

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).

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS

Fevereiro de 2022



ÍNDICE

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS	01
GESTÃO INTERNA x EXTERNA	01
ALOCAÇÃO	02
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	03
HISTÓRICO DE RENTABILIDADE	04

Carteira de Investimentos

Valores em R\$

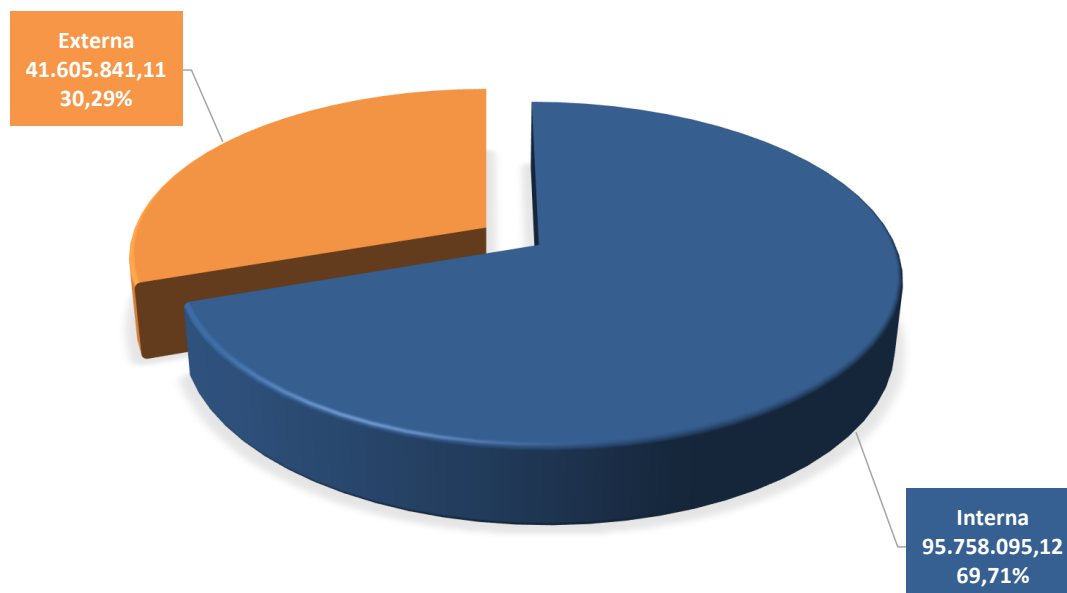
Descrição	25/02/2022			31/12/2021		
	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
RENDA FIXA	103.622.725,73	100,0	75,4	103.385.221,34	100,0	75,9
Títulos Públicos Federais	94.063.800,06	90,8	68,5	85.332.637,57	82,5	62,7
Quotas de Fundos de Investimentos	9.558.925,67	9,2	7,0	18.052.583,77	17,5	13,3
RENDA VARIÁVEL	13.494.459,69	100,0	9,8	12.913.132,11	100,0	9,5
Quotas de Fundos de Investimentos	13.494.459,69	100,0	9,8	12.913.132,11	100,0	9,5
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	18.552.455,75	100,0	13,5	18.057.078,50	100,0	13,3
Quotas de Fundos de Investimentos	18.552.455,75	100,0	13,5	18.057.078,50	100,0	13,3
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	55.660,63	100,0	0,0	55.660,63	100,0	0,0
Direitos de alienações	55.660,63	100,0	0,0	55.660,63	100,0	0,0
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	80.262,72	100,0	0,1	87.877,27	100,0	0,1
Empréstimos	80.262,72	100,0	0,1	87.877,27	100,0	0,1
OUTROS	1.558.371,71	100,0	1,1	1.558.371,71	100,0	1,1
IR a recuperar	1.558.371,71	100,0	1,1	1.558.371,71	100,0	1,1
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	137.363.936,23		100,0	136.057.341,56		99,9
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	4.962,60		0,0	88.514,55		0,1
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	137.368.898,83		100,0	136.145.856,11		100,0

Gestão Interna x Externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	94.063.800,06	98,23%		0,00%	94.063.800,06	68,48%
Quotas Fundos de Investimentos de RF		0,00%	9.558.925,67	22,97%	9.558.925,67	6,96%
Quotas Fundos de Investimentos de RV		0,00%	13.494.459,69	32,43%	13.494.459,69	9,82%
Investimentos Estruturados		0,00%	18.552.455,75	44,59%	18.552.455,75	13,51%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,06%		0,00%	55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	80.262,72	0,08%		0,00%	80.262,72	0,06%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,63%		0,00%	1.558.371,71	1,13%
Total	95.758.095,12	100,00%	41.605.841,11	100,00%	137.363.936,23	100,00%

