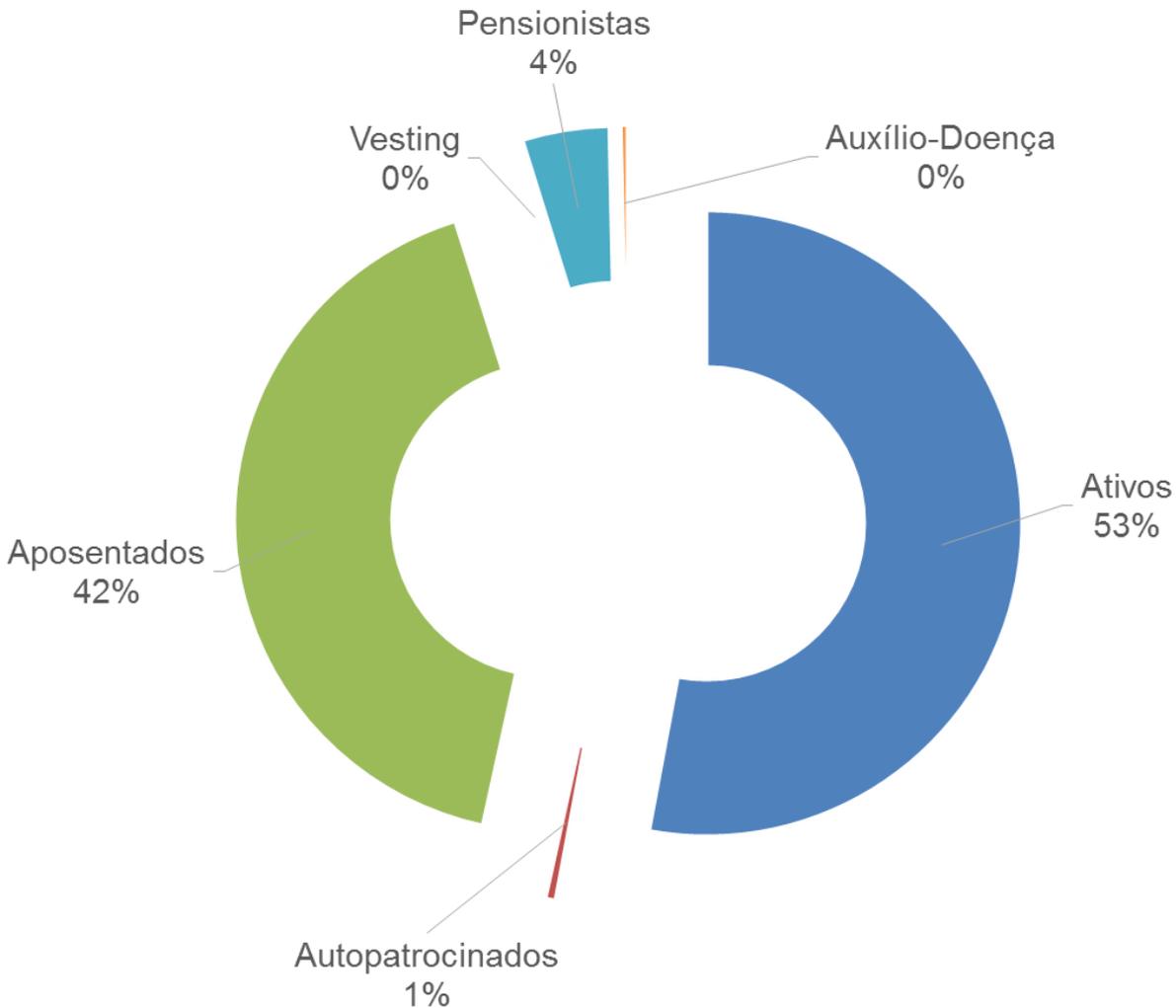
Os números do Plano BD, tem como finalidade estreitar o relacionamento entre entidade, patrocinadoras e participantes. Divulgar a situação financeira do Plano, demonstra maior transparência e mantém a estabilidade e sustentabilidade do Plano de Benefício.

