



# Demonstrativo de Investimentos

**Fevereiro/2021**

Em conformidade com a legislação vigente, este Relatório contém informações mensais sobre os Investimentos dos Recursos Garantidores das Reservas Técnicas dos Planos administrados pela SIAS. Sendo direcionado, principalmente, aos participantes e assistidos, e pode ser acessado no site da SIAS ([www.sias.org.br](http://www.sias.org.br)).

## ÍNDICE

---

<b>DESCRIÇÃO</b>	<b>PÁGINAS</b>
<i>CARTEIRA DE INVESTIMENTOS</i>	<i>1</i>
<i>GESTÃO INTERNA x EXTERNA</i>	<i>2</i>
<i>RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS</i>	<i>3</i>
<i>HISTÓRICO DE RENTABILIDADE</i>	<i>5</i>

## Carteira de Investimentos

Valores em R\$

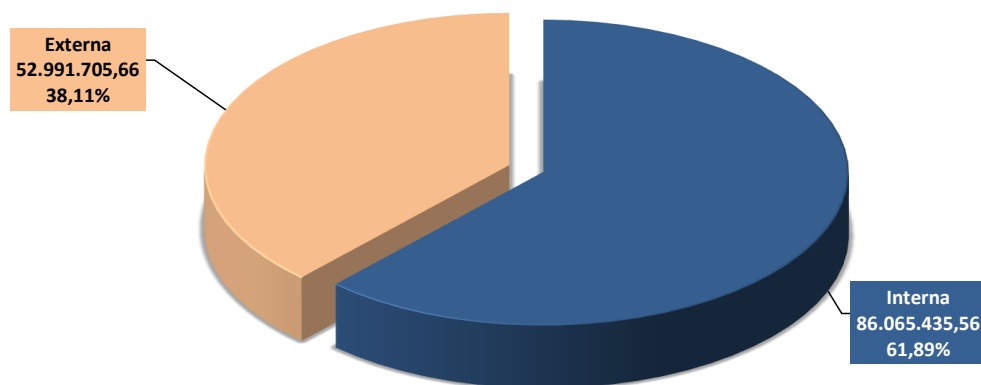
Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
<b>Renda Fixa</b>	<b>103.228.687,56</b>	<b>100,0</b>	<b>74,2</b>
Títulos Públicos Federais	84.312.771,13	81,7	60,6
Quotas de Fundos de Investimentos	18.915.916,43	18,3	13,6
<b>Renda Variável</b>	<b>16.882.983,70</b>	<b>100,0</b>	<b>12,1</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	16.882.983,70	100,0	12,1
Investimentos Estruturados	17.192.805,53	100,0	12,4
Quotas de Fundos de Investimentos	17.192.805,53	100,0	12,4
Investimentos Imobiliários	55.660,63	100,0	0,0
Direitos de alienações	55.660,63	100,0	0,0
Empréstimos e Financiamentos	138.632,09	100,0	0,1
Outros	1.558.371,71	100,0	1,1
<b>Total dos Investimentos</b>	<b>139.057.141,22</b>		<b>99,9</b>
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	129.078,50		0,1
<b>Total dos Recursos Garantidores</b>	<b>139.186.219,72</b>		<b>100,0</b>

## Gestão interna x externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	84.312.771,13	97,96%			84.312.771,13	60,63%
Quotas Fundos de Investimentos de RF			18.915.916,43	35,70%	18.915.916,43	13,60%
Quotas Fundos de Investimentos de RV			16.882.983,70	31,86%	16.882.983,70	12,14%
Investimentos Estruturados			17.192.805,53	32,44%	17.192.805,53	12,36%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,06%			55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	138.632,09	0,16%			138.632,09	0,10%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,81%			1.558.371,71	1,12%
<b>Total</b>	<b>86.065.435,56</b>	<b>100,00%</b>	<b>52.991.705,66</b>	<b>100,00%</b>	<b>139.057.141,22</b>	<b>100,00%</b>

