



Demonstrativo de Investimentos

Setembro/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\$

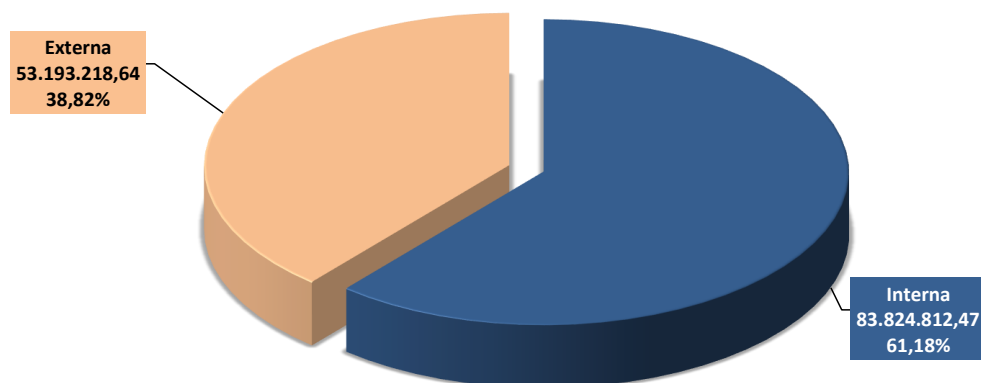
| Descrição | Valor de Mercado | % s/ Seg | % s/ RG |
|---|-----------------------|--------------|--------------|
| Renda Fixa | 103.346.231,13 | 100,0 | 75,4 |
| Títulos Públicos Federais | 82.105.956,22 | 79,4 | 59,9 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 21.240.274,91 | 20,6 | 15,5 |
| Renda Variável | 14.440.873,54 | 100,0 | 10,5 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 14.440.873,54 | 100,0 | 10,5 |
| Investimentos Estruturados | 17.512.070,19 | 100,0 | 12,8 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 17.512.070,19 | 100,0 | 12,8 |
| Investimentos Imobiliários | 55.660,63 | 100,0 | 0,0 |
| Direitos de alienações | 55.660,63 | 100,0 | 0,0 |
| Empréstimos e Financiamentos | 104.823,91 | 100,0 | 0,1 |
| Outros | 1.558.371,71 | 100,0 | 1,1 |
| Total dos Investimentos | 137.018.031,11 | | 100,0 |
| (+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos | 59.172,89 | | 0,0 |
| Total dos Recursos Garantidores | 137.077.204,00 | | 100,0 |

Gestão interna x externa

Valores em R\$

| Descrição | Interna | % | Externa | % | Total | % |
|---------------------------------------|----------------------|----------------|----------------------|----------------|-----------------------|----------------|
| Carteira de Títulos Públicos Federais | 82.105.956,22 | 97,95% | | | 82.105.956,22 | 59,92% |
| Quotas Fundos de Investimentos de RF | | | 21.240.274,91 | 39,93% | 21.240.274,91 | 15,50% |
| Quotas Fundos de Investimentos de RV | | | 14.440.873,54 | 27,15% | 14.440.873,54 | 10,54% |
| Investimentos Estruturados | | | 17.512.070,19 | 32,92% | 17.512.070,19 | 12,78% |
| Investimentos Imobiliários | 55.660,63 | 0,07% | | | 55.660,63 | 0,04% |
| Empréstimos e Financiamentos | 104.823,91 | 0,13% | | | 104.823,91 | 0,08% |
| Outros Investimentos | 1.558.371,71 | 1,86% | | | 1.558.371,71 | 1,14% |
| Total | 83.824.812,47 | 100,00% | 53.193.218,64 | 100,00% | 137.018.031,11 | 100,00% |

