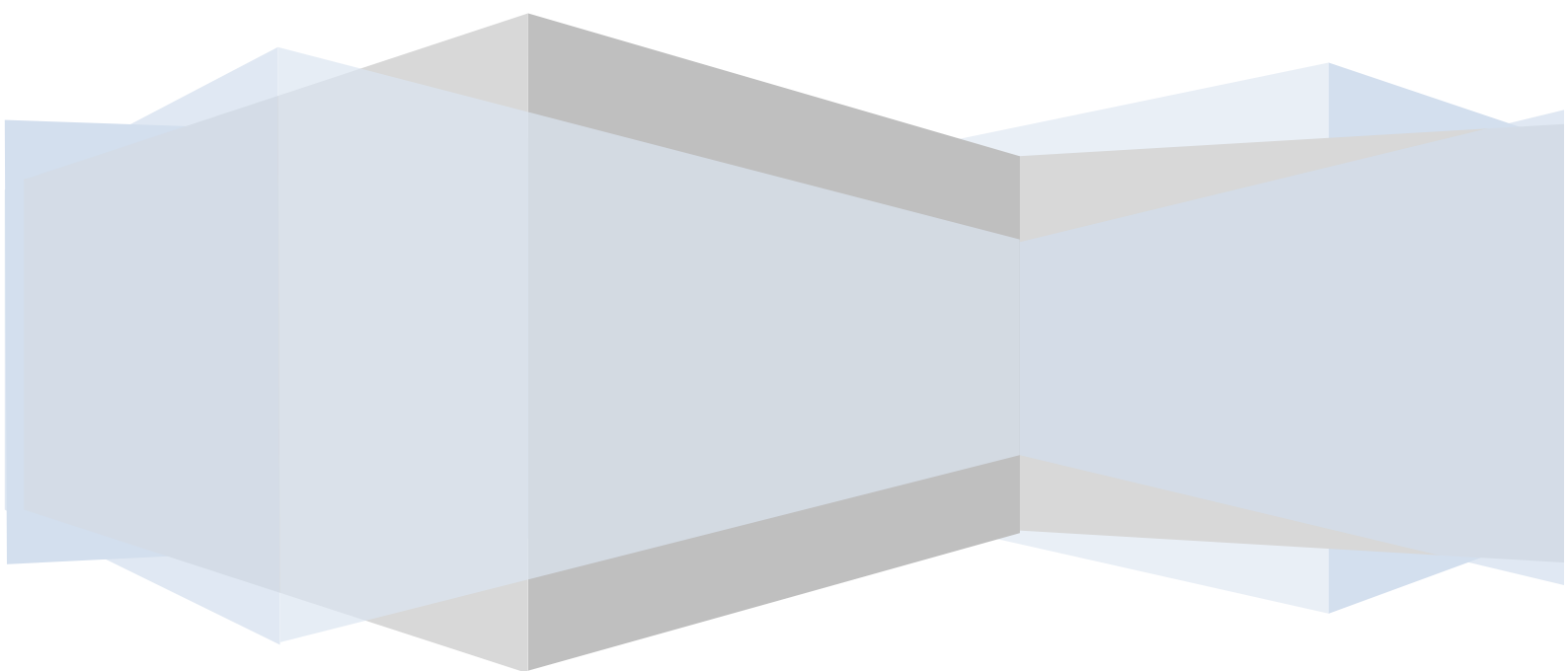




Demonstrativo de Investimentos

Fevereiro/2020

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\$

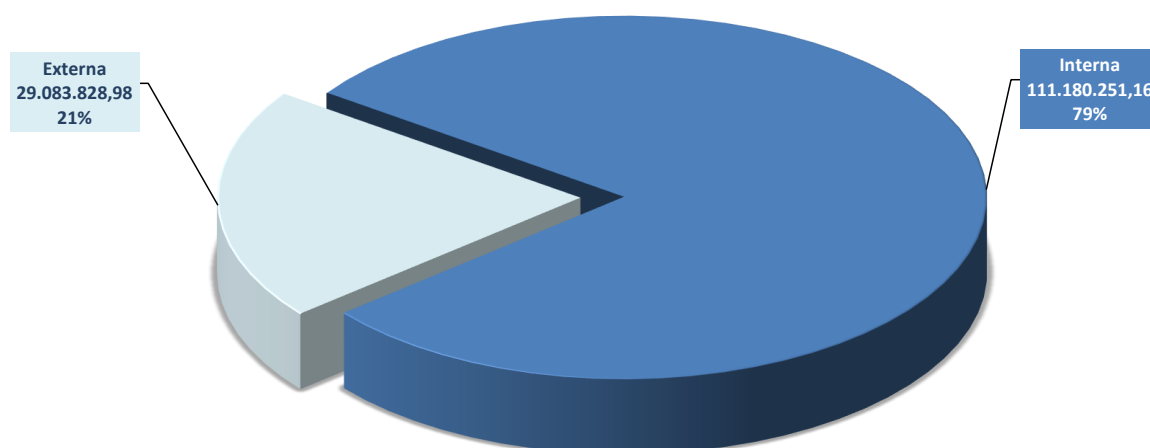
Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
Renda Fixa	110.808.526,47	100,0	79,0
Títulos Públicos Federais	85.234.756,35	76,9	60,8
Letras Financeiras (LF's)	24.206.939,86	21,8	17,3
Quotas de Fundos de Investimentos	1.366.830,26	1,2	1,0
Renda Variável	14.243.325,66	100,0	10,2
Quotas de Fundos de Investimentos	14.243.325,66	100,0	10,2
Investimentos Estruturados	13.473.673,06	100,0	9,6
Quotas de Fundos de Investimentos	13.473.673,06	100,0	9,6
Investimentos Imobiliários	55.660,63	100,0	0,0
Direitos de alienações	55.660,63	100,0	0,0
Empréstimos e Financiamentos	124.522,61	100,0	0,1
Outros	1.558.371,71	100,0	1,1
Total dos Investimentos	140.264.080,14		100,0
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	36.697,05		0,0
Total dos Recursos Garantidores	140.300.777,19		100,0

Gestão interna x externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	85.234.756,35	76,66%			85.234.756,35	60,77%
Carteira de Títulos Privados	24.206.939,86	21,77%			24.206.939,86	17,26%
Quotas Fundos de Investimentos de RF			1.366.830,26	4,70%	1.366.830,26	0,97%
Quotas Fundos de Investimentos de RV			14.243.325,66	48,97%	14.243.325,66	10,15%
Investimentos Estruturados			13.473.673,06	46,33%	13.473.673,06	9,61%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,05%			55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	124.522,61	0,11%			124.522,61	0,09%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,40%			1.558.371,71	1,11%
Total	111.180.251,16	100,00%	29.083.828,98	100,00%	140.264.080,14	100,00%

