

**SOCIEDADE IBGEANA DE ASSISTÊNCIA E SEGURIDADE**

# **Demonstrativo de Investimentos**

**1º Trimestre**

Este relatório é para livre circulação das informações pertinentes aos investimentos da entidade.  
Sendo direcionado, principalmente, aos participantes e assistidos dos planos administrados pela SIAS.  
Diretoria Administrativa e Financeira

**2019**



## ÍNDICE

---

<b>DESCRIÇÃO</b>	<b>PÁGINAS</b>
<i>CARTEIRA DE INVESTIMENTOS E GESTÃO INTERNA X EXTERNA</i>	1
<i>RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS</i>	2
<i>HISTÓRICO DE RENTABILIDADE</i>	4

## Carteira de Investimentos

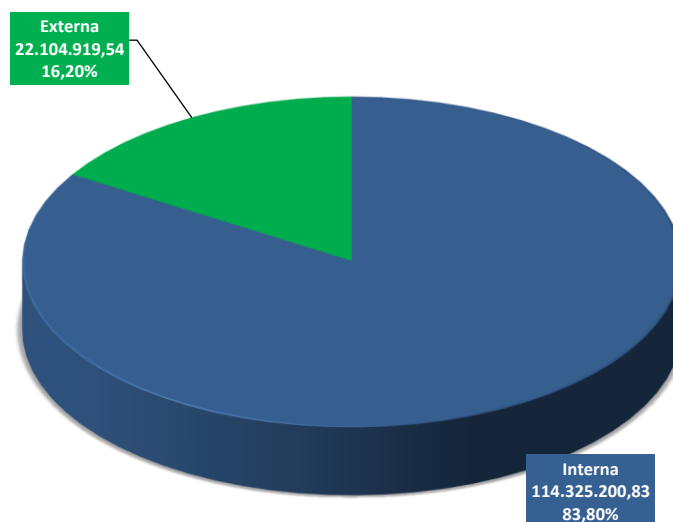
Valores em R\$

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
<b>Renda Fixa</b>	<b>114.394.538,03</b>	<b>100,0</b>	<b>83,8</b>
Títulos Públicos Federais	90.252.438,98	78,9	66,1
Letras Financeiras (LF's)	22.260.003,01	19,5	16,3
Quotas de Fundos de Investimentos	1.882.096,04	1,6	1,4
<b>Renda Variável</b>	<b>11.541.564,64</b>	<b>100,0</b>	<b>8,5</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	11.541.564,64	100,0	8,5
Investimentos Estruturados	8.681.258,86	100,0	6,4
Quotas de Fundos de Investimentos	8.681.258,86	100,0	6,4
Investimentos Imobiliários	55.660,63	100,0	0,0
Valores a Receber	55.660,63	100,0	0,0
Empréstimos e Financiamentos	198.726,50	100,0	0,1
Outros (IR a restituir)	1.558.371,71	100,0	1,1
<b>Total dos Investimentos</b>	<b>136.430.120,37</b>		<b>100,0</b>
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	37.686,36		0,0
<b>Total dos Recursos Garantidores</b>	<b>136.467.806,73</b>		<b>100,0</b>

## Gestão interna x externa

Descrição	Interna		Externa		Total	
	Valor	%	Valor	%	Valor	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	90.252.438,98	78,94%		0,00%	90.252.438,98	66,15%
Carteira de Títulos Privados	22.260.003,01	19,47%		0,00%	22.260.003,01	16,32%
Quotas Fundos de Investimentos de RF		0,00%	1.882.096,04	8,51%	1.882.096,04	1,38%
Quotas Fundos de Investimentos de RV		0,00%	11.541.564,64	52,21%	11.541.564,64	8,46%
Investimentos Estruturados		0,00%	8.681.258,86	39,27%	8.681.258,86	6,36%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,05%		0,00%	55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	198.726,50	0,17%		0,00%	198.726,50	0,15%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,36%		0,00%	1.558.371,71	1,14%
<b>Total</b>	<b>114.325.200,83</b>	<b>100,00%</b>	<b>22.104.919,54</b>	<b>100,00%</b>	<b>136.430.120,37</b>	<b>100,00%</b>