### Gestão Interna x Externa



## Rentabilidade dos Investimentos em 2021

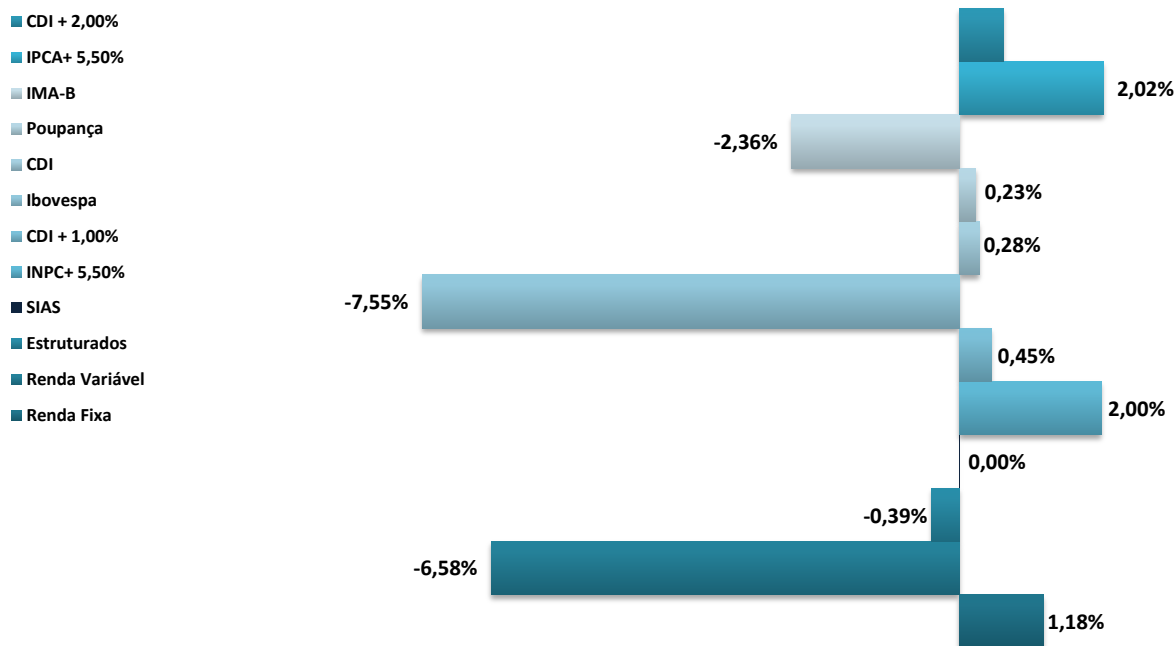
### Rentabilidade

Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
Renda Fixa	0,86%	0,32%											1,18%
Renda Variável	-3,09%	-3,59%											-6,58%
Estruturados	-0,89%	0,50%											-0,39%
Imóveis	0,00%	0,00%											0,00%
Empréstimos	3,43%	-2,46%											0,89%
<b>SIAS</b>	<b>0,15%</b>	<b>-0,14%</b>											<b>0,00%</b>
CLT	0,15%	-0,14%											0,01%
RJU	0,15%	-0,15%											0,00%
PREVSIAS	0,12%	-0,15%											-0,03%
PGA	0,15%	-0,14%											0,00%
<b>INPC+ 5,50%</b>	<b>0,72%</b>	<b>1,27%</b>											<b>2,00%</b>
<b>CDI + 1,00%</b>	<b>0,23%</b>	<b>0,22%</b>											<b>0,45%</b>
CDI + 2,00%	0,31%	0,30%											0,62%
INPC	0,27%	0,82%											1,09%
IPCA	0,25%	0,86%											1,11%
Ibovespa	-3,32%	-4,37%											-7,55%
CDI	0,15%	0,13%											0,28%
Poupança	0,12%	0,12%											0,23%
IPCA+ 5,50%	0,70%	1,31%											2,02%
IMA-B	-0,85%	-1,52%											-2,36%
Bench. RF Planos	0,72%	1,27%											2,00%

### Observações:

1. A rentabilidade do Plano PREVSIAS reflete a variação da cota do Plano, a qual leva em consideração a dedução da taxa de administração.
2. Benchmark = referência de rentabilidade. Definidos na Política de Investimentos 2021-2025.
3. Meta Atuarial => Planos: INPC + 5,50% a.a.; Meta PGA => CDI + 1,00%
4. O Benchmark da Renda Variável => Ibovespa
5. O Benchmark da Renda Fixa => INPC + 5,50% a.a
6. O Benchmark de Estruturados => CDI + 2% a.a
7. O Benchmark de Empréstimos e Imóveis => INPC + 5,50% a.a
8. O Benchmark de Imóveis => IFIX

