

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

Junho 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\$

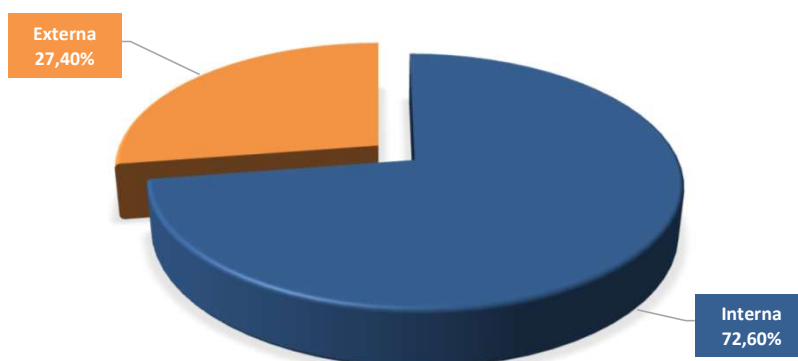
Descrição	30/06/2022			31/12/2021		
	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
RENDA FIXA	105.050.670,72	100,0	75,6	103.385.221,34	100,0	75,9
Títulos Públicos Federais	99.070.130,67	94,3	71,3	85.332.637,57	82,5	62,7
Tes. Nac. - NTN-B 2022	3.262.020,62	3,1	2,3	3.103.777,29	3,0	2,3
Tes. Nac. - NTN-B 2022	2.732.470,10	2,6	2,0	2.587.242,17	2,5	1,9
Tes. Nac. - NTN-B 2022	6.678.226,97	6,4	4,8	6.322.433,00	6,1	4,6
Tes. Nac. - NTN-B 2022	3.288.406,26	3,1	2,4	3.092.229,46	3,0	2,3
Tes. Nac. - NTN-B 2024	4.891.608,94	4,7	3,5	4.654.151,66	4,5	3,4
Tes. Nac. - NTN-B 2024	8.398.295,47	8,0	6,0	7.943.478,83	7,7	5,8
Tes. Nac. - NTN-B 2024	7.763.864,87	7,4	5,6	7.342.544,25	7,1	5,4
Tes. Nac. - NTN-B 2030	6.887.102,70	6,6	5,0	6.513.825,35	6,3	4,8
Tes. Nac. - NTN-B 2035	18.815.617,97	17,9	13,5	17.800.464,93	17,2	13,1
Tes. Nac. - NTN-B 2040	2.010.369,36	1,9	1,4	1.909.802,24	1,8	1,4
Tes. Nac. - NTN-B 2040	3.859.959,84	3,7	2,8	3.655.497,01	3,5	2,7
Tes. Nac. - NTN-B 2045	8.959.821,84	8,5	6,5	-	0,0	0,0
Tes. Nac. - NTN-B 2050	9.739.962,80	9,3	7,0	9.243.592,48	8,9	6,8
Tes. Nac. - NTN-B 2050	3.377.860,41	3,2	2,4	3.202.447,27	3,1	2,4
Tes. Nac. - NTN-B 2050	2.365.962,69	2,3	1,7	2.241.917,15	2,2	1,6
Tes. Nac. - NTN-B 2050	3.849.955,19	3,7	2,8	3.646.703,59	3,5	2,7
Tes. Nac. - NTN-B 2050	2.188.624,64	2,1	1,6	2.072.530,89	2,0	1,5
Quotas de Fundos de Investimentos	5.980.540,05	5,7	4,3	18.052.583,77	17,5	13,3
RENDA VARIÁVEL	11.551.992,40	100,0	8,3	12.913.132,11	100,0	9,5
Quotas de Fundos de Investimentos	11.551.992,40	100,0	8,3	12.913.132,11	100,0	9,5
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20.501.505,73	100,0	14,8	18.057.078,50	100,0	13,3
Quotas de Fundos de Investimentos	20.501.505,73	100,0	14,8	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	68.103,10	100,0	0,0	87.877,27	100,0	0,1
Empréstimos	68.103,10	100,0	0,0	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	138.786.304,29		99,9	136.057.341,56		99,9
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	86.579,23		0,1	88.514,55		0,1
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	138.872.883,52		100,0	136.145.856,11		100,0

Gestão Interna x Externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	99.070.130,67	98,33%		0,00%	99.070.130,67	71,38%
Quotas Fundos de Investimentos de RF		0,00%	5.980.540,05	15,72%	5.980.540,05	4,31%
Quotas Fundos de Investimentos de RV		0,00%	11.551.992,40	30,37%	11.551.992,40	8,32%
Investimentos Estruturados		0,00%	20.501.505,73	53,90%	20.501.505,73	14,77%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,06%		0,00%	55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	68.103,10	0,07%		0,00%	68.103,10	0,05%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,55%		0,00%	1.558.371,71	1,12%
Total	100.752.266,11	100,00%	38.034.038,18	100,00%	138.786.304,29	100,00%

