

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

Agosto 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	31/08/2022			31/12/2021		
	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
RENDA FIXA	103.441.094,24	100,0	74,2	103.385.221,34	100,0	75,9
Títulos Públicos Federais	81.960.426,81	79,2	58,8	85.332.637,57	82,5	62,7
Quotas de Fundos de Investimentos	21.480.667,43	20,8	15,4	18.052.583,77	17,5	13,3
RENDA VARIÁVEL	13.102.863,91	100,0	9,4	12.913.132,11	100,0	9,5
Quotas de Fundos de Investimentos	13.102.863,91	100,0	9,4	12.913.132,11	100,0	9,5
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	21.062.490,38	100,0	15,1	18.057.078,50	100,0	13,3
Quotas de Fundos de Investimentos	21.062.490,38	100,0	15,1	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	62.381,74	100,0	0,0	87.877,27	100,0	0,1
Empréstimos	62.381,74	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	139.282.862,61		100,0	136.057.341,56		99,9
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	53.362,14		0,0	88.514,55		0,1
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	139.336.224,75		100,0	136.145.856,11		100,0

Gestão Interna x Externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	81.960.426,81	98,00%		0,00%	81.960.426,81	58,84%
Quotas Fundos de Investimentos de RF		0,00%	21.480.667,43	38,60%	21.480.667,43	15,42%
Quotas Fundos de Investimentos de RV		0,00%	13.102.863,91	23,55%	13.102.863,91	9,41%
Investimentos Estruturados		0,00%	21.062.490,38	37,85%	21.062.490,38	15,12%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,07%		0,00%	55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	62.381,74	0,07%		0,00%	62.381,74	0,04%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,86%		0,00%	1.558.371,71	1,12%
Total	83.636.840,89	100,00%	55.646.021,72	100,00%	139.282.862,61	100,00%

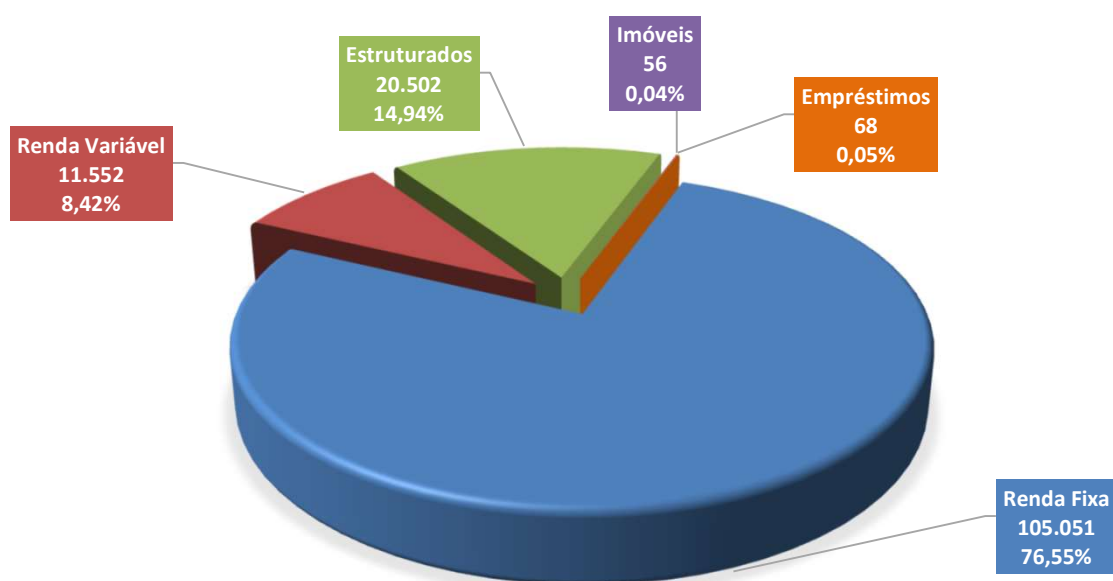
GESTÃO INTERNA X EXTERNA



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	104.665	103.441					104.236
Renda Variável	13.735	13.494	14.199	12.829	12.890	11.552	12.197	13.103					13.000
Estruturados	18.273	18.552	19.475	19.945	20.312	20.502	20.440	21.062					19.820
Imóveis	56	56	56	56	56	56	56	56					56
Empréstimos	84	80	77	74	71	68	65	62					73
Total	135.515	135.806	137.879	137.406	138.495	137.228	137.424	137.724					137.185