Gestão Interna x Externa



Rentabilidade dos Investimentos em 2021

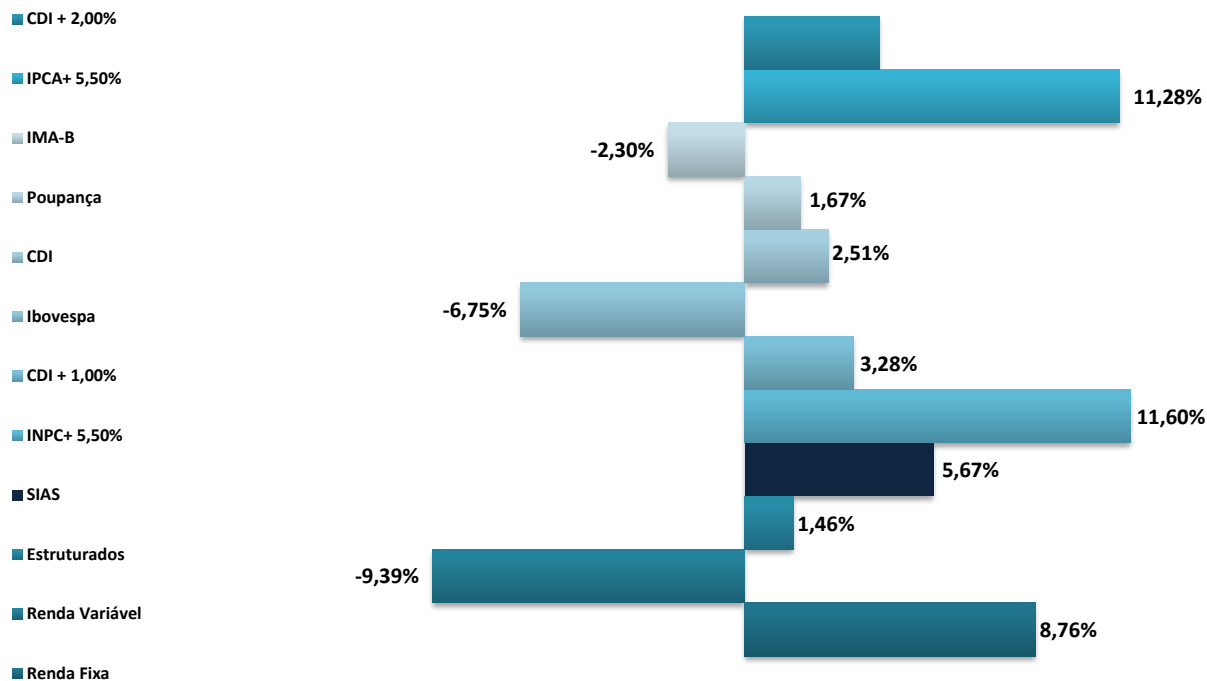
Rentabilidade

| 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% | 1,26% | | | | 8,76% |
| Renda Variável | -3,09% | -3,59% | 2,40% | 2,75% | 5,17% | 1,26% | -5,07% | -2,27% | -6,71% | | | | -9,39% |
| Estruturados | -0,89% | 0,50% | 0,99% | 0,67% | 0,72% | 0,64% | -1,76% | -0,10% | 0,72% | | | | 1,46% |
| Imóveis | 0,00% | 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% | -2,69% | | | | -7,60% |
| SIAS | 0,15% | -0,14% | 1,38% | 1,12% | 1,52% | 1,05% | -0,24% | 0,37% | 0,34% | | | | 5,67% |
| CLT | 0,15% | -0,14% | 1,37% | 1,12% | 1,52% | 1,05% | -0,23% | 0,38% | 0,33% | | | | 5,67% |
| RJU | 0,15% | -0,15% | 1,38% | 1,11% | 1,52% | 1,05% | -0,24% | 0,37% | 0,35% | | | | 5,67% |
| PREVSIAS | 0,12% | -0,15% | 1,36% | 1,10% | 1,48% | 1,04% | -0,28% | 0,33% | 0,28% | | | | 5,38% |
| PGA | 0,15% | -0,14% | 1,38% | 1,12% | 1,52% | 1,05% | -0,24% | 0,37% | 0,34% | | | | 5,67% |
| INPC+ 5,50% | 0,72% | 1,27% | 1,31% | 0,83% | 1,41% | 1,05% | 1,47% | 1,33% | 1,65% | | | | 11,60% |
| CDI + 1,00% | 0,23% | 0,22% | 0,28% | 0,29% | 0,35% | 0,39% | 0,44% | 0,51% | 0,52% | | | | 3,28% |
| CDI + 2,00% | 0,31% | 0,30% | 0,36% | 0,37% | 0,43% | 0,47% | 0,52% | 0,59% | 0,60% | | | | 4,04% |
| INPC | 0,27% | 0,82% | 0,86% | 0,38% | 0,96% | 0,60% | 1,02% | 0,88% | 1,20% | | | | 7,21% |
| IPCA | 0,25% | 0,86% | 0,93% | 0,31% | 0,83% | 0,53% | 0,96% | 0,87% | 1,16% | | | | 6,90% |
| Ibovespa | -3,32% | -4,37% | 6,00% | 1,94% | 6,16% | 0,46% | -3,94% | -2,48% | -6,57% | | | | -6,75% |
| CDI | 0,15% | 0,13% | 0,20% | 0,21% | 0,27% | 0,30% | 0,36% | 0,42% | 0,44% | | | | 2,51% |
| Poupança | 0,12% | 0,12% | 0,12% | 0,16% | 0,16% | 0,20% | 0,24% | 0,24% | 0,30% | | | | 1,67% |
| IPCA+ 5,50% | 0,70% | 1,31% | 1,38% | 0,76% | 1,28% | 0,98% | 1,41% | 1,32% | 1,61% | | | | 11,28% |
| IMA-B | -0,85% | -1,52% | -0,46% | 0,65% | 1,06% | 0,42% | -0,37% | -1,09% | -0,13% | | | | -2,30% |
| Bench. RF Planos | 0,72% | 1,27% | 1,31% | 0,83% | 1,41% | 1,05% | 1,47% | 1,33% | 1,65% | | | | 11,60% |