Balancete Consolidado

Outubro/2017			
Ativo	R\$	Passivo	R\$
Disponível	149.948,34	Exigível Operacional	-7.430.203,49
		Gestão Previdencial	-6.435.516,96
		Gestão Administrativa	-955.730,77
Realizável	734.159.077,49	Investimentos	-38.955,76
		Exigível Contingencial	-6.845.182,01
Gestão Previdencial	2.565.068,11	Gestão Previdencial	-6.839.319,35
Gestão Administrativa	70.916,71	Gestão Administrativa	-5.862,66
		Investimentos	0,00
Investimentos	731.523.092,67		
Títulos Públicos	353.968.751,98	Patrimônio Social	-720.194.258,96
Créditos Privados e Depósitos	91.515.087,78	Patrimônio de Cober. do Plano	-716.300.076,84
Ações	15.309.539,04	Provisões Matemáticas	-774.702.787,47
Fundo de Investimento	232.430.891,27	Benefícios Cencedidos	-396.800.752,32
Investimentos Imobiliários	29.502.079,99	Benefícios a Conceder	-379.213.060,94
Empréstimos	8.796.742,61	Provisões Matemáticas a Constituir	1.311.025,79
		Déficit Equacionado	1.311.025,79
		Equilíbrio Técnico	58.402.710,63
Permanente	160.618,63	Resultados Realizados	58.402.710,63
Imobilizado	125.247,87	Déficit Técnico Acumulado	58.402.710,63
Diferido	35.370,76	Até o Exercício Anterior	87.904.717,18
		No Exercício Atual	-29.502.006,55
		Fundos	-3.894.182,12
		Fundo Administrativo	-2.869.378,74
		Fundos dos Investimentos	-1.024.803,38
Total	734.469.644,46	Total	-734.469.644,46

Quadro de Participantes

Outubro/2017	
Participantes	Quantidade
Ativos	644
Autopatrocínados	06
Aposentados	508
Vesting	01
Pensionistas	54
Auxílio-Doença	04
Total	1.217



Fluxo de Recursos

Discriminação	Exercício 2017	
	Outubro	Acumulado no Exercício
Adições (Contribuições Recebidas) (A)	1.525.368	17.291.198
Patronais (A.1)	563.164	6.637.311
Participantes (A.2)	936.453	10.260.201
Ativos	563.164	6.637.311
Assistidos	373.289	3.622.891
Autofinanciados (A.3)	25.751	393.686
Deduções (Benefícios Pagos) (B)	2.413.505	24.061.772
Prestação Continuada	2.413.505	23.517.924
Aposentadoria Programada	2.196.858	21.351.623
Invalidez	114.500	1.139.409
Pensões	94.239	949.115
Auxílio-doença	7.908	77.778
Prestação Única	0	478.536
Pecúlio	0	478.536
Institutos	0	65.312
Resgate de Contribuição/ Portabilidade	0	65.312
(=) Resultado do Fluxo	(888.136)	(6.770.572)
Contrib. Patronais X Particip. Ativos	100%	100%
Contrib. Recebidas X Benefícios Pagos (A/B)	63%	72%

Enquadramento

Aplicações	Outubro/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	629.103.011	86,44%	85,74%	100,00%	100,00%
Notas do Tesouro Nacional "B" - NTN-B	353.968.752	48,43%			
Letras Financeiras Subordinadas	85.813.292	11,79%			
Letras Financeiras	5.701.795	0,78%			
Fundos de Investimento - FI	183.619.171	25,24%			
Investimentos Estruturados	20.464.996	2,81%	2,98%	10,00%	20,00%
Fundos de Invest. Multimercados - FIM	20.464.996	2,81%			
Investimentos no Exterior	-	-	1,99%	2,50%	10,00%
Renda Variável	40.021.592	5,49%	2,69%	20,00%	70,00%
Ações	15.309.539	2,10%			
Fundos de Investimento em Ações - FIA	24.712.052	3,39%			
Imóveis	29.501.630	4,05%	5,52%	7,00%	8,00%
Empréstimos	8.796.743	1,21%	1,08%	14,00%	15,00%
= Total dos Investimentos	727.888.421	100,00%	100,00%	-	-
(+) Disponível	141.830	0,02%	-	-	-
(-) Exigível Operacional	(149.374)	(0,02%)	-	-	-
= Total Recursos Garantidores ²	727.880.877	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

