



Demonstrativo de Investimentos

Junho/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).

ÍNDICE

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

Carteira de Investimentos

Valores em R\$

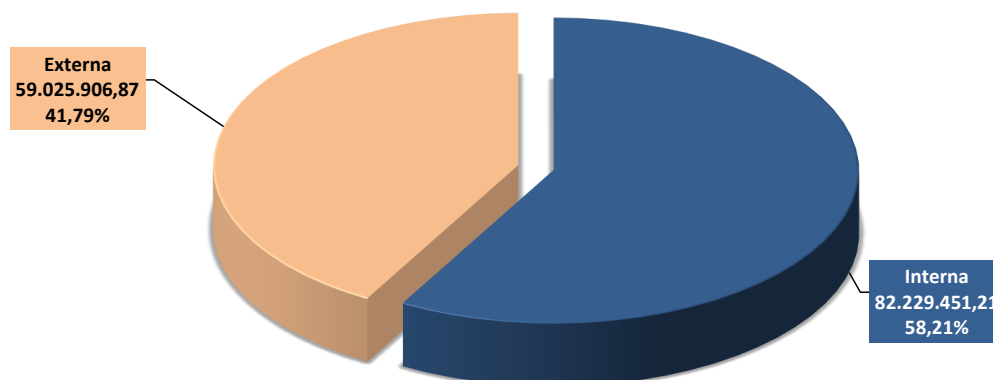
Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
Renda Fixa	102.884.734,57	100,0	72,8
Títulos Públicos Federais	80.493.107,21	78,2	56,9
Quotas de Fundos de Investimentos	22.391.627,36	21,8	15,8
Renda Variável	18.918.668,97	100,0	13,4
Quotas de Fundos de Investimentos	18.918.668,97	100,0	13,4
Investimentos Estruturados	17.715.610,54	100,0	12,5
Quotas de Fundos de Investimentos	17.715.610,54	100,0	12,5
Investimentos Imobiliários	55.660,63	100,0	0,0
Direitos de alienações	55.660,63	100,0	0,0
Empréstimos e Financiamentos	122.311,66	100,0	0,1
Outros	1.558.371,71	100,0	1,1
Total dos Investimentos	141.255.358,08		99,9
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	92.761,17		0,1
Total dos Recursos Garantidores	141.348.119,25		100,0

Gestão interna x externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	80.493.107,21	97,89%			80.493.107,21	56,98%
Quotas Fundos de Investimentos de RF			22.391.627,36	37,94%	22.391.627,36	15,85%
Quotas Fundos de Investimentos de RV			18.918.668,97	32,05%	18.918.668,97	13,39%
Investimentos Estruturados			17.715.610,54	30,01%	17.715.610,54	12,54%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,07%			55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	122.311,66	0,15%			122.311,66	0,09%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,90%			1.558.371,71	1,10%
Total	82.229.451,21	100,00%	59.025.906,87	100,00%	141.255.358,08	100,00%