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)

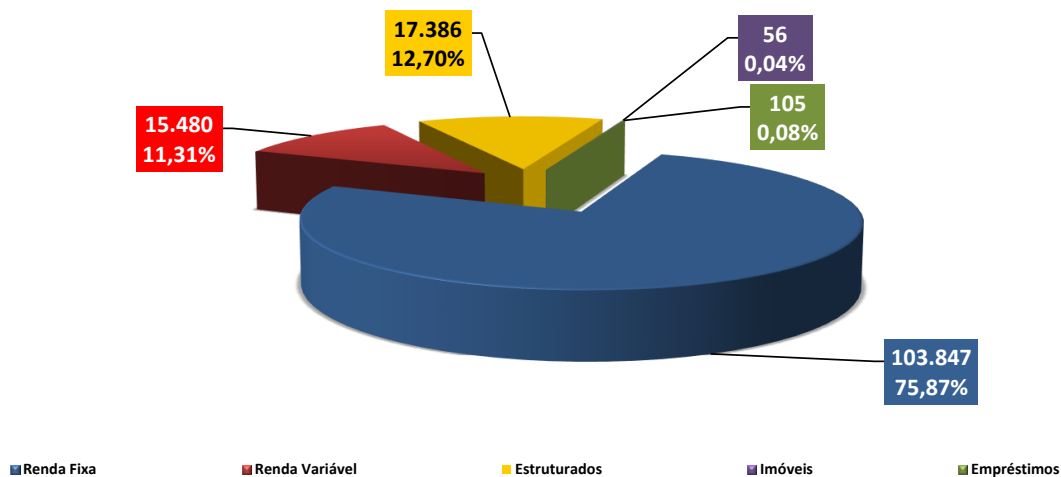


Rentabilidade dos Investimentos em 2021

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 | 103.346 | | | | 103.317 |
| Renda Variável | 17.512 | 16.883 | 17.289 | 17.764 | 18.683 | 18.919 | 17.959 | 15.480 | 14.441 | | | | 17.214 |
| Estruturados | 17.107 | 17.193 | 17.362 | 17.479 | 17.604 | 17.716 | 17.404 | 17.386 | 17.512 | | | | 17.418 |
| Imóveis | 56 | 56 | 56 | 56 | 56 | 56 | 56 | 56 | 56 | | | | 56 |
| Empréstimos | 139 | 134 | 141 | 134 | 128 | 122 | 116 | 105 | 105 | | | | 125 |
| Total | 139.005 | 137.494 | 138.779 | 138.494 | 139.577 | 139.697 | 137.786 | 136.874 | 135.460 | | | | 138.130 |

Carteira de Investimentos em setembro 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% | 8,76% | 200,04% |
| Renda Variável | 16,25% | -2,77% | 0,14% | 3,33% | -1,94% | 31,18% | 6,84% | 42,46% | 3,39% | -9,39% | 114,53% |
| Estruturados | 0,00% | 8,96% | 8,21% | 16,42% | 18,79% | 13,88% | 5,86% | 8,99% | 2,47% | 1,46% | 122,73% |
| 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% | -7,60% | 286,43% |
| SIAS | 21,90% | 3,03% | 11,51% | 16,40% | 13,10% | 10,34% | 10,14% | 13,58% | 10,87% | 5,67% | 198,15% |
| Indicadores | | | | | | | | | | | |
| CDI | 8,40% | 8,06% | 10,82% | 13,25% | 14,00% | 9,95% | 6,42% | 5,97% | 2,77% | 2,51% | 118,91% |
| Poupança | 6,48% | 5,81% | 7,09% | 8,08% | 8,30% | 6,61% | 4,62% | 4,26% | 2,11% | 1,67% | 70,50% |
| IBOVESPA | 7,40% | -15,50% | -2,91% | -13,30% | 38,94% | 26,86% | 15,03% | 31,58% | 2,92% | -6,75% | 95,57% |
| INPC(IBGE) | 6,20% | 5,56% | 6,23% | 11,28% | 6,58% | 2,07% | 3,43% | 4,48% | 5,45% | 7,21% | 76,12% |
| INPC + 5,50% | 12,04% | 11,37% | 12,07% | 17,40% | 12,44% | 7,68% | 9,12% | 10,23% | 11,25% | 11,60% | 196,83% |

| 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% | 198,15% | 198,15% |
| INPC + 5,50% | 12,04% | 24,78% | 39,84% | 64,17% | 84,59% | 98,77% | 116,90% | 139,09% | 165,98% | 196,83% | 196,83% |
| Poupança | 6,48% | 12,67% | 20,65% | 30,39% | 41,22% | 50,56% | 57,52% | 64,23% | 67,70% | 70,50% | 70,50% |
| CDI | 8,40% | 17,14% | 29,81% | 47,01% | 67,59% | 84,26% | 96,10% | 107,80% | 113,55% | 118,91% | 118,91% |

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

