

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)).

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS

Julho de 2022



# ÍNDICE

---

<b>CARTEIRA DE INVESTIMENTOS</b> .....	<b>01</b>
<b>GESTÃO INTERNA x EXTERNA</b> .....	<b>01</b>
<b>ALOCAÇÃO</b> .....	<b>02</b>
<b>RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS</b> .....	<b>03</b>
<b>HISTÓRICO DE RENTABILIDADE</b> .....	<b>04</b>

# Carteira de Investimentos

Valores em R\$

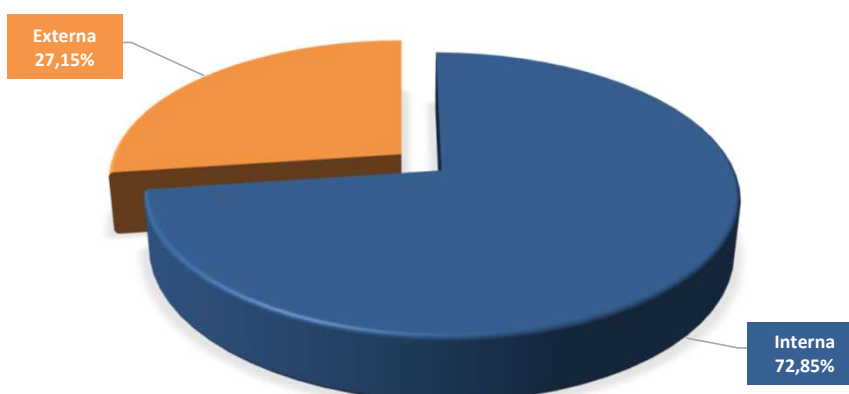
Descrição	29/07/2022			31/12/2021		
	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
<b>RENDA FIXA</b>	<b>104.665.130,36</b>	<b>100,0</b>	<b>75,3</b>	<b>103.385.221,34</b>	<b>100,0</b>	<b>75,9</b>
Títulos Públicos Federais	99.566.361,52	95,1	71,6	85.332.637,57	82,5	62,7
Quotas de Fundos de Investimentos	5.098.768,84	4,9	3,7	18.052.583,77	17,5	13,3
<b>RENDA VARIÁVEL</b>	<b>12.197.205,56</b>	<b>100,0</b>	<b>8,8</b>	<b>12.913.132,11</b>	<b>100,0</b>	<b>9,5</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	12.197.205,56	100,0	8,8	12.913.132,11	100,0	9,5
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	<b>20.440.412,79</b>	<b>100,0</b>	<b>14,7</b>	<b>18.057.078,50</b>	<b>100,0</b>	<b>13,3</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	20.440.412,79	100,0	14,7	18.057.078,50	100,0	13,3
<b>INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>55.660,63</b>	<b>100,0</b>	<b>0,0</b>	<b>55.660,63</b>	<b>100,0</b>	<b>0,0</b>
Direitos de alienações	55.660,63	100,0	0,0	55.660,63	100,0	0,0
<b>EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS</b>	<b>65.232,62</b>	<b>100,0</b>	<b>0,0</b>	<b>87.877,27</b>	<b>100,0</b>	<b>0,1</b>
Empréstimos	65.232,62	100,0	0,0	87.877,27	100,0	0,1
<b>OUTROS</b>	<b>1.558.371,71</b>	<b>100,0</b>	<b>1,1</b>	<b>1.558.371,71</b>	<b>100,0</b>	<b>1,1</b>
IR a recuperar	1.558.371,71	100,0	1,1	1.558.371,71	100,0	1,1
<b>TOTAL DOS INVESTIMENTOS</b>	<b>138.982.013,67</b>		<b>99,9</b>	<b>136.057.341,56</b>		<b>99,9</b>
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	74.975,96		0,1	88.514,55		0,1
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>	<b>139.056.989,63</b>		<b>100,0</b>	<b>136.145.856,11</b>		<b>100,0</b>