Gestão Interna x Externa



Rentabilidade dos Investimentos em 2021

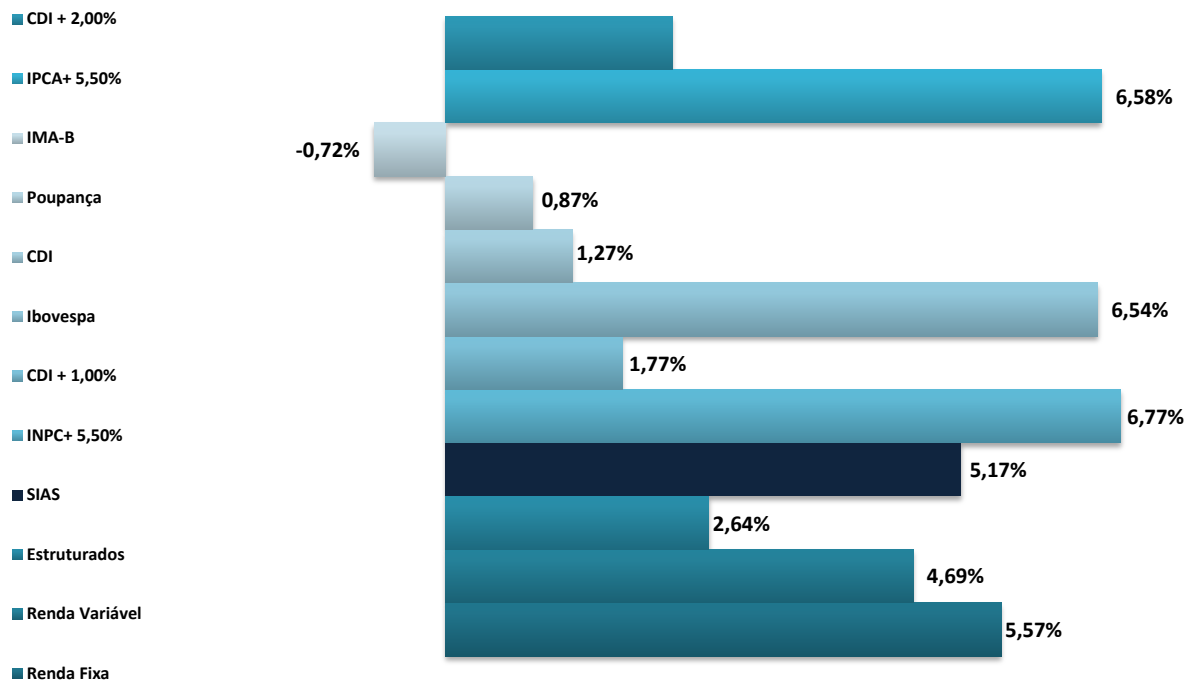
Rentabilidade

Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
Renda Fixa	0,86%	0,32%	1,27%	0,92%	1,00%	1,09%							5,57%
Renda Variável	-3,09%	-3,59%	2,40%	2,75%	5,17%	1,26%							4,69%
Estruturados	-0,89%	0,50%	0,99%	0,67%	0,72%	0,64%							2,64%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%							0,00%
Empréstimos	3,43%	-2,46%	6,48%	-2,58%	-2,75%	-1,16%							0,60%
SIAS	0,15%	-0,14%	1,38%	1,12%	1,52%	1,05%							5,17%
CLT	0,15%	-0,14%	1,37%	1,12%	1,52%	1,05%							5,17%
RJU	0,15%	-0,15%	1,38%	1,11%	1,52%	1,05%							5,16%
PREVSIAS	0,12%	-0,15%	1,36%	1,10%	1,48%	1,04%							5,05%
PGA	0,15%	-0,14%	1,38%	1,12%	1,52%	1,05%							5,17%
INPC+ 5,50%	0,72%	1,27%	1,31%	0,83%	1,41%	1,05%							6,77%
CDI + 1,00%	0,23%	0,22%	0,28%	0,29%	0,35%	0,39%							1,77%
CDI + 2,00%	0,31%	0,30%	0,36%	0,37%	0,43%	0,47%							2,28%
INPC	0,27%	0,82%	0,86%	0,38%	0,96%	0,60%							3,95%
IPCA	0,25%	0,86%	0,93%	0,31%	0,83%	0,53%							3,77%
Ibovespa	-3,32%	-4,37%	6,00%	1,94%	6,16%	0,46%							6,54%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%							1,27%
Poupança	0,12%	0,12%	0,12%	0,12%	0,16%	0,20%							0,87%
IPCA+ 5,50%	0,70%	1,31%	1,38%	0,76%	1,28%	0,98%							6,58%
IMA-B	-0,85%	-1,52%	-0,46%	0,65%	1,06%	0,42%							-0,72%
Bench. RF Planos	0,72%	1,27%	1,31%	0,83%	1,41%	1,05%							6,77%

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)

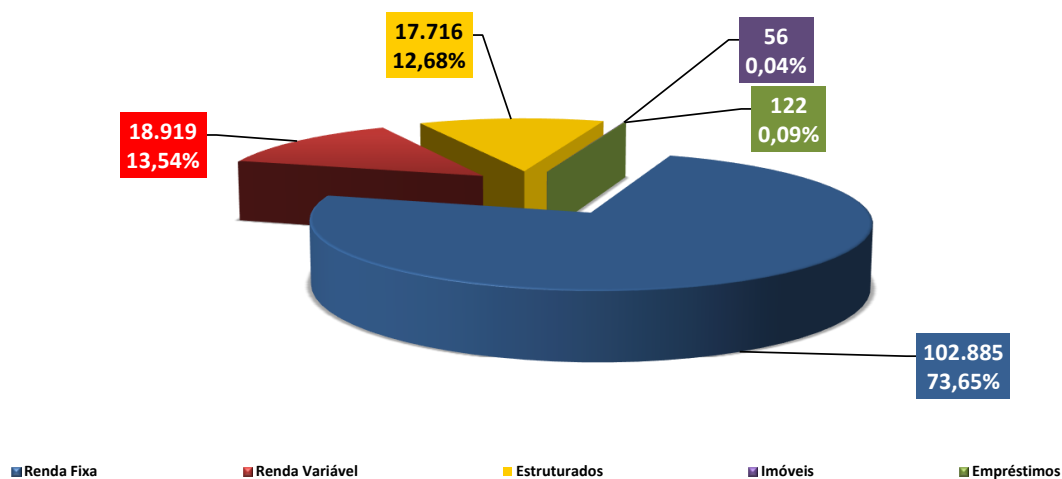


Rentabilidade dos Investimentos em 2021

Alocação (Mil R\$)

Descrição	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Média
Renda Fixa	104.192	103.229	103.931	103.061	103.106	102.885							103.401
Renda Variável	17.512	16.883	17.289	17.764	18.683	18.919							17.842
Estruturados	17.107	17.193	17.362	17.479	17.604	17.716							17.410
Imóveis	56	56	56	56	56	56							56
Empréstimos	139	134	141	134	128	122							133
Total	139.005	137.494	138.779	138.494	139.577	139.697							138.841

Carteira de Investimentos em Junho de 2021



Histórico de Rentabilidade - Últimos 10 anos

	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	Acum
Segmentos											
Renda Fixa	22,61%	3,56%	13,05%	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	9,91%	10,41%	5,57%	191,25%
Renda Variável	16,25%	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	4,69%	147,87%
Estruturados	0,00%	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	2,64%	125,32%
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%	0,60%	320,69%
SIAS	21,90%	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	5,17%	196,73%
Indicadores											
CDI	8,40%	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	1,27%	116,26%
Poupança	6,48%	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	0,87%	69,16%
IBOVESPA	7,40%	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	6,54%	123,45%
INPC(IBGE)	6,20%	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	3,95%	70,77%
INPC + 5,50%	12,04%	11,37%	12,07%	17,40%	12,44%	7,68%	9,12%	10,23%	11,25%	6,77%	183,99%

Rentabilidade acumulada											
	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%	196,73%	196,73%
INPC + 5,50%	12,04%	24,78%	39,84%	64,17%	84,59%	98,77%	116,90%	139,09%	165,98%	183,99%	183,99%
Poupança	6,48%	12,67%	20,65%	30,39%	41,22%	50,56%	57,52%	64,23%	67,70%	69,16%	69,16%
CDI	8,40%	17,14%	29,81%	47,01%	67,59%	84,26%	96,10%	107,80%	113,55%	116,26%	116,26%

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

