

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS **2015** PLANO SERGUS BD



Sergus

Instituto Banense de Seguridade Social



Plano Sergus de Benefícios BD

Os investimentos do Plano Sergus de Benefícios BD no ano de 2015, totalizaram um montante de R\$ 616 milhões, que equivale a um aumento de R\$ 60 milhões quando comparado com dezembro de 2014, cujo o volume total deste ano era de R\$ 556 milhões. A maior concentração dos recursos continua no segmento de Renda Fixa com R\$ 546 milhões, equivalente a 88,60% do recurso garantidor.

Na sequência apresentamos tabela com a composição dos investimentos por segmento, sua concentração em relação ao recurso garantidor, e ainda descrição da administração terceirizada e própria com posição em dezembro/2014 e dezembro/2015.

Composição por Segmento					R\$
Segmentos	Dez/2014	(%) Recursos Garantidores	Dez/2015	(%) Recursos Garantidores	
Renda Fixa	422.151.856,77	75,91	545.966.530,57	88,60	
Renda Variável	54.430.052,41	9,79	13.765.961,15	2,22	
Investimentos Estruturados	40.604.877,67	7,30	13.940.184,05	2,26	
Imóveis	32.681.639,90	5,88	36.014.000,00	5,84	
Empréstimos a Participantes	6.429.886,07	1,16	6.623.913,92	1,08	
Total de Investimentos	556.298.312,82	100,03	616.310.589,69	100,02	
Disponível	690,28	0,00	6.583,27	0,00	
Exigível Operacional	-156.052,44	-0,03	-145.843,30	-0,02	
Total dos Recursos Garantidores	556.142.950,66	100,00	616.171.329,66	100,00	

Gestão de Investimentos				R\$
Terceirizada	Dez/15	(%) Gestão Terceirizada	(%) Total de Investimentos	
Fundos Exclusivos	183.267.859,94	84,11	29,74	
Fundos Renda Fixa	4.820.076,15	2,21	0,78	
Fundos Multimercados - Não Estruturados	7.647.609,58	3,51	1,24	
Fundos Multimercados - Estruturados	13.940.184,05	6,4	2,26	
Fundos Ações	8.210.828,03	3,77	1,33	
Total	217.886.557,75	100,00	35,35	
Própria	Dez/15	(%) Gestão Própria	(%) Total de Investimentos	
Títulos do Governo Federal - NTN-B	284.206.065,04	71,33	46,11	
Títulos Privados - LFS	66.024.919,86	16,57	10,71	
Ações	5.555.133,12	1,39	0,9	
Imóveis	36.014.000,00	9,04	5,84	
Empréstimos a Participantes	6.623.913,92	1,66	1,07	
Total	398.424.031,94	100,00	64,65	
Total Geral	616.310.589,69	-	100,00	

Gestão Terceirizada por Gestor				R\$
Descrição	Dez/15	(%) Gestão Terceirizada	(%) Total de Investimentos	
Mercatto Gestão de Recursos Ltda.	74.362.777,73	34,13	12,08	
FAR - Fator Administração de Recursos Ltda.	48.047.226,36	22,05	7,8	
GAP Prudential LT Gestão de Recursos Ltda.	60.857.855,85	27,93	9,87	
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	1.423.204,37	0,65	0,23	
Gradual Corretora de Câmbio, Títulos e Valores Mobiliários S.A.	3.396.871,78	1,56	0,55	
Oceana Investimentos Adm. de Carteira de Valores Mobiliários Ltda.	7.815.976,05	3,59	1,27	
Studio Investimentos Administradora de Recursos Ltda.	8.210.828,03	3,77	1,33	
Plural Gestão de Recursos Ltda.	13.771.817,58	6,32	2,23	
Total	217.886.557,76	100,00	35,35	

Rentabilidade Plano Sergus de Benefícios BD

Segue abaixo tabela com as informações referentes à meta atuarial do plano Sergus BD, os índices de referência por segmento dos ativos estipulados na política de Investimentos e a rentabilidade bruta estimada e líquida dos ativos do Plano.

Rentabilidade Plano Sergus BD						
Segmentos	Meta Atuarial		Índices de Referência (PI PSB 2015)		(*) Rentabilidade Bruta Estimada	(**) Rentabilidade
Renda Fixa	INPC + 5,32% a.a.	17,20%	INPC + 5,32%	17,20%	15,68%	15,42%
Renda Variável			Ibovespa	-13,31%	-4,79%	-11,36%
Investimentos Estruturados			INPC + 7%	19,07%	20,49%	12,77%
Imóveis			INPC	11,28%	15,49%	15,49%
Empréstimos a Participantes			INPC + 5,32%	17,20%	23,37%	23,37%
Total Plano Sergus BD			-	-	13,95%	13,40%

* Rentabilidade bruta estimada sem abater os custos diretos e indiretos inerentes aos fundos de investimentos.

** Rentabilidade líquida contemplando os custos diretos e indiretos inerentes aos fundos de investimentos.

Despesas da Gestão de Investimentos

A seguir serão apresentadas as tabelas com as despesas de investimentos do plano Sergus BD divididas entre a gestão terceirizada (fundos de investimentos) e a gestão própria (títulos mantidos na carteira própria, administrados pelo Sergus).

Despesas da Gestão de Investimentos - 2015				R\$
Gestão Terceirizada	Valor	Gestão Própria	Valor	
Taxa de Administração	2.584.529	Taxa de Administração	-	
Taxa de Custódia	273.339	Taxa de Custódia	161.023	
Taxa de Performance	152.395	Taxa de Performance	-	
Auditoria	19.540	Auditoria	-	
CETIP, SELIC e CBLC	97.915	CETIP, SELIC e CBLC	38.365	
Corretagens	167.451	Corretagens	-	
Outras despesas	84.655	Outras despesas	-	
Total	3.379.823	Total	199.388	
Total Geral			3.579.211	

Diretoria Executiva

Hércules Silva Daltro
Diretor Superintendente

Marcelo Carvalho A. de Aguiar
Diretor Adm.e Financeiro

Augusto Cezar Barboza Santos
Diretor de Seguridade

Conselho Deliberativo

Titulares

Rosângela Tavares Ferreira (Presidente)

Daniel Felipe Viana Munduruca

Ednilson Nunes Góis

Ivânia Pereira da Silva

Suplentes

Maria do Carmo Silva Hora

Lana Cristina Lima Aragão

Maria do Carmo da Silva Viana

Edson Cavalcante Silva

Conselho Fiscal

Titulares

Maria Elenilde da Paixao Navarro (Presidente em exercício)

Maria Luiza Dos Santos

José Anderson Santos de Jesus

Arnaldo da Silva Oliveira (Em exercício)

Suplentes

Luíz Carlos Menezes de Santana

Carlos Eduardo Menezes Santos

Adele Silva Germano de Jesus

Contador

José Carlos Pereira da Silva
Contador CRC - SE - 3.995/0-3