## Gestão Interna x Externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	99.566.361,52	98,34%		0,00%	99.566.361,52	71,64%
Quotas Fundos de Investimentos de RF		0,00%	5.098.768,84	13,51%	5.098.768,84	3,67%
Quotas Fundos de Investimentos de RV		0,00%	12.197.205,56	32,32%	12.197.205,56	8,78%
Investimentos Estruturados		0,00%	20.440.412,79	54,17%	20.440.412,79	14,71%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,05%		0,00%	55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	65.232,62	0,06%		0,00%	65.232,62	0,05%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,54%		0,00%	1.558.371,71	1,12%
<b>Total</b>	<b>101.245.626,48</b>	<b>100,00%</b>	<b>37.736.387,19</b>	<b>100,00%</b>	<b>138.982.013,67</b>	<b>100,00%</b>

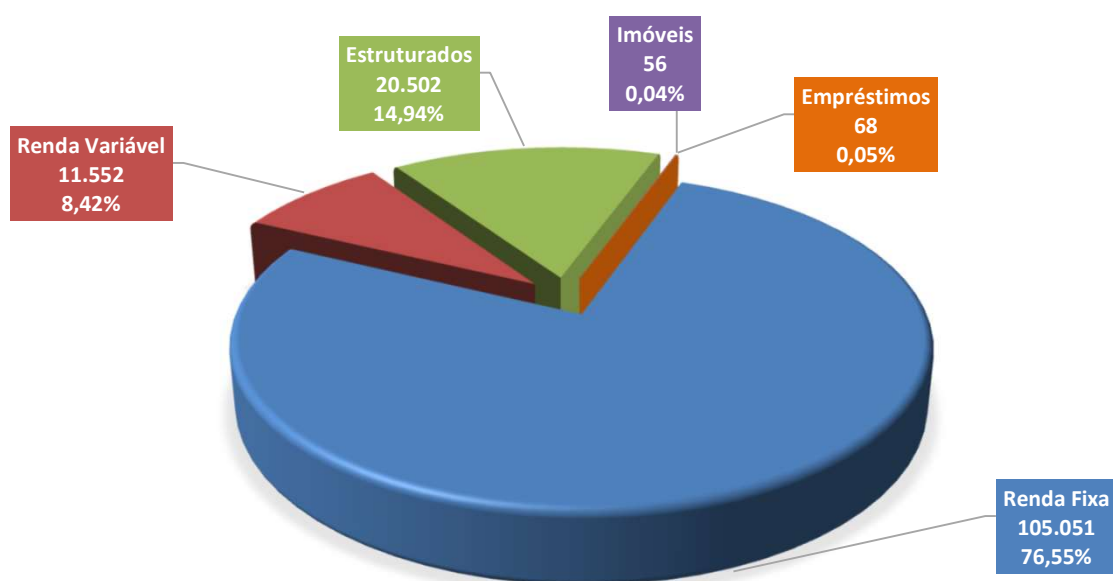
### GESTÃO INTERNA X EXTERNA



## Alocação dos Investimentos em 2022

Descrição	Valores em R\$ Mil												
	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Média
Renda Fixa	103.367	103.623	104.073	104.503	105.166	105.051	104.665						104.350
Renda Variável	13.735	13.494	14.199	12.829	12.890	11.552	12.197						12.985
Estruturados	18.273	18.552	19.475	19.945	20.312	20.502	20.440						19.643
Imóveis	56	56	56	56	56	56	56						56
Empréstimos	84	80	77	77	71	68	65						75
<b>Total</b>	<b>135.515</b>	<b>135.806</b>	<b>137.879</b>	<b>137.409</b>	<b>138.495</b>	<b>137.228</b>	<b>137.424</b>						<b>137.108</b>

