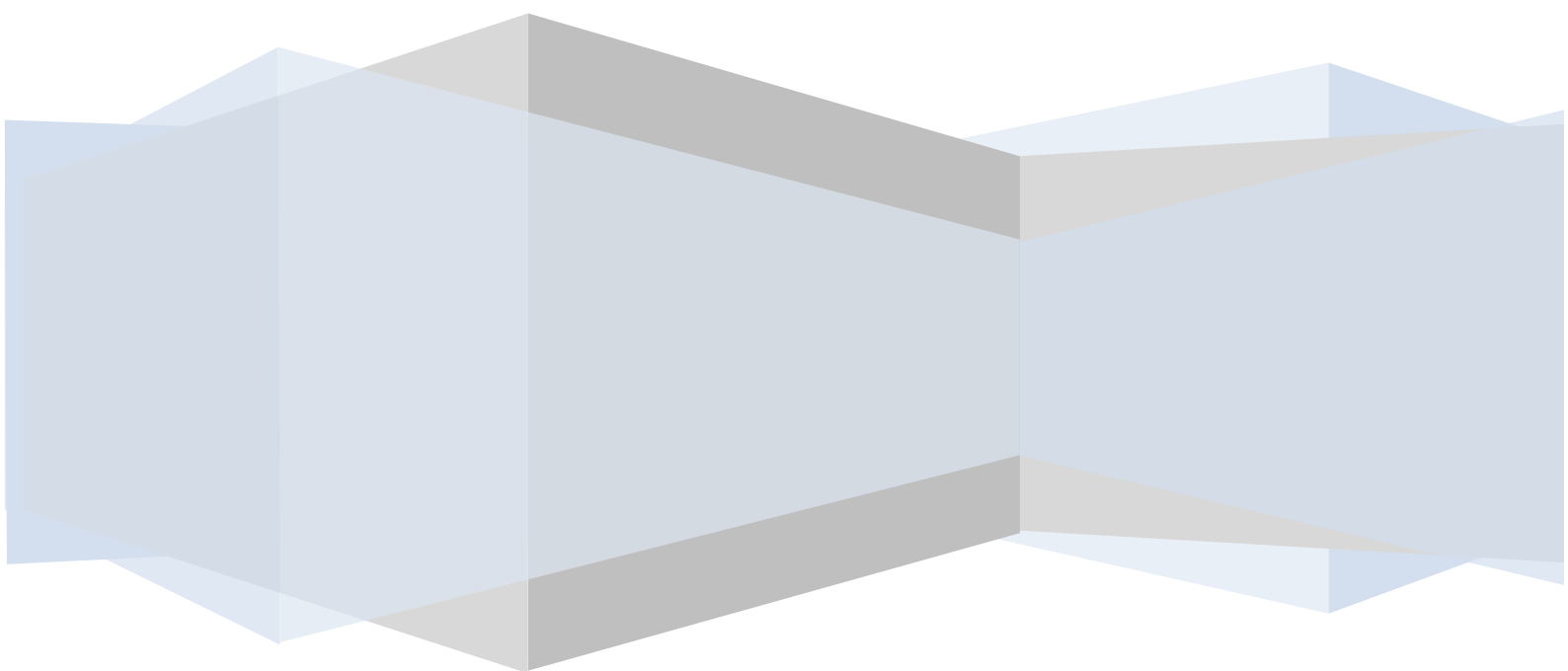




Demonstrativo de Investimentos

Julho/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\$

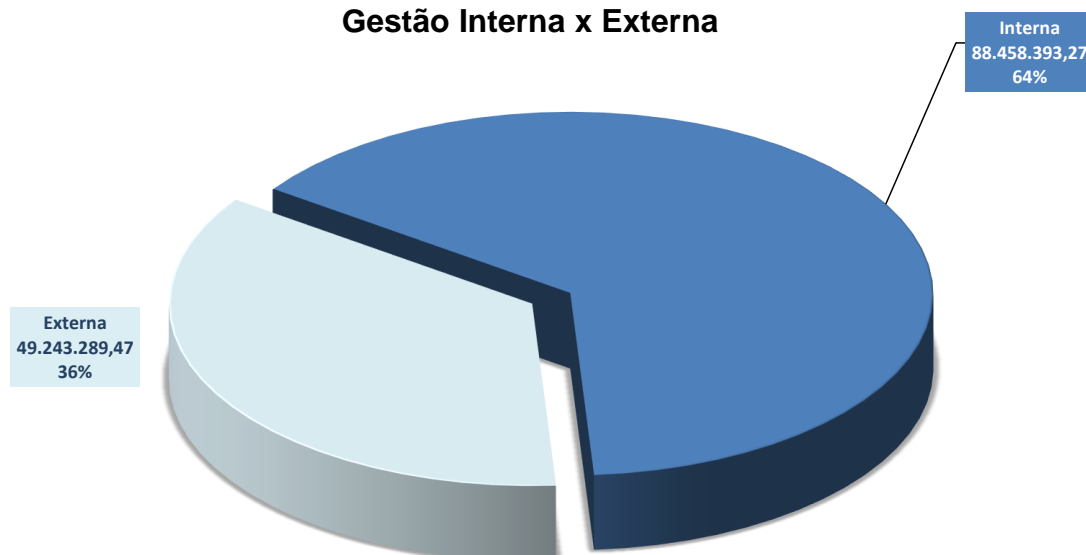
Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
Renda Fixa	109.909.556,50	100,0	79,8
Títulos Públicos Federais	86.734.058,21	78,9	63,0
Quotas de Fundos de Investimentos	23.175.498,29	21,1	16,8
Renda Variável	14.110.591,40	100,0	10,2
Quotas de Fundos de Investimentos	14.110.591,40	100,0	10,2
Investimentos Estruturados	11.957.199,78	100,0	8,7
Quotas de Fundos de Investimentos	11.957.199,78	100,0	8,7
Investimentos Imobiliários	55.660,63	100,0	0,0
Direitos de alienações	55.660,63	100,0	0,0
Empréstimos e Financiamentos	110.302,72	100,0	0,1
Outros	1.558.371,71	100,0	1,1
Total dos Investimentos	137.701.682,74		100,0
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	19.339,12		0,0
Total dos Recursos Garantidores	137.721.021,86		100,0

Gestão interna x externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	86.734.058,21	98,05%			86.734.058,21	62,99%
Carteira de Títulos Privados	0,00	0,00%			0,00	0,00%
Quotas Fundos de Investimentos de RF			23.175.498,29	47,06%	23.175.498,29	16,83%
Quotas Fundos de Investimentos de RV			14.110.591,40	28,65%	14.110.591,40	10,25%
Investimentos Estruturados			11.957.199,78	24,28%	11.957.199,78	8,68%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,06%			55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	110.302,72	0,12%			110.302,72	0,08%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,76%			1.558.371,71	1,13%
Total	88.458.393,27	100,00%	49.243.289,47	100,00%	137.701.682,74	100,00%

