

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

Maio 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\$

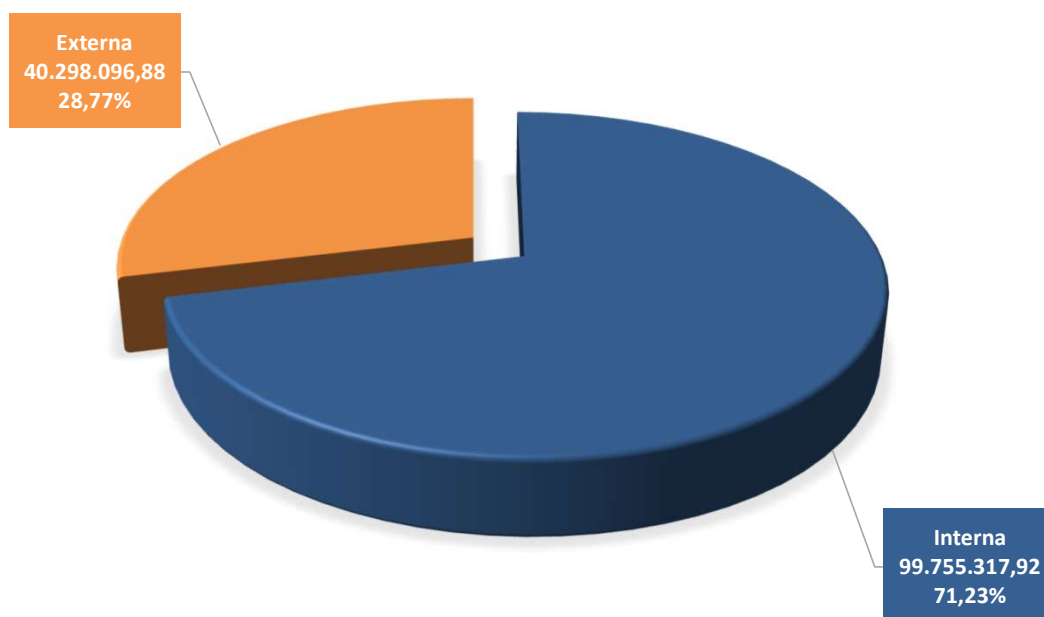
Descrição	31/05/2022			31/12/2021		
	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
RENDA FIXA	105.166.199,45	100,0	75,1	103.385.221,34	100,0	75,9
Títulos Públicos Federais	98.070.059,72	93,3	70,0	85.332.637,57	82,5	62,7
Quotas de Fundos de Investimentos	7.096.139,73	6,7	5,1	18.052.583,77	17,5	13,3
RENDA VARIÁVEL	12.889.718,25	100,0	9,2	12.913.132,11	100,0	9,5
Quotas de Fundos de Investimentos	12.889.718,25	100,0	9,2	12.913.132,11	100,0	9,5
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	20.312.238,90	100,0	14,5	18.057.078,50	100,0	13,3
Quotas de Fundos de Investimentos	20.312.238,90	100,0	14,5	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	71.225,86	100,0	0,1	87.877,27	100,0	0,1
Empréstimos	71.225,86	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	140.053.414,80		100,0	136.057.341,56		99,9
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	46.497,51		0,0	88.514,55		0,1
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	140.099.912,31		100,0	136.145.856,11		100,0

Gestão Interna x Externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	98.070.059,72	98,31%		0,00%	98.070.059,72	70,02%
Quotas Fundos de Investimentos de RF		0,00%	7.096.139,73	17,61%	7.096.139,73	5,07%
Quotas Fundos de Investimentos de RV		0,00%	12.889.718,25	31,99%	12.889.718,25	9,20%
Investimentos Estruturados		0,00%	20.312.238,90	50,40%	20.312.238,90	14,50%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,06%		0,00%	55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	71.225,86	0,07%		0,00%	71.225,86	0,05%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,56%		0,00%	1.558.371,71	1,11%
Total	99.755.317,92	100,00%	40.298.096,88	100,00%	140.053.414,80	100,00%

