

SOCIEDADE IBGEANA DE ASSISTÊNCIA E SEGURIDADE

Demonstrativo de Investimentos

2º 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

DESCRIÇÃO	PÁGINAS
<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

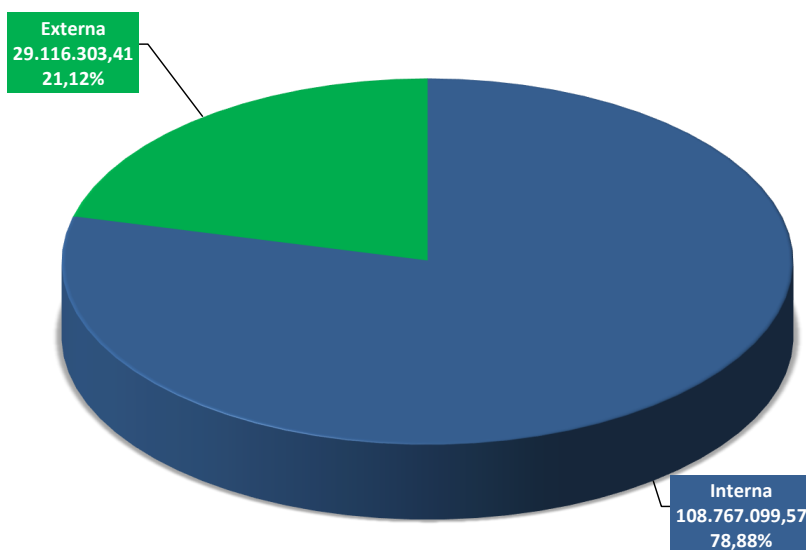
Valores em R\$

Descrição	Taxa	Aquisição - Vencimento	Quantidade	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
Renda Fixa				109.237.503,76	100,0	79,2
Títulos Públicos Federais				84.119.993,30	77,0	61,0
Letras Financeiras (LF's)				22.857.077,04	20,9	16,6
Quotas de Fundos de Investimentos				2.260.433,42	2,1	1,6
Renda Variável				12.453.794,97	100,0	9,0
Quotas de Fundos de Investimentos				12.453.794,97	100,0	9,0
Investimentos Estruturados				14.402.075,02	100,0	10,4
Quotas de Fundos de Investimentos				14.402.075,02	100,0	10,4
Investimentos Imobiliários				55.660,63	100,0	0,0
Valores a Receber				55.660,63	100,0	0,0
Empréstimos e Financiamentos				175.996,89	100,0	0,1
Outros				1.558.371,71	100,0	1,1
Total dos Investimentos				137.883.402,98		100,0
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos				62.654,27		0,0
Total dos Recursos Garantidores				137.946.057,25		100,0

Gestão interna x externa

Descrição	Interna		Externa		Total		Valores em R\$
	Interna	%	Externa	%	Total	%	
Carteira de Títulos Públicos Federais	84.119.993,30	77,34%		0,00%	84.119.993,30	61,01%	
Carteira de Títulos Privados	22.857.077,04	21,01%		0,00%	22.857.077,04	16,58%	
Quotas Fundos de Investimentos de RF		0,00%	2.260.433,42	7,76%	2.260.433,42	1,64%	
Quotas Fundos de Investimentos de RV		0,00%	12.453.794,97	42,77%	12.453.794,97	9,03%	
Investimentos Estruturados		0,00%	14.402.075,02	49,46%	14.402.075,02	10,45%	
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,05%		0,00%	55.660,63	0,04%	
Empréstimos e Financiamentos	175.996,89	0,16%		0,00%	175.996,89	0,13%	
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,43%		0,00%	1.558.371,71	1,13%	
Total	108.767.099,57	100,00%	29.116.303,41	100,00%	137.883.402,98	100,00%	