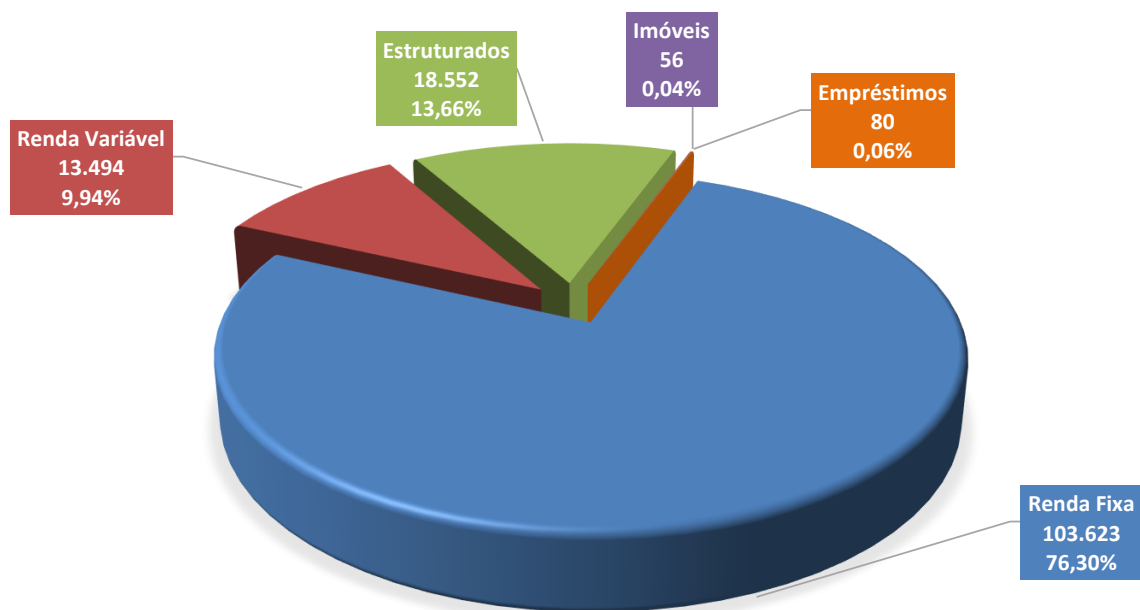
GESTÃO INTERNA X EXTERNA



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											103.495
Renda Variável	13.735	13.494											13.615
Estruturados	18.273	18.552											18.413
Imóveis	56	56											56
Empréstimos	84	80											82
Total	135.515	135.806											135.660