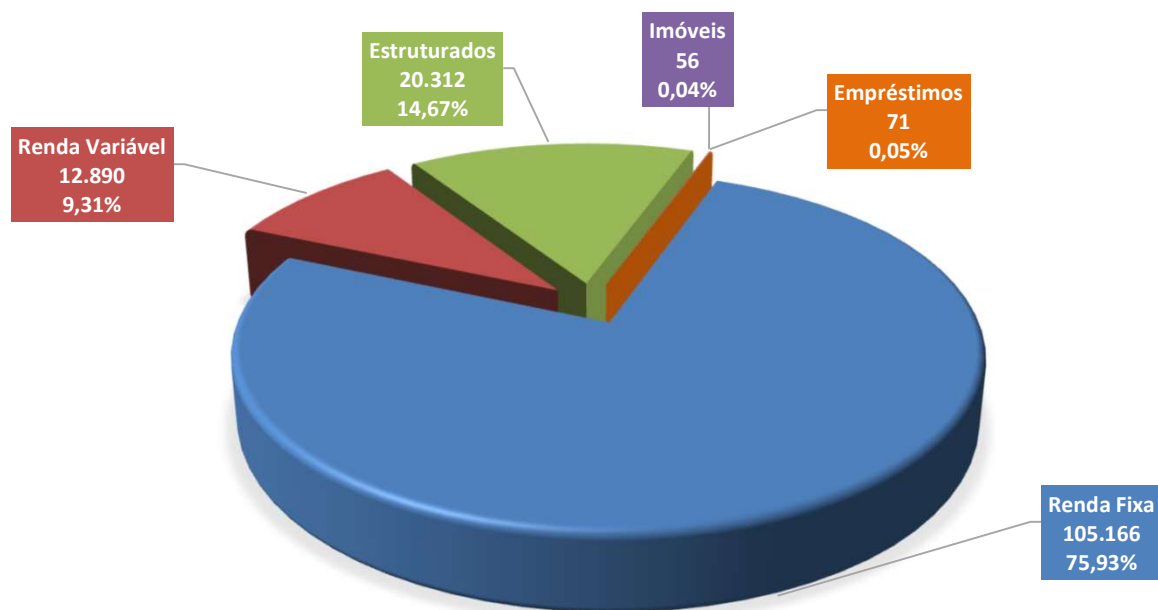
GESTÃO INTERNA X EXTERNA



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								104.146
Renda Variável	13.735	13.494	14.199	12.829	12.890								13.429
Estruturados	18.273	18.552	19.475	19.945	20.312								19.312
Imóveis	56	56	56	56	56								56
Empréstimos	84	80	77	74	71								77
Total	135.515	135.806	137.879	137.406	138.495								137.020