### Carteira de Investimentos - Julho/2022



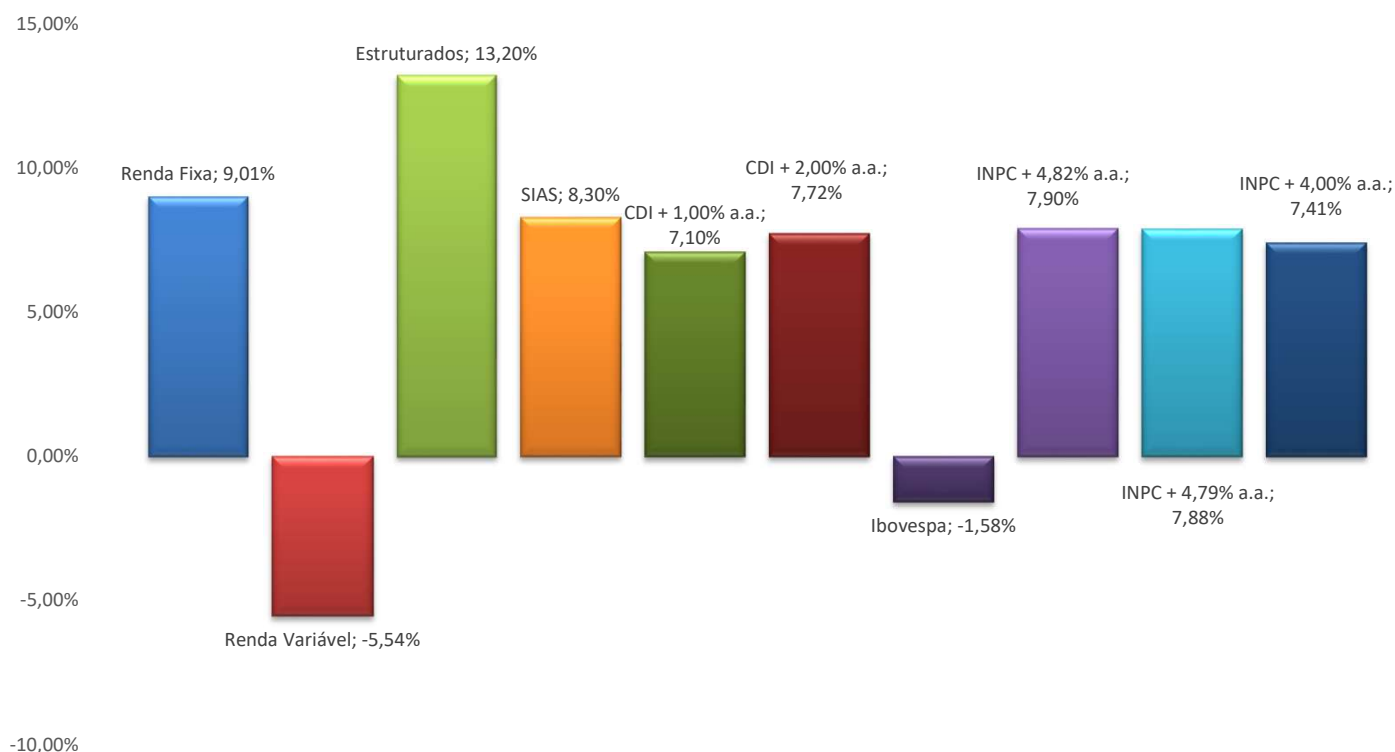
## Rentabilidade dos Investimentos em 2022

Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
<b>Renda Fixa</b>	1,10%	1,13%	1,73%	1,72%	1,46%	1,02%	0,53%						9,01%
<b>Renda Variável</b>	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%	-10,38%	5,59%						-5,54%
<b>Estruturados</b>	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%	0,93%	-0,30%						13,20%
<b>Imóveis</b>	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%						0,00%
<b>Empréstimos</b>	-2,40%	15,62%	-2,18%	-2,13%	-1,49%	-1,58%	-0,65%						4,07%
<b>SIAS</b>	<b>1,65%</b>	<b>0,91%</b>	<b>2,52%</b>	<b>0,76%</b>	<b>1,42%</b>	<b>-0,06%</b>	<b>0,85%</b>						<b>8,30%</b>
CLT	1,65%	0,90%	2,54%	0,75%	1,42%	-0,06%	0,86%						8,32%
RJU	1,64%	0,92%	2,53%	0,76%	1,42%	-0,06%	0,85%						8,32%
PREVSIAS	1,62%	0,89%	2,53%	0,64%	1,42%	-0,07%	0,82%						8,10%
PGA	1,66%	0,90%	2,55%	0,75%	1,42%	-0,06%	0,86%						8,34%
INPC + 4,82% a.a.	1,07%	1,40%	2,11%	1,44%	0,84%	1,02%	-0,21%						7,90%
INPC + 4,79% a.a.	1,06%	1,39%	2,11%	1,43%	0,84%	1,01%	-0,21%						7,88%
INPC + 4,00% a.a.	1,00%	1,33%	2,04%	1,37%	0,78%	0,95%	-0,27%						7,41%
CDI + 1,00% a.a.	0,82%	0,83%	1,01%	0,92%	1,11%	1,09%	1,11%						7,10%
CDI + 2,00% a.a.	0,90%	0,92%	1,09%	1,00%	1,20%	1,18%	1,20%						7,72%
INPC	0,67%	1,00%	1,71%	1,04%	0,45%	0,62%	-0,60%						4,98%
IPCA	0,54%	1,01%	1,62%	1,06%	0,47%	0,67%	-0,68%						4,77%
Ibovespa	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%						-1,58%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%						6,48%
Poupança	0,56%	0,50%	0,60%	0,56%	0,67%	0,65%	0,66%						4,27%
IFIX	-0,99%	-1,29%	1,42%	1,19%	0,26%	-0,88%	0,66%						0,33%
IMA-B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%	-0,88%						3,43%