Gestão Interna x Externa



Rentabilidade dos Investimentos em 2019

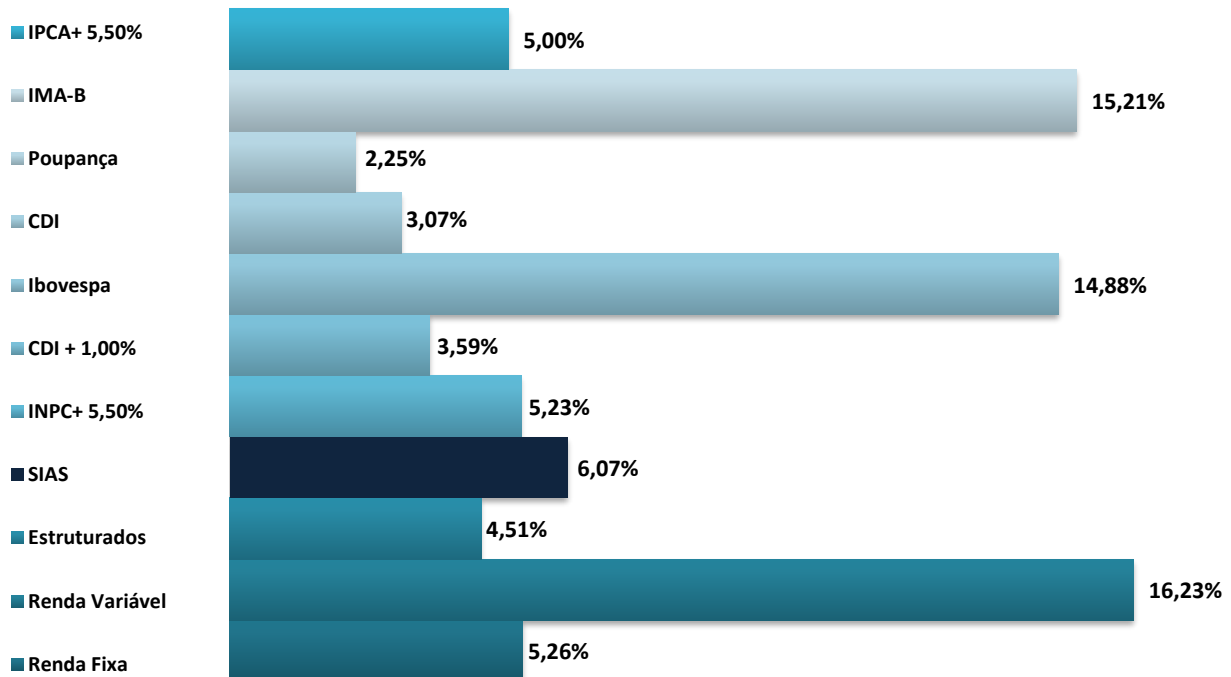
Rentabilidade

Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
Renda Fixa	0,80%	0,75%	0,96%	1,26%	0,93%	0,46%							5,26%
Renda Variável	10,26%	-1,92%	-0,40%	0,82%	1,90%	5,03%							16,23%
Estruturados	2,41%	-0,79%	0,07%	-0,07%	0,94%	1,91%							4,51%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%							0,00%
Empréstimos	-1,76%	2,26%	2,56%	-1,45%	-2,01%	-1,87%							-2,36%
SIAS	1,54%	0,42%	0,79%	1,14%	1,01%	1,02%							6,07%
INPC+ 5,50%	0,81%	0,99%	1,22%	1,05%	0,60%	0,46%							5,23%
CDI + 1,00%	0,63%	0,58%	0,55%	0,60%	0,63%	0,55%							3,59%
Empréstimos/Imóveis	0,81%	0,99%	1,22%	1,05%	0,60%	0,46%							5,23%
INPC	0,36%	0,54%	0,77%	0,60%	0,15%	0,01%							2,45%
IPCA	0,32%	0,43%	0,75%	0,57%	0,13%	0,01%							2,23%
Ibovespa	10,82%	-1,86%	-0,18%	0,98%	0,70%	4,06%							14,88%
CDI	0,54%	0,49%	0,47%	0,52%	0,54%	0,47%							3,07%
IFM	2,14%	-0,02%	0,08%	0,48%	0,98%	1,05%							4,78%
Poupança	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%	0,37%							2,25%
IPCA+ 5,50%	0,77%	0,88%	1,20%	1,02%	0,58%	0,46%							5,00%
IMA-B	4,37%	0,55%	0,58%	1,51%	3,66%	3,73%							15,21%
Bench. RF Planos	0,81%	0,99%	1,22%	1,05%	0,60%	0,46%							5,23%