Carteira de Investimentos - Maio/2022



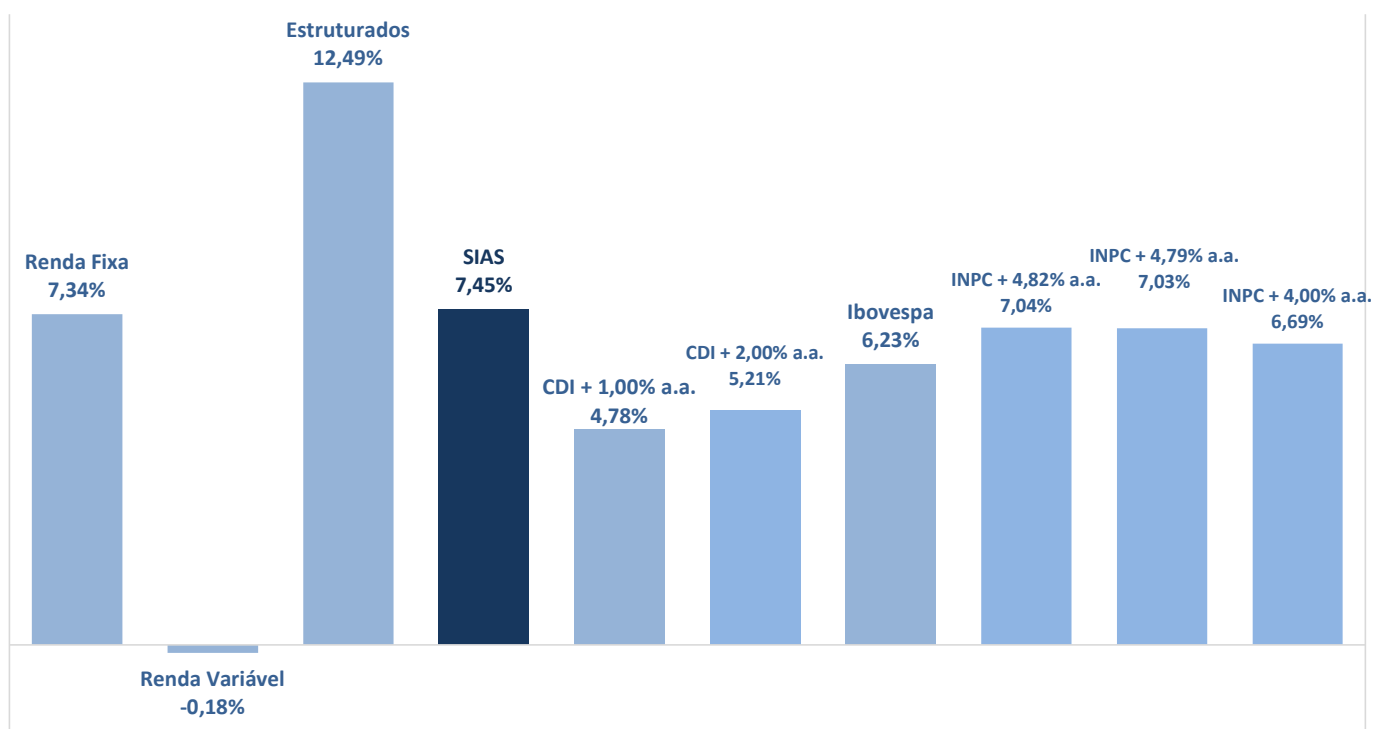
Rentabilidade dos Investimentos em 2022

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%								7,34%
Renda Variável	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%								-0,18%
Estruturados	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%								12,49%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%								0,00%
Empréstimos	-2,40%	15,62%	-2,18%	-2,13%	-1,49%								6,43%
SIAS	1,65%	0,91%	2,52%	0,76%	1,42%								7,45%
CLT	1,66%	0,90%	2,55%	0,75%	1,42%								7,48%
RJU	1,64%	0,92%	2,53%	0,77%	1,42%								7,48%
PREVSIAS	1,62%	0,89%	2,53%	0,64%	1,42%								7,30%
PGA	1,66%	0,90%	2,55%	0,75%	1,42%								7,48%
INPC + 4,82% a.a.	1,07%	1,40%	2,11%	1,44%	0,84%								7,04%
INPC + 4,79% a.a.	1,06%	1,39%	2,11%	1,43%	0,84%								7,03%
INPC + 4,00% a.a.	1,00%	1,33%	2,04%	1,37%	0,78%								6,69%
CDI + 1,00% a.a.	0,82%	0,83%	1,01%	0,92%	1,11%								4,78%
CDI + 2,00% a.a.	0,90%	0,92%	1,09%	1,00%	1,20%								5,21%
INPC	0,67%	1,00%	1,71%	1,04%	0,45%								4,96%
IPCA	0,54%	1,01%	1,62%	1,06%	0,47%								4,78%
Ibovespa	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%								6,23%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%								4,34%
Poupança	0,56%	0,50%	0,60%	0,56%	0,67%								2,92%
IFIX	-0,99%	-1,29%	1,42%	1,19%	0,26%								0,56%
IMA-B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%								4,72%

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%	7,34%
Renda Variável	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-18,98%	-0,18%
Estruturados	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	4,62%	12,49%
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%	6,43%
SIAS	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	7,45%
Indicadores										
CDI	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	4,40%	4,34%
Poupança	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	2,99%	2,92%
IBOVESPA	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-11,93%	6,23%
INPC	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	10,16%	4,96%
CDI +1,00%	9,14%	11,92%	14,35%	15,14%	11,04%	7,48%	7,03%	3,79%	5,43%	4,78%
Índice INPC +4,00%	9,80%	10,49%	15,69%	10,83%	6,10%	7,54%	8,68%	9,65%	14,55%	6,69%
Índice INPC +4,79%	10,64%	11,34%	16,56%	11,66%	6,90%	8,35%	9,51%	10,48%	15,42%	7,03%
Índice INPC +4,82%	10,67%	11,37%	16,60%	11,70%	6,93%	8,38%	9,54%	10,51%	15,45%	7,04%

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%	169,00%
CDI	8,06%	19,76%	35,62%	54,61%	69,99%	80,91%	91,70%	97,01%	105,67%	114,60%
Poupança	5,81%	13,31%	22,46%	32,64%	41,41%	47,95%	54,24%	57,50%	62,20%	66,94%
CDI +1,00%	9,14%	22,15%	39,68%	60,82%	78,57%	91,93%	105,42%	113,21%	124,80%	135,54%
INPC +4,00%	9,80%	21,33%	40,36%	55,56%	65,05%	77,49%	92,89%	111,50%	142,27%	158,48%
INPC +4,79%	10,64%	23,18%	43,59%	60,33%	71,39%	85,70%	103,35%	124,66%	159,29%	177,51%
INPC +4,82%	10,67%	23,25%	43,71%	60,52%	71,64%	86,02%	103,76%	125,17%	159,96%	178,26%

Evolução - Rentabilidade x Meta atuarial x Indicadores de mercado