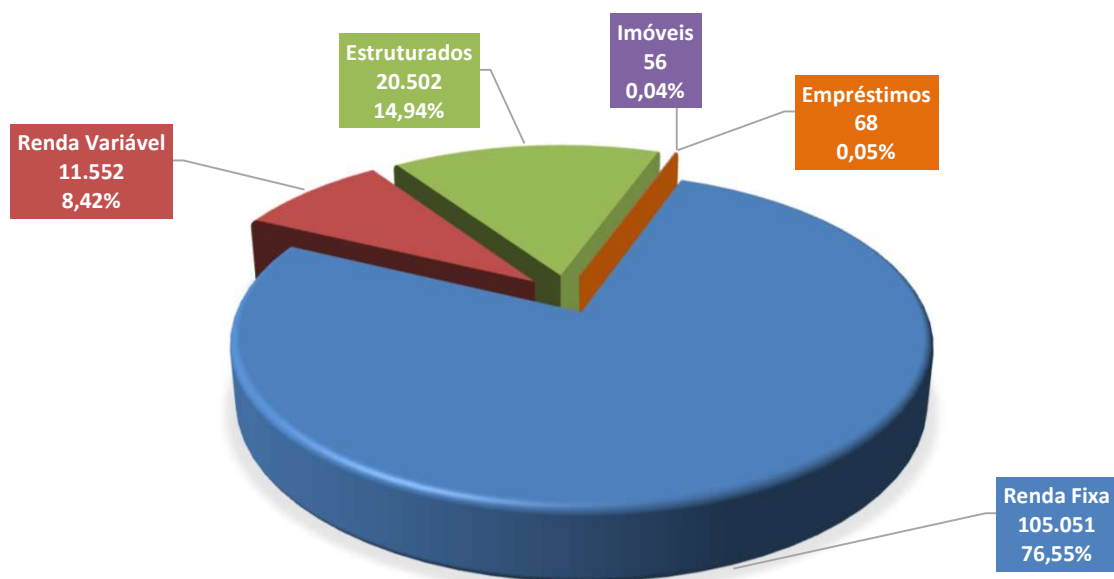
GESTÃO INTERNA X EXTERNA



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	104.073	104.503	105.166	105.051							104.297
Renda Variável	13.735	13.494	14.199	12.829	12.890	11.552							13.116
Estruturados	18.273	18.552	19.475	19.945	20.312	20.502							19.510
Imóveis	56	56	56	56	56	56							56
Empréstimos	84	80	77	77	71	68							76
Total	135.515	135.806	137.879	137.409	138.495	137.228							137.055