Carteira de Investimentos - Agosto/2022



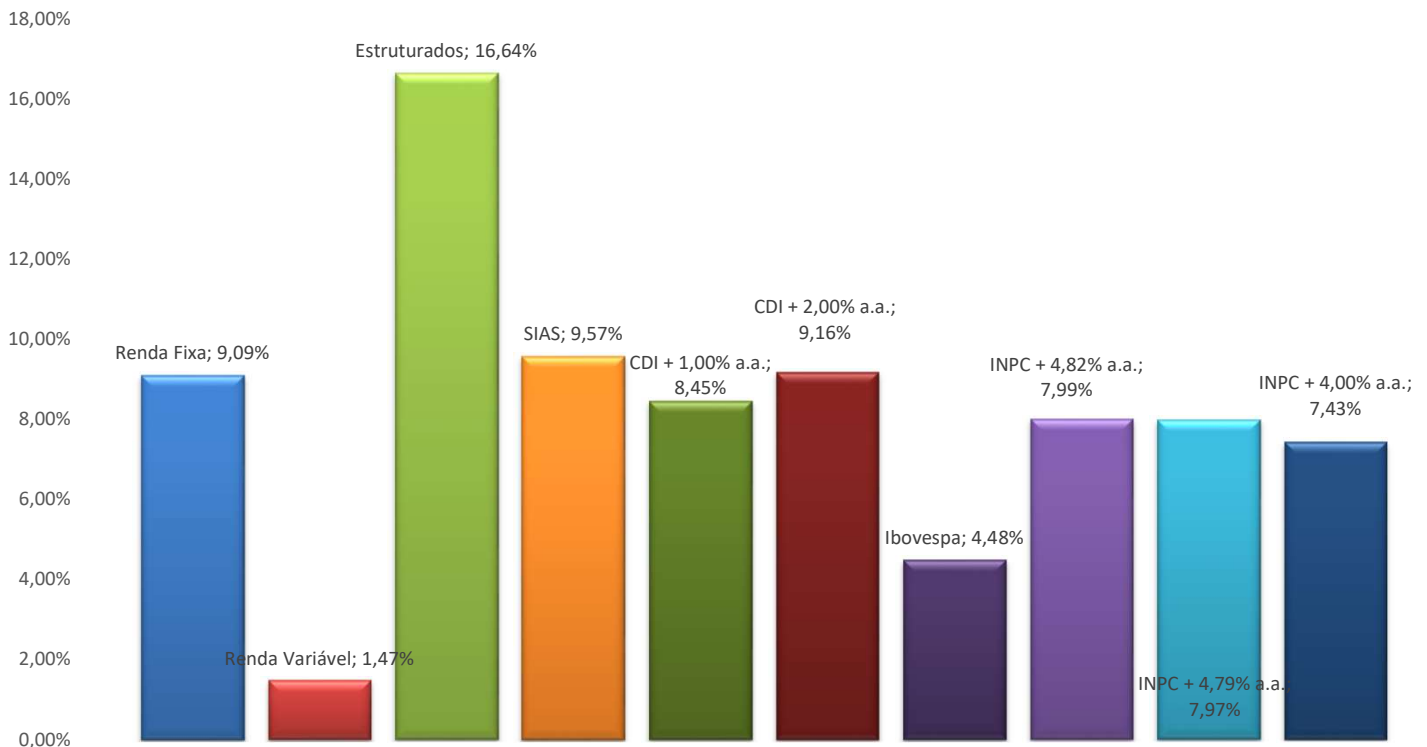
Rentabilidade dos Investimentos em 2022

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%	0,53%	0,07%					9,09%
Renda Variável	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%	-10,38%	5,59%	7,43%					1,47%
Estruturados	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%	0,93%	-0,30%	3,04%					16,64%
Imóveis	0,00%	0,00%	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%	-0,65%	-1,86%					2,13%
SIAS	1,65%	0,91%	2,52%	0,76%	1,42%	-0,06%	0,85%	1,17%					9,57%
CLT	1,65%	0,90%	2,54%	0,75%	1,42%	-0,06%	0,86%	1,24%					9,67%
RJU	1,64%	0,92%	2,53%	0,76%	1,42%	-0,06%	0,85%	1,22%					9,64%
PREVSIAS	1,62%	0,89%	2,53%	0,64%	1,42%	-0,07%	0,82%	1,17%					9,37%
PGA	1,66%	0,90%	2,55%	0,75%	1,42%	-0,06%	0,86%	1,24%					9,69%
INPC + 4,82% a.a.	1,07%	1,40%	2,11%	1,44%	0,84%	1,02%	-0,21%	0,08%					7,99%
INPC + 4,79% a.a.	1,06%	1,39%	2,11%	1,43%	0,84%	1,01%	-0,21%	0,08%					7,97%
INPC + 4,00% a.a.	1,00%	1,33%	2,04%	1,37%	0,78%	0,95%	-0,27%	0,02%					7,43%
CDI + 1,00% a.a.	0,82%	0,83%	1,01%	0,92%	1,11%	1,09%	1,11%	1,25%					8,45%
CDI + 2,00% a.a.	0,90%	0,92%	1,09%	1,00%	1,20%	1,18%	1,20%	1,34%					9,16%
INPC	0,67%	1,00%	1,71%	1,04%	0,45%	0,62%	-0,60%	-0,31%					4,65%
IPCA	0,54%	1,01%	1,62%	1,06%	0,47%	0,67%	-0,68%	-0,36%					4,39%
Ibovespa	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%					4,48%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%					7,73%
Poupança	0,56%	0,50%	0,60%	0,56%	0,67%	0,65%	0,66%	0,74%					5,04%
IFIX	-0,99%	-1,29%	1,42%	1,19%	0,26%	-0,88%	0,66%	5,76%					6,11%
IMA-B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%	-0,88%	1,10%					4,56%

