



Demonstrativo de Investimentos

Dezembro/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\$

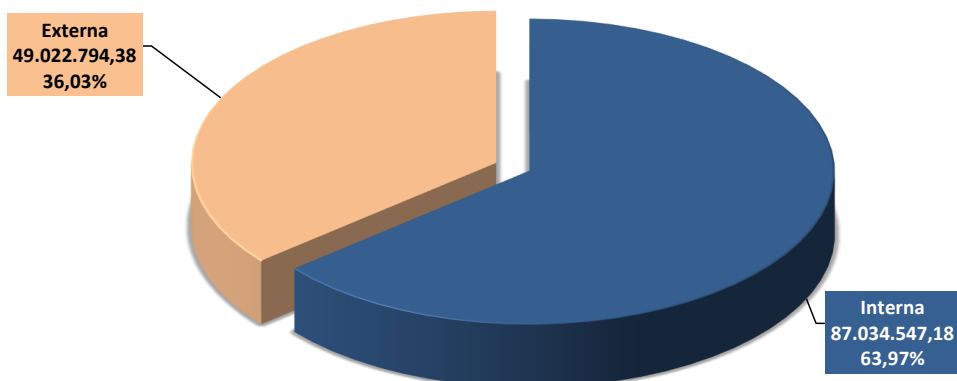
Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
Renda Fixa	103.385.221,34	100,0	75,9
Títulos Públicos Federais	85.332.637,57	82,5	62,7
Quotas de Fundos de Investimentos	18.052.583,77	17,5	13,3
Renda Variável	12.913.132,11	100,0	9,5
Quotas de Fundos de Investimentos	12.913.132,11	100,0	9,5
Investimentos Estruturados	18.057.078,50	100,0	13,3
Quotas de Fundos de Investimentos	18.057.078,50	100,0	13,3
Investimentos Imobiliários	55.660,63	100,0	0,0
Direitos de alienações	55.660,63	100,0	0,0
Empréstimos e Financiamentos	87.877,27	100,0	0,1
Empréstimos	87.877,27	100,0	0,1
Outros	1.558.371,71	100,0	1,1
IR a recuperar	1.558.371,71	100,0	1,1
Total dos Investimentos	136.057.341,56		99,9
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	88.514,55		0,1
Total dos Recursos Garantidores	136.145.856,11		100,0

Gestão interna x externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	85.332.637,57	98,04%			85.332.637,57	62,72%
Quotas Fundos de Investimentos de RF			18.052.583,77	36,82%	18.052.583,77	13,27%
Quotas Fundos de Investimentos de RV			12.913.132,11	26,34%	12.913.132,11	9,49%
Investimentos Estruturados			18.057.078,50	36,83%	18.057.078,50	13,27%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,06%			55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	87.877,27	0,10%			87.877,27	0,06%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,79%			1.558.371,71	1,15%
Total	87.034.547,18	100,00%	49.022.794,38	100,00%	136.057.341,56	100,00%