### 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 2022-2026.
3. Meta Atuarial => Plano CLT: INPC + 4,82% a.a.; Plano RJU: INPC + 4,79% a.a.; Plano PREVSIAS: INPC + 4,00% a.a.; Meta PGA => CDI + 1,00%
4. O Benchmark da Renda Fixa => Plano CLT: INPC + 4,82% a.a.; Plano RJU: INPC + 4,79% a.a.; Plano PREVSIAS e PGA: INPC + 4,00% a.a.
5. O Benchmark de Empréstimos => Plano CLT: INPC + 4,82% a.a.; Plano RJU: INPC + 4,79% a.a.; Plano PREVSIAS e PGA: INPC + 4,00% a.a.
6. O Benchmark da Renda Variável => Ibovespa
7. O Benchmark de Estruturados => CDI + 2,00% a.a
8. O Benchmark de Imóveis => IFIX

## Rentabilidade em 2022



## Histórico de Rentabilidade - Últimos 10 anos

	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
<b>Segmentos</b>										
Renda Fixa	3,56%	13,05%	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	9,91%	10,41%	12,99%	9,01%
Renda Variável	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-18,98%	-5,54%
Estruturados	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	4,62%	13,20%
Imóveis	0,00%	-42,34%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Empréstimos	35,94%	37,01%	38,36%	9,55%	27,66%	-1,56%	-13,55%	32,33%	-14,54%	4,07%
SIAS	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	8,30%
<b>Indicadores</b>										
CDI	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	4,40%	6,48%
Poupança	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	2,99%	4,27%
IBOVESPA	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-11,93%	-1,58%
INPC	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	10,16%	4,98%
CDI +1,00%	9,14%	11,92%	14,35%	15,14%	11,04%	7,48%	7,03%	3,79%	5,43%	7,10%
Índice INPC +4,00%	9,80%	10,49%	15,69%	10,83%	6,10%	7,54%	8,68%	9,65%	14,55%	7,41%
Índice INPC +4,79%	10,64%	11,34%	16,56%	11,66%	6,90%	8,35%	9,51%	10,48%	15,42%	7,88%
Índice INPC +4,82%	10,67%	11,37%	16,60%	11,70%	6,93%	8,38%	9,54%	10,51%	15,45%	7,90%

<b>Rentabilidade acumulada</b>										
	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
SIAS	3,03%	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	171,12%
CDI	8,06%	19,76%	35,62%	54,61%	69,99%	80,91%	91,70%	97,01%	105,67%	119,00%
Poupança	5,81%	13,31%	22,46%	32,64%	41,41%	47,95%	54,24%	57,50%	62,20%	69,13%
CDI +1,00%	9,14%	22,15%	39,68%	60,82%	78,57%	91,93%	105,42%	113,21%	124,80%	140,77%
INPC +4,00%	9,80%	21,33%	40,36%	55,56%	65,05%	77,49%	92,89%	111,50%	142,27%	160,22%
INPC +4,79%	10,64%	23,18%	43,59%	60,33%	71,39%	85,70%	103,35%	124,66%	159,29%	179,73%
INPC +4,82%	10,67%	23,25%	43,71%	60,52%	71,64%	86,02%	103,76%	125,17%	159,96%	180,50%

### Evolução - Rentabilidade x Meta atuarial x Indicadores de mercado