Carteira de Investimentos - Junho/2022



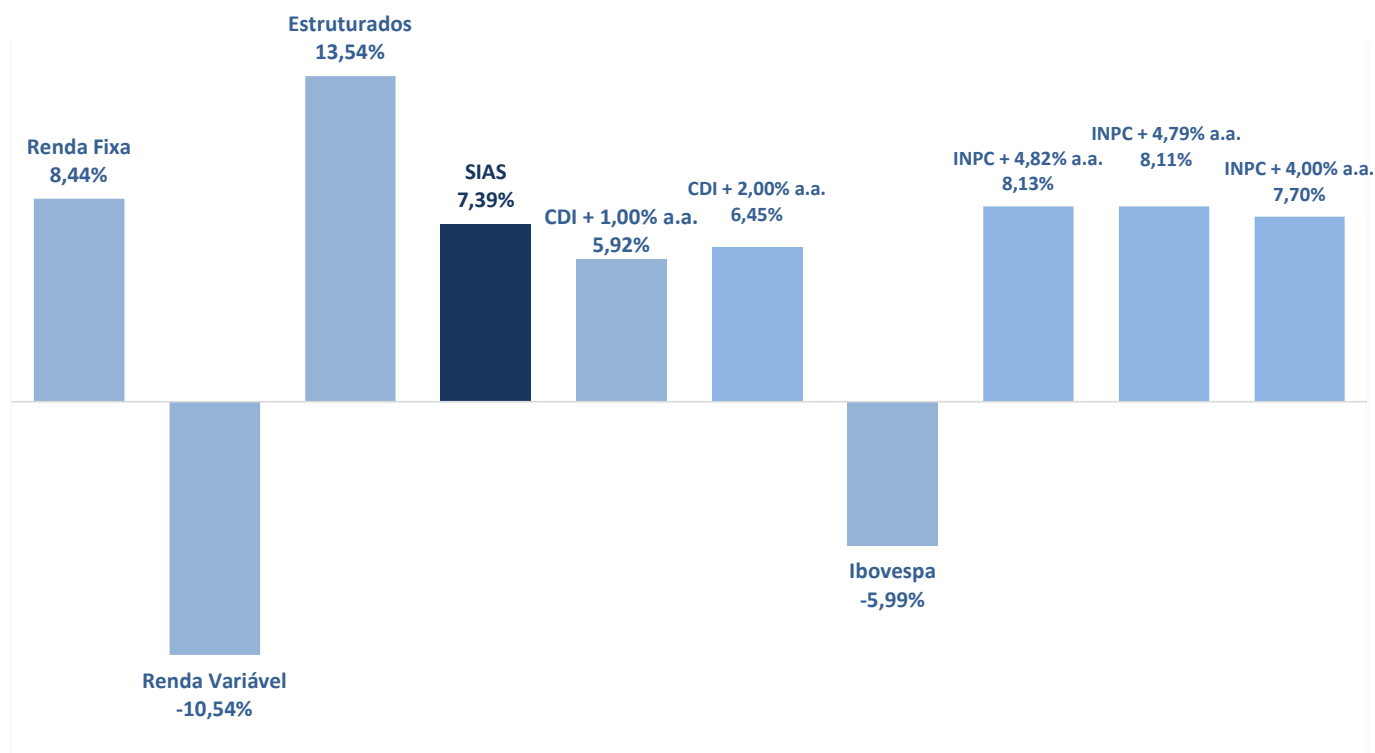
Rentabilidade dos Investimentos em 2022

Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
Renda Fixa	1,10%	1,13%	1,73%	1,72%	1,46%	1,02%							8,44%
Renda Variável	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%	-10,38%							-10,54%
Estruturados	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%	0,93%							13,54%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%							0,00%
Empréstimos	-2,40%	15,62%	-2,18%	-2,13%	-1,49%	-1,58%							4,75%
SIAS	1,65%	0,91%	2,52%	0,76%	1,42%	-0,06%							7,39%
CLT	1,66%	0,90%	2,55%	0,75%	1,42%	-0,06%							7,41%
RJU	1,64%	0,92%	2,53%	0,77%	1,42%	-0,06%							7,42%
PREVSIAS	1,62%	0,89%	2,53%	0,64%	1,42%	-0,07%							7,22%
PGA	1,66%	0,90%	2,55%	0,75%	1,42%	-0,06%							7,41%
INPC + 4,82% a.a.	1,07%	1,40%	2,11%	1,44%	0,84%	1,02%							8,13%
INPC + 4,79% a.a.	1,06%	1,39%	2,11%	1,43%	0,84%	1,01%							8,11%
INPC + 4,00% a.a.	1,00%	1,33%	2,04%	1,37%	0,78%	0,95%							7,70%
CDI + 1,00% a.a.	0,82%	0,83%	1,01%	0,92%	1,11%	1,09%							5,92%
CDI + 2,00% a.a.	0,90%	0,92%	1,09%	1,00%	1,20%	1,18%							6,45%
INPC	0,67%	1,00%	1,71%	1,04%	0,45%	0,62%							5,61%
IPCA	0,54%	1,01%	1,62%	1,06%	0,47%	0,67%							5,49%
Ibovespa	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%							-5,99%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%							5,40%
Poupança	0,56%	0,50%	0,60%	0,56%	0,67%	0,65%							3,59%
IFIX	-0,99%	-1,29%	1,42%	1,19%	0,26%	-0,88%							-0,33%
IMA-B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%							4,35%

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%	8,44%
Renda Variável	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-18,98%	-10,54%
Estruturados	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	4,62%	13,54%
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%	4,75%
SIAS	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	7,39%
Indicadores										
CDI	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	4,40%	5,40%
Poupança	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	2,99%	3,59%
IBOVESPA	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-11,93%	-5,99%
INPC	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	10,16%	5,61%
CDI +1,00%	9,14%	11,92%	14,35%	15,14%	11,04%	7,48%	7,03%	3,79%	5,43%	5,92%
Índice INPC +4,00%	9,80%	10,49%	15,69%	10,83%	6,10%	7,54%	8,68%	9,65%	14,55%	7,70%
Índice INPC +4,79%	10,64%	11,34%	16,56%	11,66%	6,90%	8,35%	9,51%	10,48%	15,42%	8,11%
Índice INPC +4,82%	10,67%	11,37%	16,60%	11,70%	6,93%	8,38%	9,54%	10,51%	15,45%	8,13%

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%	168,83%
CDI	8,06%	19,76%	35,62%	54,61%	69,99%	80,91%	91,70%	97,01%	105,67%	116,77%
Poupança	5,81%	13,31%	22,46%	32,64%	41,41%	47,95%	54,24%	57,50%	62,20%	68,02%
CDI +1,00%	9,14%	22,15%	39,68%	60,82%	78,57%	91,93%	105,42%	113,21%	124,80%	138,11%
INPC +4,00%	9,80%	21,33%	40,36%	55,56%	65,05%	77,49%	92,89%	111,50%	142,27%	160,94%
INPC +4,79%	10,64%	23,18%	43,59%	60,33%	71,39%	85,70%	103,35%	124,66%	159,29%	180,33%
INPC +4,82%	10,67%	23,25%	43,71%	60,52%	71,64%	86,02%	103,76%	125,17%	159,96%	181,09%

Evolução - Rentabilidade x Meta atuarial x Indicadores de mercado