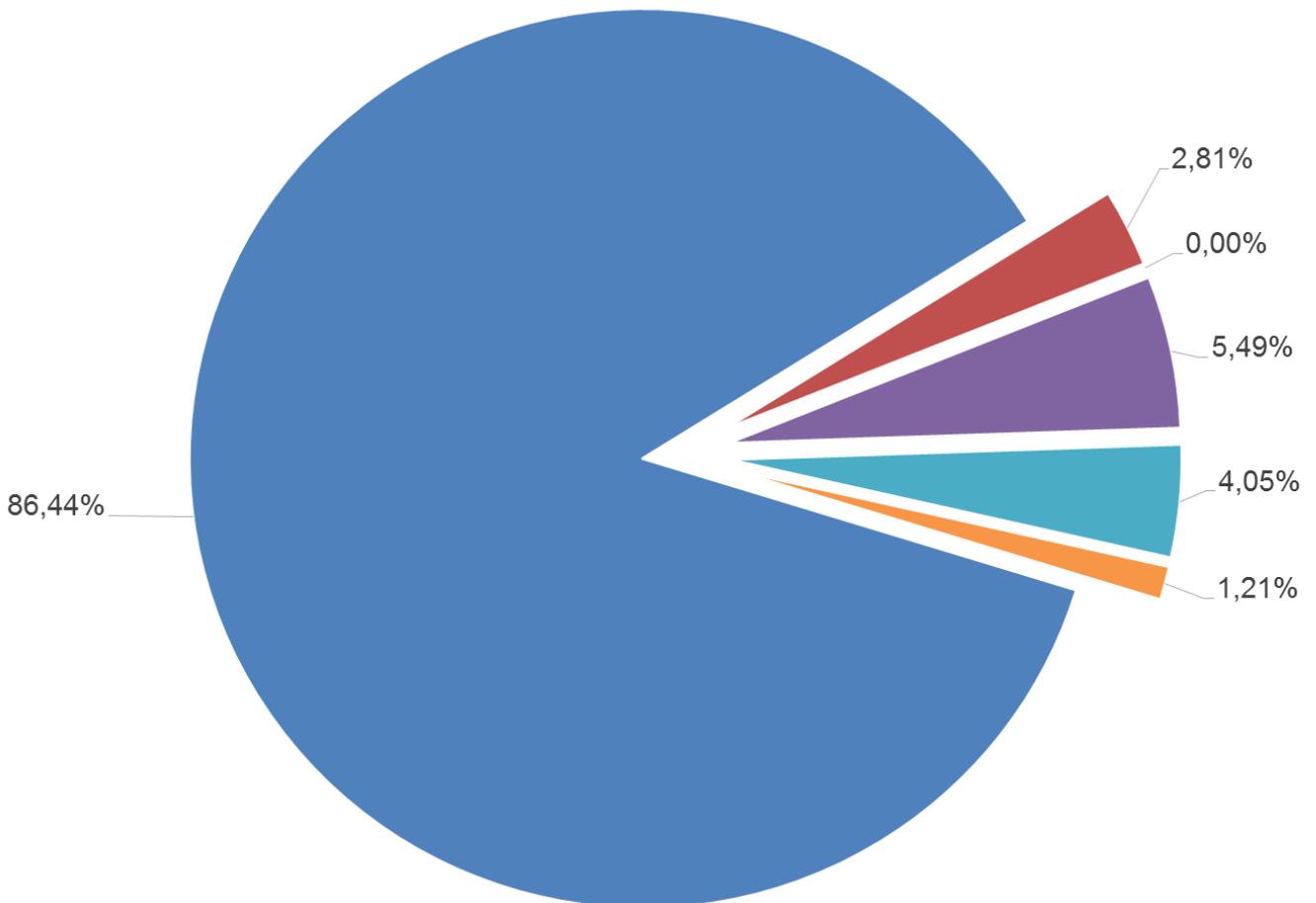
■ Investimentos Estruturados

■ Investimentos no Exterior

■ Renda Variável

■ Imóveis

■ Empréstimos



Carteira Própria

Carteira Própria				31/10/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
NTN-B				
20/05/2015	15/05/2019	47.563.068,37	IPCA + 6,62%	
14/08/2015	15/05/2019	22.575.517,74	IPCA + 7,07%	
26/08/2015	15/05/2019	11.607.390,66	IPCA + 7,20%	
16/12/2015	15/05/2019	28.595.904,18	IPCA + 7,51%	
Total 2019				110.341.880,95
03/08/2016	15/05/2021	10.480.678,38	IPCA + 6,22%	
31/08/2016	15/05/2021	10.329.658,38	IPCA + 6,23%	
Total 2021				20.810.336,76
22/05/2017	15/08/2022	5.003.844,91	IPCA + 5,91%	
24/05/2017	15/08/2022	4.926.073,57	IPCA + 5,84%	
Total 2022				9.929.918,48
23/05/2017	15/05/2023	10.341.921,18	IPCA + 5,89%	
Total 2023				10.341.921,18
06/12/2006	15/08/2024	20.368.712,28	IPCA + 7,91%	
Total 2024				20.368.712,28
31/05/2017	15/08/2026	10.007.938,83	IPCA + 5,66%	
Total 2026				10.007.938,83
10/08/2011	15/08/2030	14.628.365,64	IPCA + 6,30%	
Total 2030				14.628.365,64
19/05/2017	15/05/2035	10.313.027,24	IPCA + 5,50%	
Total 2035				10.313.027,24
15/08/2013	15/08/2040	26.711.713,76	IPCA + 5,59%	
28/11/2013	15/08/2040	4.703.312,65	IPCA + 6,35%	
Total 2040				31.415.026,41
20/08/2007	15/05/2045	13.995.305,82	IPCA + 6,85%	
13/11/2007	15/05/2045	9.144.840,19	IPCA + 6,42%	
11/01/2008	15/05/2045	11.670.701,90	IPCA + 6,51%	
29/05/2008	15/05/2045	14.201.267,13	IPCA + 6,73%	
10/09/2008	15/05/2045	13.702.728,43	IPCA + 7,03%	
14/10/2008	15/05/2045	17.605.430,63	IPCA + 7,78%	
24/10/2008	15/05/2045	4.661.489,64	IPCA + 8,48%	
24/10/2008	15/05/2045	4.895.885,62	IPCA + 8,50%	
21/11/2008	15/05/2045	5.628.420,61	IPCA + 8,03%	
17/05/2010	15/05/2045	5.154.218,95	IPCA + 6,20%	
29/06/2017	15/05/2045	10.128.166,33	IPCA + 5,73%	
Total 2045				110.788.455,25
22/05/2017	15/08/2050	5.023.168,96	IPCA + 5,65%	
Total 2050				5.023.168,96
Total Aplicado				353.968.751,98
Letra Financeira Subordinada - Banese				31/10/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