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%	9,09%
Renda Variável	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-18,98%	1,47%
Estruturados	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	4,62%	16,64%
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%	2,13%
SIAS	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	9,57%
Indicadores										
CDI	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	4,40%	7,73%
Poupança	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	2,99%	5,04%
IBOVESPA	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-11,93%	4,48%
INPC	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	10,16%	4,65%
CDI +1,00%	9,14%	11,92%	14,35%	15,14%	11,04%	7,48%	7,03%	3,79%	5,43%	8,45%
Índice INPC +4,00%	9,80%	10,49%	15,69%	10,83%	6,10%	7,54%	8,68%	9,65%	14,55%	7,43%
Índice INPC +4,79%	10,64%	11,34%	16,56%	11,66%	6,90%	8,35%	9,51%	10,48%	15,42%	7,97%
Índice INPC +4,82%	10,67%	11,37%	16,60%	11,70%	6,93%	8,38%	9,54%	10,51%	15,45%	7,99%

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%	174,30%
CDI	8,06%	19,76%	35,62%	54,61%	69,99%	80,91%	91,70%	97,01%	105,67%	121,56%
Poupança	5,81%	13,31%	22,46%	32,64%	41,41%	47,95%	54,24%	57,50%	62,20%	70,38%
CDI +1,00%	9,14%	22,15%	39,68%	60,82%	78,57%	91,93%	105,42%	113,21%	124,80%	143,78%
INPC +4,00%	9,80%	21,33%	40,36%	55,56%	65,05%	77,49%	92,89%	111,50%	142,27%	160,26%
INPC +4,79%	10,64%	23,18%	43,59%	60,33%	71,39%	85,70%	103,35%	124,66%	159,29%	179,95%
INPC +4,82%	10,67%	23,25%	43,71%	60,52%	71,64%	86,02%	103,76%	125,17%	159,96%	180,73%

Evolução - Rentabilidade x Meta atuarial x Indicadores de mercado

