



Demonstrativo de Investimentos

Agosto/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\$

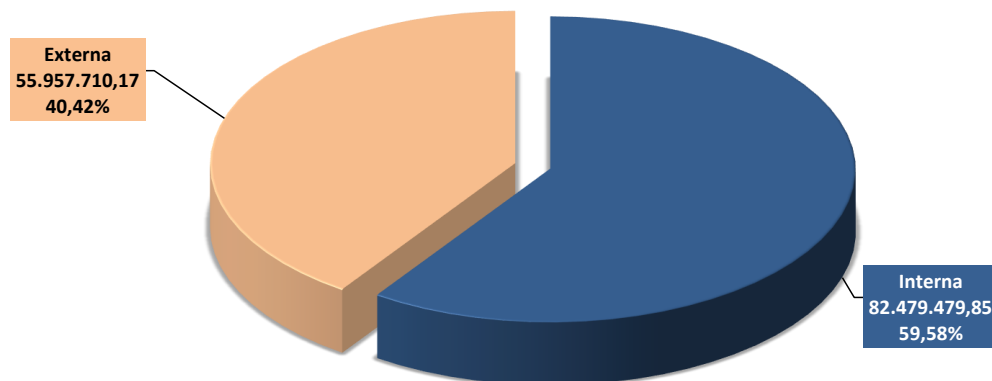
Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
Renda Fixa	103.847.325,38	100,0	75,0
Títulos Públicos Federais	80.755.705,27	77,8	58,3
Quotas de Fundos de Investimentos	23.091.620,11	22,2	16,7
Renda Variável	15.479.807,45	100,0	11,2
Quotas de Fundos de Investimentos	15.479.807,45	100,0	11,2
Investimentos Estruturados	17.386.282,61	100,0	12,6
Quotas de Fundos de Investimentos	17.386.282,61	100,0	12,6
Investimentos Imobiliários	55.660,63	100,0	0,0
Direitos de alienações	55.660,63	100,0	0,0
Empréstimos e Financiamentos	109.742,24	100,0	0,1
Outros	1.558.371,71	100,0	1,1
Total dos Investimentos	138.437.190,02		100,0
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	41.834,65		0,0
Total dos Recursos Garantidores	138.479.024,67		100,0

Gestão interna x externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	80.755.705,27	97,91%			80.755.705,27	58,33%
Quotas Fundos de Investimentos de RF			23.091.620,11	41,27%	23.091.620,11	16,68%
Quotas Fundos de Investimentos de RV			15.479.807,45	27,66%	15.479.807,45	11,18%
Investimentos Estruturados			17.386.282,61	31,07%	17.386.282,61	12,56%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,07%			55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	109.742,24	0,13%			109.742,24	0,08%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,89%			1.558.371,71	1,13%
Total	82.479.479,85	100,00%	55.957.710,17	100,00%	138.437.190,02	100,00%