Gestão Interna x Externa



Rentabilidade dos Investimentos em 2021

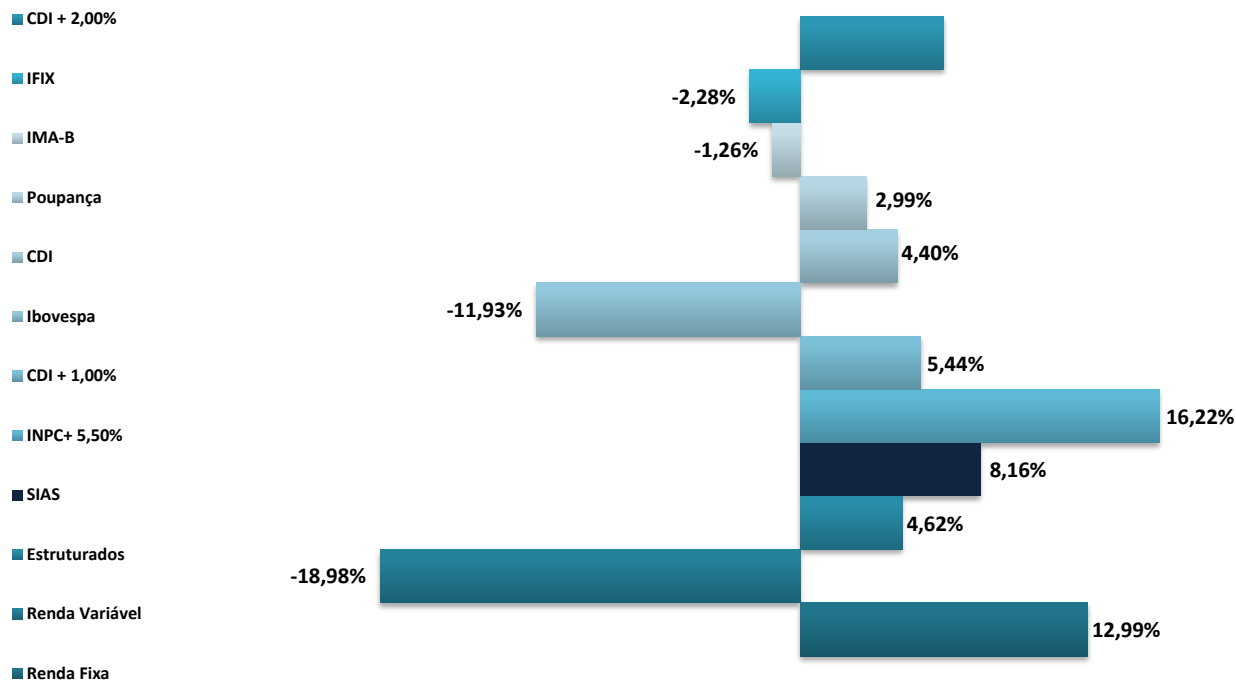
Rentabilidade

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%	0,71%	1,98%	1,15%	12,99%
Renda Variável	-3,09%	-3,59%	2,40%	2,75%	5,17%	1,26%	-5,07%	-2,27%	-6,71%	-10,40%	-1,46%	1,28%	-18,98%
Estruturados	-0,89%	0,50%	0,99%	0,67%	0,72%	0,64%	-1,76%	-0,10%	0,72%	1,65%	0,10%	1,34%	4,62%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	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%	-2,75%	-2,40%	-2,56%	-14,54%
SIAS	0,15%	-0,14%	1,38%	1,12%	1,52%	1,05%	-0,24%	0,37%	0,34%	-0,24%	1,40%	1,18%	8,16%
CLT	0,15%	-0,14%	1,37%	1,12%	1,52%	1,05%	-0,23%	0,38%	0,33%	-0,24%	1,40%	1,19%	8,17%
RJU	0,15%	-0,15%	1,38%	1,11%	1,52%	1,05%	-0,24%	0,37%	0,35%	-0,24%	1,40%	1,19%	8,16%
PREVSIAS	0,12%	-0,15%	1,36%	1,10%	1,48%	1,04%	-0,28%	0,33%	0,28%	-0,37%	1,39%	1,19%	7,72%
PGA	0,15%	-0,14%	1,38%	1,12%	1,52%	1,05%	-0,24%	0,37%	0,34%	-0,24%	1,40%	1,18%	8,16%
INPC+ 5,50%	0,72%	1,27%	1,31%	0,83%	1,41%	1,05%	1,47%	1,33%	1,65%	1,61%	1,29%	1,18%	16,22%
CDI + 1,00%	0,23%	0,22%	0,28%	0,29%	0,35%	0,39%	0,44%	0,51%	0,52%	0,56%	0,67%	0,85%	5,44%
CDI + 2,00%	0,31%	0,30%	0,36%	0,37%	0,43%	0,47%	0,52%	0,59%	0,60%	0,65%	0,75%	0,93%	6,48%
INPC	0,27%	0,82%	0,86%	0,38%	0,96%	0,60%	1,02%	0,88%	1,20%	1,16%	0,84%	0,73%	10,16%
IPCA	0,25%	0,86%	0,93%	0,31%	0,83%	0,53%	0,96%	0,87%	1,16%	1,25%	0,95%	0,73%	10,06%
Ibovespa	-3,32%	-4,37%	6,00%	1,94%	6,16%	0,46%	-3,94%	-2,48%	-6,57%	-6,74%	-1,53%	2,85%	-11,93%
CDI	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,30%	0,36%	0,42%	0,44%	0,48%	0,59%	0,76%	4,40%
Poupança	0,12%	0,12%	0,12%	0,16%	0,16%	0,20%	0,24%	0,24%	0,30%	0,36%	0,44%	0,49%	2,99%
IFIX	0,32%	0,25%	-1,38%	0,51%	-1,56%	-2,19%	2,51%	-2,63%	-1,24%	-1,47%	-3,64%	8,78%	-2,28%
IMA-B	-0,85%	-1,52%	-0,46%	0,65%	1,06%	0,42%	-0,37%	-1,09%	-0,13%	-2,54%	3,47%	0,22%	-1,26%
Bench. RF Planos	0,72%	1,27%	1,31%	0,83%	1,41%	1,05%	1,47%	1,33%	1,65%	1,61%	1,29%	1,18%	16,22%