24/07/2015	24/07/2023	63.476.228,65	INPC + 8,45%	
Total Aplicado				63.476.228,65
Letra Financeira Subordinada - BRB				31/10/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
29/04/2013	29/04/2020	17.730.203,17	IPCA + 6,70%	
Total Aplicado				17.730.203,17
Letra Financeira Subordinada - Itaú				31/10/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
27/07/2015	14/11/2022	1.476.549,36	IPCA + 6,70%	
Total Aplicado				1.476.549,36
Letra Financeira - Banco Original				31/10/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
02/08/2016	02/08/2018	5.701.795,40	IPCA + 8,10%	
Total Aplicado				5.701.795,40
Letra Financeira Subordinada - Banco Votorantim				31/10/2017
Aplicação	Vencimento	Valor Líquido	Taxa	
18/04/2017	17/04/2023	3.130.311,20	IPCA + 6,20%	
Total Aplicado				3.130.311,20
Ações - Banese				31/10/2017
Código/Papel	Quantidade	Cotação (valor unitário)	Valor Líquido	
BGIP3 - Banese ON	337.290,00	38,00	12.817.020,00	
BGIP4 - Banese PN	74.448,00	33,48	2.492.519,04	
Total Aplicado				15.309.539,04
Carteira Própria				31/10/2017
Imóveis				29.502.079,99
Empréstimos				8.796.742,61
Total Carteira Própria Sergus				499.092.201,40

Vencimentos

Carteira Terceirizada			31/10/2017
Vencimento	Valor (R\$)	Fundos	
D+0	64.970.521,81	Bozano Acaju	
D+1	118.288.359,60	Fator Pirambu e Novero Poxim	
D+5	3.014.436,57	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	
D+5	10.118.981,24	SulAmérica Endurance FIM	
D+8	2.944.441,50	Oceana Selection FIA	
D+13	15.784.587,35	Studio FIC FIA	
D+20	10.346.014,44	Oceana Long Short	
D+33	2.968.587,05	Kondor Equities Institucional FIA	
Total Aplicado	R\$ 228.435.929,56		
2018	360.289,87	BTG Emissões Primárias II	
Total Aplicado	360.289,87		
Total Carteira Terceirizada Sergus	R\$ 228.796.219,43		

Rentabilidade Total dos Investimentos

Aplicações	Mensal
Total dos Investimentos	0,68%
Renda Fixa	0,74%
Investimentos Estruturados	0,93%
Renda Variável	(0,44%)
Imóveis	0,51%
Empréstimos	0,76%

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	734.470	07,14

¹ Referente a Outubro

Evolução