Gestão Interna x Externa



Rentabilidade dos Investimentos em 2021

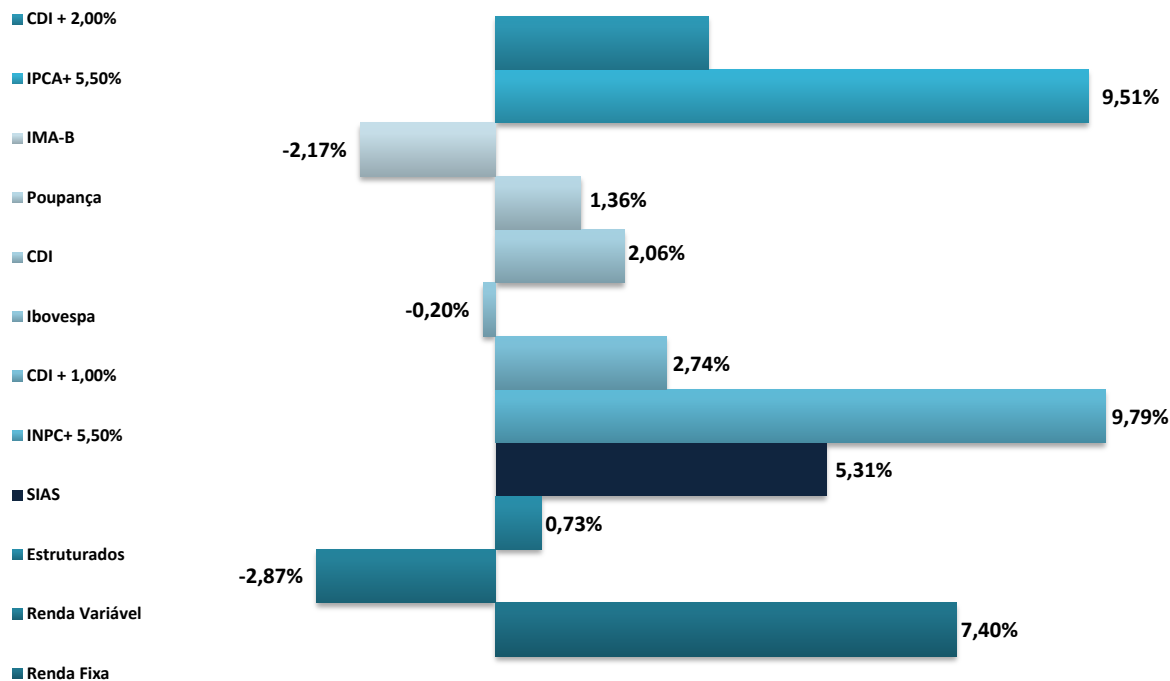
Rentabilidade

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%	0,88%	0,85%					7,40%
Renda Variável	-3,09%	-3,59%	2,40%	2,75%	5,17%	1,26%	-5,07%	-2,27%					-2,87%
Estruturados	-0,89%	0,50%	0,99%	0,67%	0,72%	0,64%	-1,76%	-0,10%					0,73%
Imóveis	0,00%	0,00%	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%	-2,84%	-2,84%					-5,05%
SIAS	0,15%	-0,14%	1,38%	1,12%	1,52%	1,05%	-0,24%	0,37%					5,31%
CLT	0,15%	-0,14%	1,37%	1,12%	1,52%	1,05%	-0,23%	0,38%					5,32%
RJU	0,15%	-0,15%	1,38%	1,11%	1,52%	1,05%	-0,24%	0,37%					5,30%
PREVSIAS	0,12%	-0,15%	1,36%	1,10%	1,48%	1,04%	-0,28%	0,33%					5,09%
PGA	0,15%	-0,14%	1,38%	1,12%	1,52%	1,05%	-0,24%	0,37%					5,31%
INPC+ 5,50%	0,72%	1,27%	1,31%	0,83%	1,41%	1,05%	1,47%	1,33%					9,79%
CDI + 1,00%	0,23%	0,22%	0,28%	0,29%	0,35%	0,39%	0,44%	0,51%					2,74%
CDI + 2,00%	0,31%	0,30%	0,36%	0,37%	0,43%	0,47%	0,52%	0,59%					3,42%
INPC	0,27%	0,82%	0,86%	0,38%	0,96%	0,60%	1,02%	0,88%					5,94%
IPCA	0,25%	0,86%	0,93%	0,31%	0,83%	0,53%	0,96%	0,87%					5,67%
Ibovespa	-3,32%	-4,37%	6,00%	1,94%	6,16%	0,46%	-3,94%	-2,48%					-0,20%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%					2,06%
Poupança	0,12%	0,12%	0,12%	0,16%	0,16%	0,20%	0,24%	0,24%					1,36%
IPCA+ 5,50%	0,70%	1,31%	1,38%	0,76%	1,28%	0,98%	1,41%	1,32%					9,51%
IMA-B	-0,85%	-1,52%	-0,46%	0,65%	1,06%	0,42%	-0,37%	-1,09%					-2,17%
Bench. RF Planos	0,72%	1,27%	1,31%	0,83%	1,41%	1,05%	1,47%	1,33%					9,79%

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)

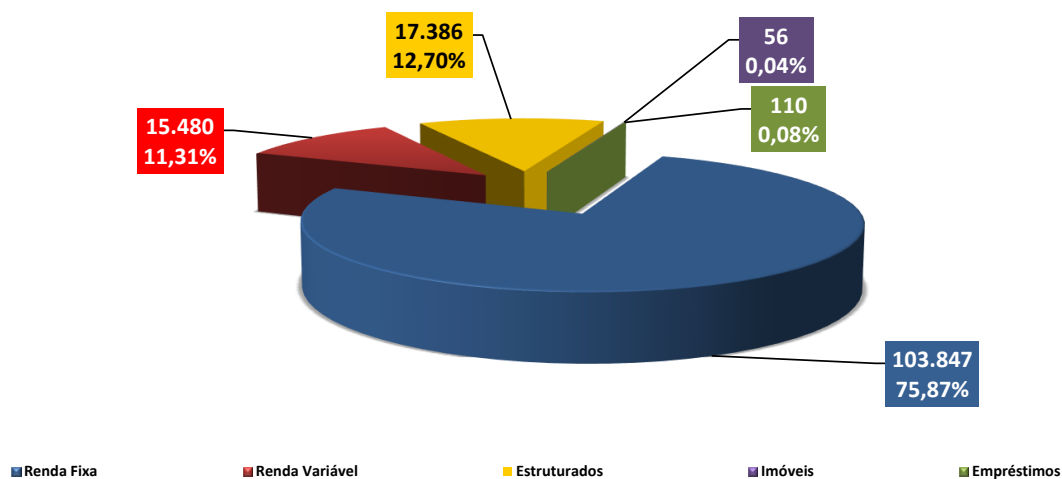


Rentabilidade dos Investimentos em 2021

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	102.252	103.847					103.313
Renda Variável	17.512	16.883	17.289	17.764	18.683	18.919	17.959	15.480					17.561
Estruturados	17.107	17.193	17.362	17.479	17.604	17.716	17.404	17.386					17.406
Imóveis	56	56	56	56	56	56	56	56					56
Empréstimos	139	134	141	134	128	122	116	110					128
Total	139.005	137.494	138.779	138.494	139.577	139.697	137.786	136.879					138.464

Carteira de Investimentos em Agosto 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%	7,40%	196,30%
Renda Variável	16,25%	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-2,87%	129,96%
Estruturados	0,00%	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	0,73%	121,13%
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%	-5,05%	297,11%
SIAS	21,90%	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	5,31%	197,14%
Indicadores											
CDI	8,40%	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	2,06%	117,95%
Poupança	6,48%	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	1,36%	69,99%
IBOVESPA	7,40%	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-0,20%	109,32%
INPC(IBGE)	6,20%	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	5,94%	74,03%
INPC + 5,50%	12,04%	11,37%	12,07%	17,40%	12,44%	7,68%	9,12%	10,23%	11,25%	9,79%	192,01%

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%	197,14%	
INPC + 5,50%	12,04%	24,78%	39,84%	64,17%	84,59%	98,77%	116,90%	139,09%	165,98%	192,01%	
Poupança	6,48%	12,67%	20,65%	30,39%	41,22%	50,56%	57,52%	64,23%	67,70%	69,99%	
CDI	8,40%	17,14%	29,81%	47,01%	67,59%	84,26%	96,10%	107,80%	113,55%	117,95%	

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