Gestão Interna x Externa



Rentabilidade dos Investimentos em 2020

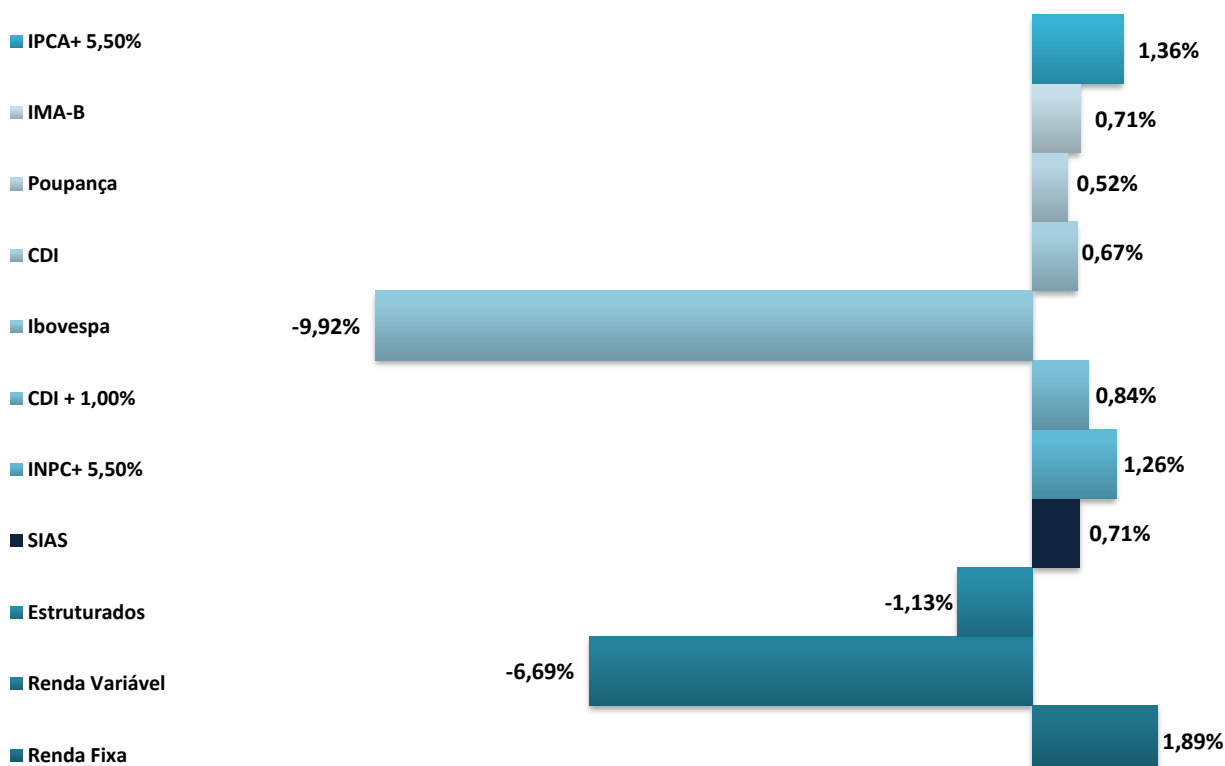
Rentabilidade

Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
Renda Fixa	1,35%	0,53%											1,89%
Renda Variável	0,87%	-7,50%											-6,69%
Estruturados	-0,01%	-1,12%											-1,13%
Imóveis	0,00%	0,00%											0,00%
Empréstimos	-3,12%	10,14%											6,70%
SIAS	1,16%	-0,45%											0,71%
INPC+ 5,50%	0,64%	0,62%											1,26%
CDI + 1,00%	0,46%	0,38%											0,84%
INPC	0,19%	0,17%											0,36%
IPCA	0,21%	0,25%											0,46%
Ibovespa	-1,63%	-8,43%											-9,92%
CDI	0,38%	0,29%											0,67%
Poupança	0,26%	0,26%											0,52%
IPCA+ 5,50%	0,66%	0,70%											1,36%
IMA-B	0,26%	0,45%											0,71%
Bench. RF Planos	0,64%	0,62%											1,26%

Observações:

1. Benchmark = referência de rentabilidade. Definidos na Política de Investimentos 2020-2023.
2. Meta Atuarial => Planos: INPC + 5,50% a.a.; Meta PGA => CDI + 1,00%
3. O Benchmark da Renda Variável => Ibovespa
4. O Benchmark da Renda Fixa => INPC + 5,50% a.a
5. O Benchmark de Estruturados => CDI + 2% a.a
6. O Benchmark de Empréstimos e Imóveis => INPC + 5,50% a.a

Rentabilidades e Indicadores (Acumulado no ano)