## Gestão Interna x Externa



## Rentabilidade dos Investimentos em 2019

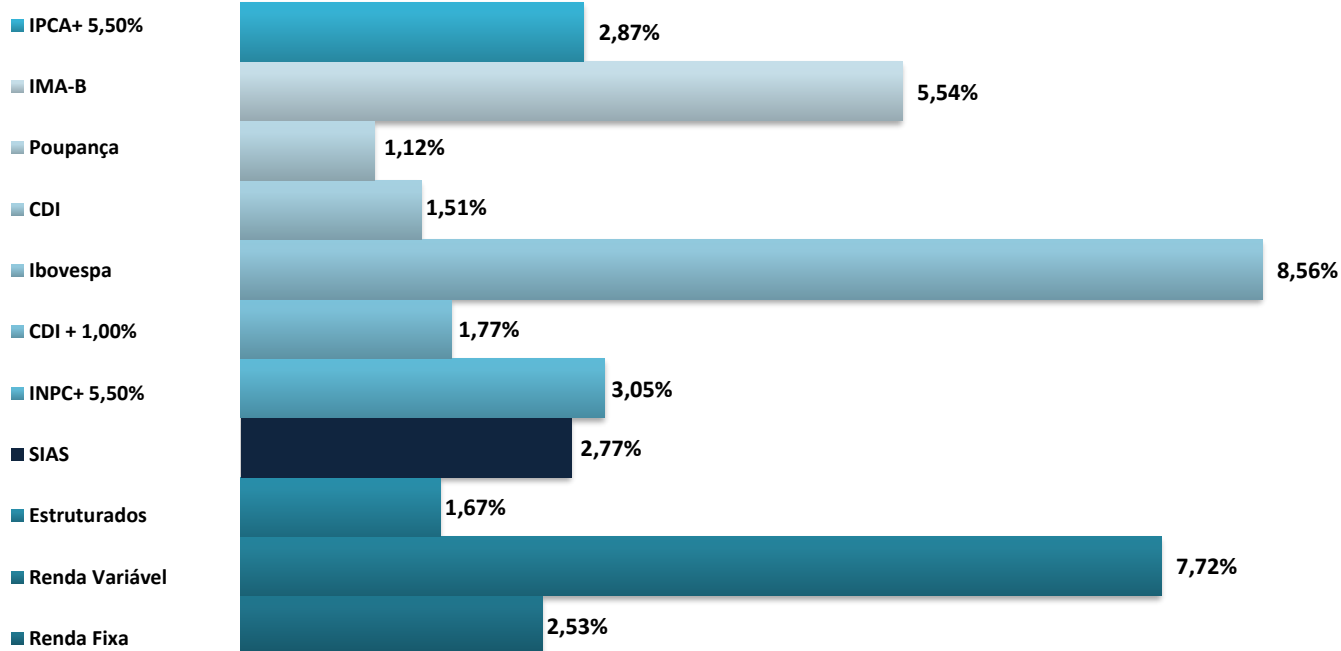
### Rentabilidade

Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
Renda Fixa	0,80%	0,75%	0,96%										2,53%
Renda Variável	10,26%	-1,92%	-0,40%										7,72%
Estruturados	2,41%	-0,79%	0,07%										1,67%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%										0,00%
Empréstimos	-1,76%	2,26%	2,56%										3,04%
<b>SIAS</b>	<b>1,54%</b>	<b>0,42%</b>	<b>0,79%</b>										<b>2,77%</b>
<b>INPC+ 5,50%</b>	<b>0,81%</b>	<b>0,99%</b>	<b>1,22%</b>										<b>3,05%</b>
<b>CDI + 1,00%</b>	<b>0,63%</b>	<b>0,58%</b>	<b>0,55%</b>										<b>1,77%</b>
Empréstimos/Imóveis	0,81%	0,99%	1,22%										3,05%
INPC	0,36%	0,54%	0,77%										1,68%
IPCA	0,32%	0,43%	0,75%										1,51%
Ibovespa	10,82%	-1,86%	-0,18%										8,56%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%										1,51%
IFM	2,14%	-0,02%	0,08%										2,20%
Poupança	0,37%	0,37%	0,37%										1,12%
IPCA+ 5,50%	0,77%	0,88%	1,20%										2,87%
IMA-B	4,37%	0,55%	0,58%										5,54%
Bench. RF Planos	0,81%	0,99%	1,22%										3,05%