Gestão Interna x Externa



Rentabilidade dos Investimentos em 2020

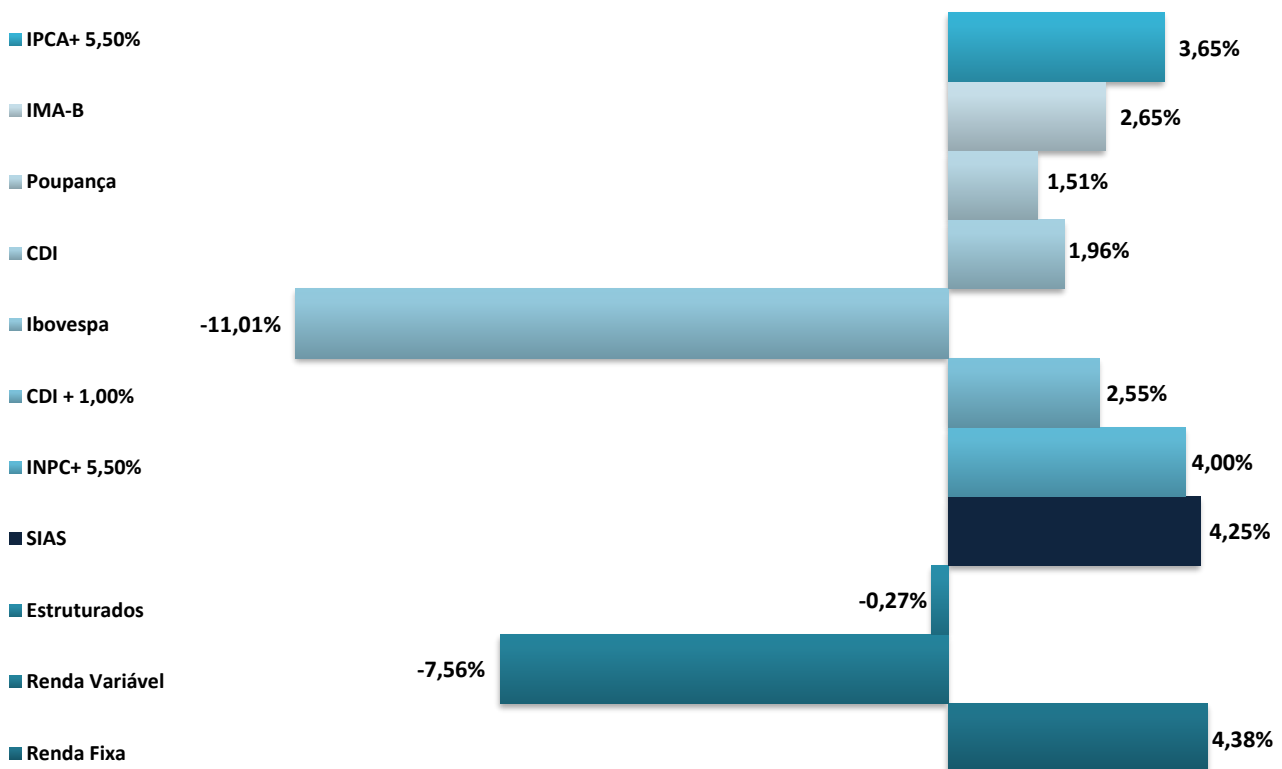
Rentabilidade

Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
Renda Fixa	1,35%	0,53%	0,76%	0,39%	0,06%	0,41%	0,81%						4,38%
Renda Variável	0,87%	-7,50%	-34,22%	13,51%	9,32%	10,46%	9,88%						-7,56%
Estruturados	-0,01%	-1,12%	-3,89%	0,89%	1,07%	1,06%	1,85%						-0,27%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%						0,00%
Empréstimos	-3,12%	10,14%	-3,23%	-3,98%	-3,91%	-4,68%	7,45%						-2,43%
SIAS	1,16%	-0,45%	-2,15%	1,47%	0,95%	1,41%	1,85%						4,25%
INPC+ 5,50%	0,64%	0,62%	0,63%	0,22%	0,20%	0,75%	0,89%						4,00%
CDI + 1,00%	0,46%	0,38%	0,42%	0,37%	0,32%	0,30%	0,28%						2,55%
INPC	0,19%	0,17%	0,18%	-0,23%	-0,25%	0,30%	0,44%						0,80%
IPCA	0,21%	0,25%	0,07%	-0,31%	-0,38%	0,26%	0,36%						0,46%
Ibovespa	-1,63%	-8,43%	-29,90%	10,25%	8,57%	8,76%	8,27%						-11,01%
CDI	0,38%	0,29%	0,34%	0,28%	0,24%	0,22%	0,19%						1,96%
Poupança	0,26%	0,26%	0,24%	0,22%	0,22%	0,17%	0,13%						1,51%
IPCA+ 5,50%	0,66%	0,70%	0,52%	0,14%	0,07%	0,71%	0,81%						3,65%
IMA-B	0,26%	0,45%	-6,97%	1,31%	1,52%	2,05%	4,39%						2,65%
Bench. RF Planos	0,64%	0,62%	0,63%	0,22%	0,20%	0,75%	0,89%						4,00%

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)