## Rentabilidades e Indicadores (Acumulado no ano)

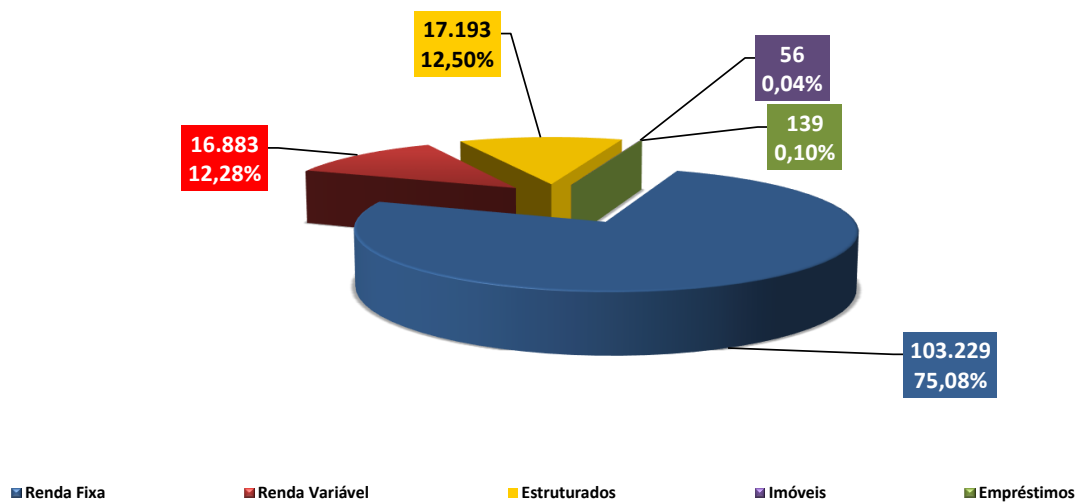


## Rentabilidade dos Investimentos em 2021

### Alocação (Mil R\$)

Descrição	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Média
Renda Fixa	104.192	103.229											103.710
Renda Variável	17.512	16.883											17.198
Estruturados	17.107	17.193											17.150
Imóveis	56	56											56
Empréstimos	139	139											139
<b>Total</b>	<b>139.005</b>	<b>137.499</b>											<b>138.252</b>

### Carteira de Investimentos em Fevereiro de 2021



## Histórico de Rentabilidade - Últimos 10 anos

	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	Acum
<b>Segmentos</b>											
Renda Fixa	22,61%	3,56%	13,05%	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	9,91%	10,41%	1,18%	179,13%
Renda Variável	16,25%	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-6,58%	121,20%
Estruturados	0,00%	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	-0,39%	118,67%
Imóveis	0,00%	0,00%	-42,34%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-42,34%
Empréstimos	3,03%	35,94%	37,01%	38,36%	9,55%	27,66%	-1,56%	-13,55%	32,33%	0,89%	321,93%
SIAS	21,90%	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	0,00%	182,16%
<b>Indicadores</b>											
CDI	8,40%	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	0,28%	114,16%
Poupança	6,48%	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	0,23%	68,09%
IBOVESPA	7,40%	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-7,55%	93,91%
INPC(IBGE)	6,20%	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	1,09%	66,07%
INPC + 5,50%	12,04%	11,37%	12,07%	17,40%	12,44%	7,68%	9,12%	10,23%	11,25%	2,00%	171,29%

<b>Rentabilidade acumulada</b>											
	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	
SIAS	21,90%	25,59%	40,04%	63,00%	84,36%	103,42%	124,05%	154,48%	182,15%	182,16%	
INPC + 5,50%	12,04%	24,78%	39,84%	64,17%	84,59%	98,77%	116,90%	139,09%	165,98%	171,29%	
Poupança	6,48%	12,67%	20,65%	30,39%	41,22%	50,56%	57,52%	64,23%	67,70%	68,09%	
CDI	8,40%	17,14%	29,81%	47,01%	67,59%	84,26%	96,10%	107,80%	113,55%	114,16%	

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