### Observações:

1. Benchmark = referência de rentabilidade. Definidos na Política de Investimentos 2019-2023.
2. Meta Atuarial => Planos: INPC + 5,50% a.a.; Meta PGA => CDI + 1,00%
3. O Benchmark da Renda Variável => Ibovespa
4. O Benchmark da Renda Fixa => INPC + 5,50% a.a
5. O Benchmark de Estruturados => CDI + 2% a.a
6. O Benchmark de Empréstimos e Imóveis => INPC + 5,50% a.a

## Rentabilidades e Indicadores (Acumulado no ano)

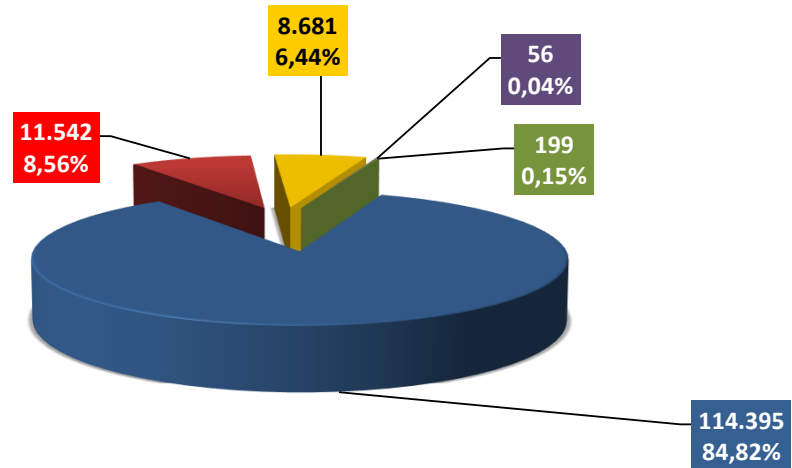


## Rentabilidade dos Investimentos em 2019

### Alocação (Mil R\$)

Descrição	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Média
Renda Fixa	115.422	114.198	114.395										114.672
Renda Variável	8.770	11.588	11.542										10.633
Estruturados	10.836	8.675	8.681										9.397
Imóveis	56	56	56										56
Empréstimos	193	196	199										196
<b>Total</b>	<b>135.276</b>	<b>134.713</b>	<b>134.872</b>										<b>134.954</b>

### Alocação da Carteira (em R\$ mil)



■ Renda Fixa

■ Renda Variável

■ Estruturados

■ Imóveis

■ Empréstimos

## Histórico de Rentabilidade - Últimos 10 anos

	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	Acum
<b>Segmentos</b>											
Renda Fixa	13,52%	14,53%	22,61%	3,56%	13,05%	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	2,53%	203,06%
Renda Variável	3,55%	-8,89%	16,25%	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	7,72%	63,36%
Estruturados	0,00%	0,00%	0,00%	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	1,67%	99,87%
Imóveis	-17,72%	0,00%	0,00%	0,00%	-42,34%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-52,55%
Empréstimos	24,87%	18,23%	3,03%	35,94%	37,01%	38,36%	9,55%	27,66%	-1,56%	3,04%	456,10%
SIAS	13,75%	12,05%	21,90%	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	2,77%	193,47%
<b>Indicadores</b>											
CDI	9,73%	11,60%	8,40%	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	1,51%	143,78%
Poupança	6,90%	7,45%	6,48%	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	1,12%	82,96%
IBOVESPA	1,04%	-18,11%	7,40%	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	8,56%	39,12%
INPC(IBGE)	6,47%	6,08%	6,20%	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	1,68%	71,24%
INPC + 5,50%	12,33%	11,91%	12,04%	11,37%	12,07%	17,40%	12,44%	7,68%	9,12%	3,05%	180,98%

<b>Rentabilidade acumulada</b>											
	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	
SIAS	13,75%	27,46%	55,36%	60,07%	78,49%	107,76%	134,97%	159,28%	185,57%	193,47%	
INPC + 5,50%	12,33%	25,71%	40,85%	56,86%	75,79%	106,37%	132,05%	149,87%	172,67%	180,98%	
Poupança	6,90%	14,86%	22,30%	29,41%	38,58%	49,78%	62,21%	72,94%	80,94%	82,96%	
CDI	9,73%	22,46%	32,75%	43,45%	58,97%	80,03%	105,23%	125,65%	140,15%	143,78%	