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)

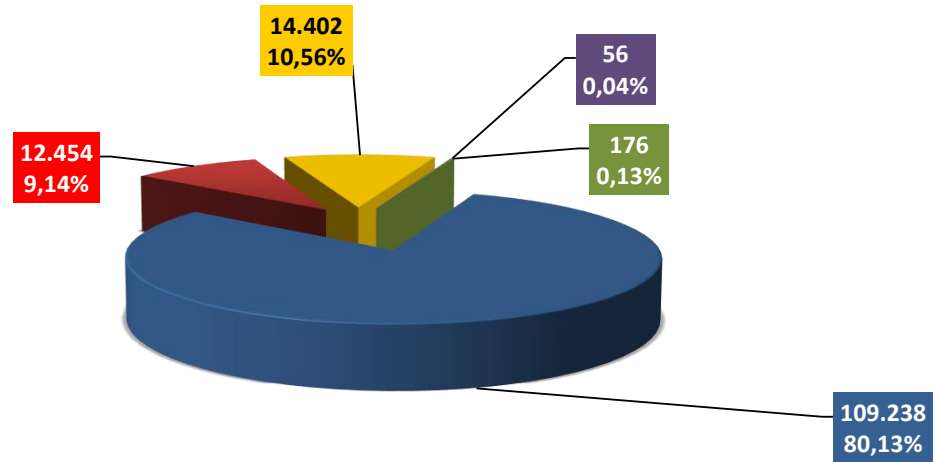


Rentabilidade dos Investimentos em 2019

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	116.008	110.164	109.238							113.237
Renda Variável	8.770	11.588	11.542	11.636	11.858	12.454							11.308
Estruturados	10.836	8.675	8.681	8.025	14.133	14.402							10.792
Imóveis	56	56	56	56	56	56							56
Empréstimos	193	196	199	188	181	176							189
Total	135.276	134.713	134.872	135.913	136.391	136.325							135.582

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
Segmentos											
Renda Fixa	13,52%	14,53%	22,61%	3,56%	13,05%	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	5,26%	211,14%
Renda Variável	3,55%	-8,89%	16,25%	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	16,23%	76,27%
Estruturados	0,00%	0,00%	0,00%	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	4,51%	105,44%
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%	-2,36%	426,97%
SIAS	13,75%	12,05%	21,90%	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	6,07%	202,89%
Indicadores											
CDI	9,73%	11,60%	8,40%	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	3,07%	147,53%
Poupança	6,90%	7,45%	6,48%	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	2,25%	85,01%
IBOVESPA	1,04%	-18,11%	7,40%	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	14,88%	47,22%
INPC(IBGE)	6,47%	6,08%	6,20%	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	2,45%	72,54%
INPC + 5,50%	12,33%	11,91%	12,04%	11,37%	12,07%	17,40%	12,44%	7,68%	9,12%	5,23%	186,93%

Rentabilidade acumulada

	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%	202,89%
INPC + 5,50%	12,33%	25,71%	40,85%	56,86%	75,79%	106,37%	132,05%	149,87%	172,67%	186,93%
Poupança	6,90%	14,86%	22,30%	29,41%	38,58%	49,78%	62,21%	72,94%	80,94%	85,01%
CDI	9,73%	22,46%	32,75%	43,45%	58,97%	80,03%	105,23%	125,65%	140,15%	147,53%

Evolução - Rentabilidade x INPC + 5,50% x CDI x Poupança