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 => INPC + 5,50% a.a
8. O Benchmark de Imóveis => IFIX

Rentabilidades e Indicadores (Acumulado no ano)

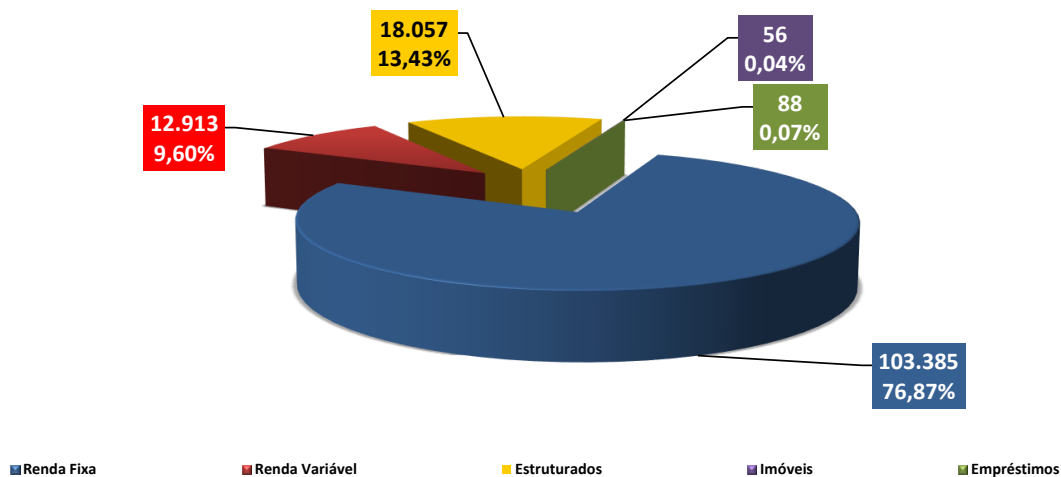


Rentabilidade dos Investimentos em 2021

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	103.012	103.753	103.385	103.333
Renda Variável	17.512	16.883	17.289	17.764	18.683	18.919	17.959	15.480	14.441	12.939	12.750	12.913	16.128
Estruturados	17.107	17.193	17.362	17.479	17.604	17.716	17.404	17.386	17.512	17.801	17.819	18.057	17.537
Imóveis	56	56	56	56	56	56	56	56	56	56	56	56	56
Empréstimos	139	134	141	134	128	122	116	105	105	100	96	88	117
Total	139.005	137.494	138.779	138.494	139.577	139.697	137.786	136.874	135.460	133.908	134.474	134.499	137.171

Carteira de Investimentos em dezembro 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%	12,99%	211,71%
Renda Variável	16,25%	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-18,98%	91,83%
Estruturados	0,00%	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	4,62%	129,66%
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%	-14,54%	257,42%
SIAS	21,90%	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	205,16%
Indicadores											
CDI	8,40%	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	4,40%	122,94%
Poupança	6,48%	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	2,99%	72,71%
IBOVESPA	7,40%	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-11,93%	84,72%
INPC(IGBE)	6,20%	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	10,16%	80,97%
INPC + 5,50%	12,04%	11,37%	12,07%	17,40%	12,44%	7,68%	9,12%	10,23%	11,25%	16,22%	209,12%

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%	205,16%
INPC + 5,50%	12,04%	24,78%	39,84%	64,17%	84,59%	98,77%	116,90%	139,09%	165,98%	209,12%
Poupança	6,48%	12,67%	20,65%	30,39%	41,22%	50,56%	57,52%	64,23%	67,70%	72,71%
CDI	8,40%	17,14%	29,81%	47,01%	67,59%	84,26%	96,10%	107,80%	113,55%	122,94%

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