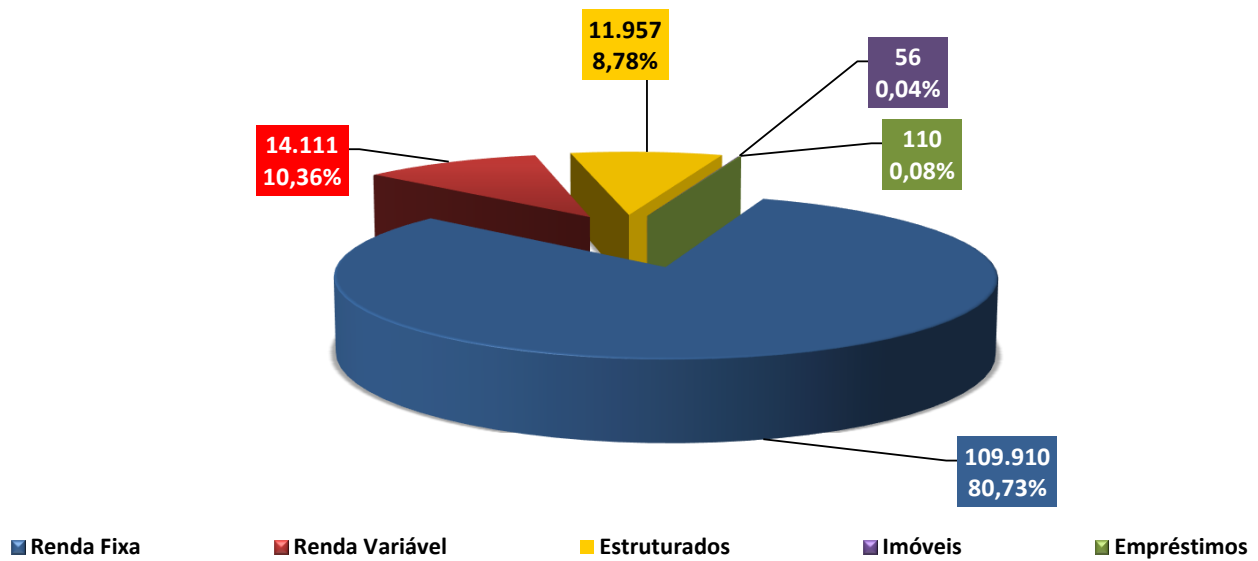


Rentabilidade dos Investimentos em 2020

Alocação (Mil R\$)

Descrição	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Média
Renda Fixa	110.927	110.809	111.065	111.330	110.366	110.611	109.910						110.717
Renda Variável	15.398	14.243	9.369	10.635	11.626	12.842	14.111						12.603
Estruturados	13.627	13.474	12.949	13.064	13.204	12.037	11.957						12.902
Imóveis	56	56	56	56	56	56	56						56
Empréstimos	130	125	119	114	109	104	110						116
Total	140.137	138.706	133.558	135.199	135.361	135.649	136.143						136.393

Carteira de Investimentos em Julho 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%	4,38%	198,72%
Renda Variável	-8,89%	16,25%	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	-7,56%	92,87%
Estruturados	0,00%	0,00%	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	-0,27%	113,65%
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%	-2,43%	264,58%
SIAS	12,05%	21,90%	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	4,25%	197,28%
Indicadores											
CDI	11,60%	8,40%	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	1,96%	136,46%
Poupança	7,45%	6,48%	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	1,51%	79,13%
IBOVESPA	-18,11%	7,40%	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	-11,01%	48,51%
INPC(IBGE)	6,08%	6,20%	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	0,80%	66,59%
INPC + 5,50%	11,91%	12,04%	11,37%	12,07%	17,40%	12,44%	7,68%	9,12%	10,23%	4,00%	178,27%

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%	197,28%	
INPC + 5,50%	11,91%	25,39%	39,65%	56,50%	83,73%	106,59%	122,45%	142,75%	167,57%	178,27%	
Poupança	7,45%	14,41%	21,06%	29,64%	40,11%	51,75%	61,78%	69,26%	76,47%	79,13%	
CDI	11,60%	20,98%	30,73%	44,88%	64,07%	87,04%	105,65%	118,86%	131,92%	136,46%	

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