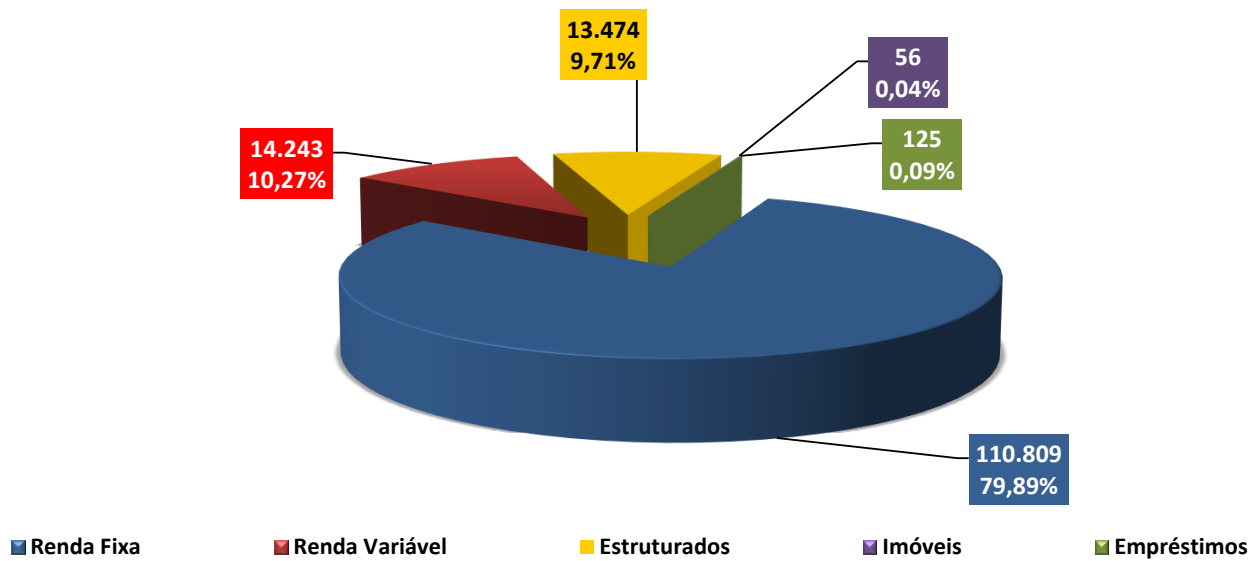


Rentabilidade dos Investimentos em 2020

Alocação (Mil R\$)

Descrição	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Média
Renda Fixa	110.927	110.809											110.809
Renda Variável	15.398	14.243											14.243
Estruturados	13.627	13.474											13.474
Imóveis	56	56											56
Empréstimos	130	125											125
Total	140.137	138.706											138.706

Carteira de Investimentos em Fevereiro de 2020



Histórico de Rentabilidade - Últimos 10 anos

	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	Acum
Segmentos											
Renda Fixa	14,53%	22,61%	3,56%	13,05%	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	9,91%	1,89%	191,59%
Renda Variável	-8,89%	16,25%	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	-6,69%	94,68%
Estruturados	0,00%	0,00%	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	-1,13%	111,82%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	-42,34%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-42,34%
Empréstimos	18,23%	3,03%	35,94%	37,01%	38,36%	9,55%	27,66%	-1,56%	-13,55%	6,70%	298,67%
SIAS	12,05%	21,90%	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	0,71%	187,17%
Indicadores											
CDI	11,60%	8,40%	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	0,67%	133,48%
Poupança	7,45%	6,48%	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	0,52%	77,38%
IBOVESPA	-18,11%	7,40%	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	-9,92%	50,33%
INPC (IBGE)	6,08%	6,20%	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	0,36%	65,86%
INPC + 5,50%	11,91%	12,04%	11,37%	12,07%	17,40%	12,44%	7,68%	9,12%	10,23%	1,26%	170,95%

Rentabilidade acumulada											
	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	
SIAS	12,05%	36,58%	40,72%	56,92%	82,64%	106,57%	127,93%	151,05%	185,15%	187,17%	
INPC + 5,50%	11,91%	25,39%	39,65%	56,50%	83,73%	106,59%	122,45%	142,75%	167,57%	170,95%	
Poupança	7,45%	14,41%	21,06%	29,64%	40,11%	51,75%	61,78%	69,26%	76,47%	77,38%	
CDI	11,60%	20,98%	30,73%	44,88%	64,07%	87,04%	105,65%	118,86%	131,92%	133,48%	

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