Carteira de Investimentos - Fevereiro/2022



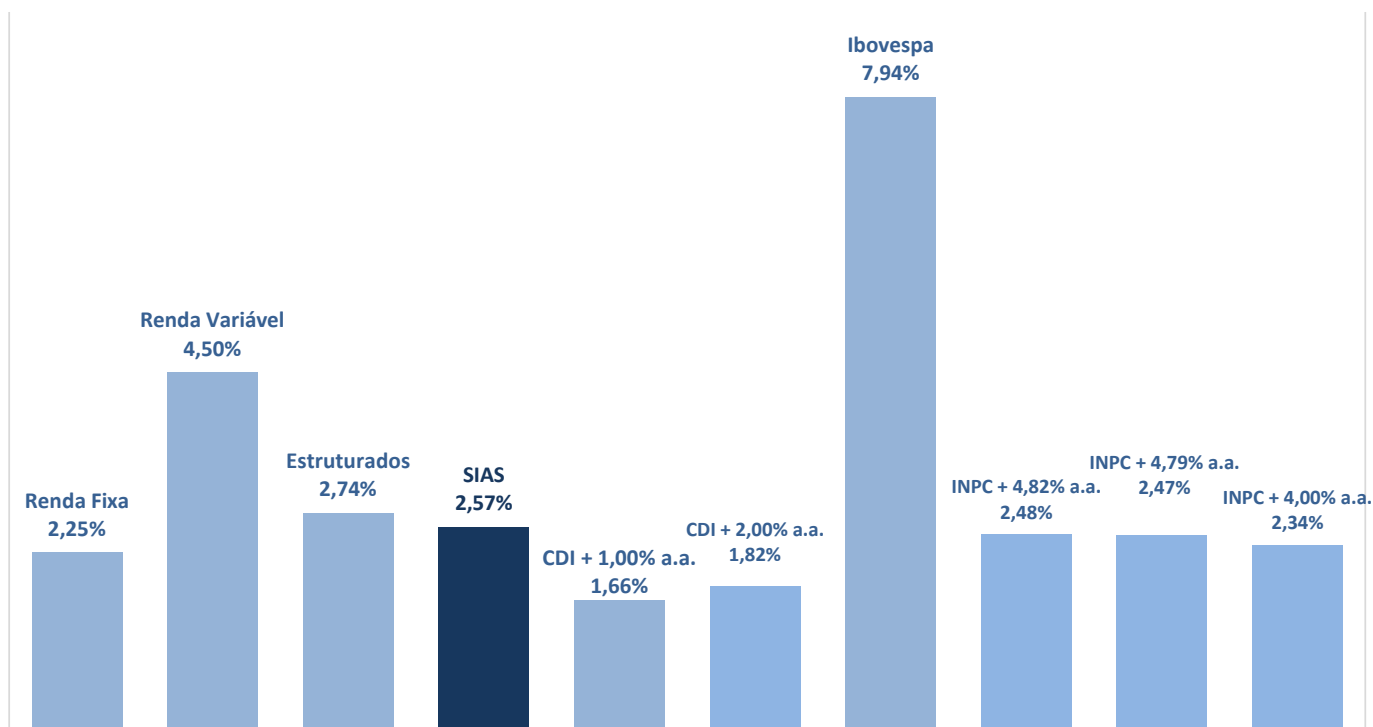
Rentabilidade dos Investimentos em 2022

Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
Renda Fixa	1,10%	1,13%											2,25%
Renda Variável	6,37%	-1,75%											4,50%
Estruturados	1,20%	1,53%											2,74%
Imóveis	0,00%	0,00%											0,00%
Empréstimos	-2,40%	15,62%											12,85%
SIAS	1,65%	0,91%											2,57%
CLT	1,66%	0,90%											2,57%
RJU	1,64%	0,92%											2,57%
PREVSIAS	1,62%	0,89%											2,52%
PGA	1,66%	0,90%											2,57%
INPC + 4,82% a.a.	1,07%	1,40%											2,48%
INPC + 4,79% a.a.	1,06%	1,39%											2,47%
INPC + 4,00% a.a.	1,00%	1,33%											2,34%
CDI + 1,00% a.a.	0,82%	0,83%											1,66%
CDI + 2,00% a.a.	0,90%	0,92%											1,82%
INPC	0,67%	1,00%											1,68%
IPCA	0,54%	1,01%											1,56%
Ibovespa	6,98%	0,89%											7,94%
CDI	0,73%	0,75%											1,49%
Poupança	0,56%	0,50%											1,06%
IFIX	-0,99%	-1,29%											-2,27%
IMA-B	-0,73%	0,54%											-0,19%

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
Segmentos										
Renda Fixa	3,56%	13,05%	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	9,91%	10,41%	12,99%	2,25%
Renda Variável	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-18,98%	4,50%
Estruturados	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	4,62%	2,74%
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%	12,85%
SIAS	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	2,57%
Indicadores										
CDI	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	4,40%	1,49%
Poupança	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	2,99%	1,06%
IBOVESPA	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-11,93%	7,94%
INPC	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	10,16%	1,68%
CDI +1,00%	9,14%	11,92%	14,35%	15,14%	11,04%	7,48%	7,03%	3,79%	5,43%	1,66%
Índice INPC +4,00%	9,80%	10,49%	15,69%	10,83%	6,10%	7,54%	8,68%	9,65%	14,55%	2,34%
Índice INPC +4,79%	10,64%	11,34%	16,56%	11,66%	6,90%	8,35%	9,51%	10,48%	15,42%	2,47%
Índice INPC +4,82%	10,67%	11,37%	16,60%	11,70%	6,93%	8,38%	9,54%	10,51%	15,45%	2,48%

Rentabilidade acumulada										
	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%	156,78%
CDI	8,06%	19,76%	35,62%	54,61%	69,99%	80,91%	91,70%	97,01%	105,67%	108,73%
Poupança	5,81%	13,31%	22,46%	32,64%	41,41%	47,95%	54,24%	57,50%	62,20%	63,93%
CDI +1,00%	9,14%	22,15%	39,68%	60,82%	78,57%	91,93%	105,42%	113,21%	124,80%	128,52%
INPC +4,00%	9,80%	21,33%	40,36%	55,56%	65,05%	77,49%	92,89%	111,50%	142,27%	147,95%
INPC +4,79%	10,64%	23,18%	43,59%	60,33%	71,39%	85,70%	103,35%	124,66%	159,29%	165,70%
INPC +4,82%	10,67%	23,25%	43,71%	60,52%	71,64%	86,02%	103,76%	125,17%	159,96%	166,40%

Evolução - Rentabilidade x Meta atuarial x Indicadores de mercado

