

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](http://www.sias.org.br)).

# DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS

Outubro de 2022



# ÍNDICE

---

<i>CARTEIRA DE INVESTIMENTOS — CLT</i>	.....	<b>01</b>
<i>CARTEIRA DE INVESTIMENTOS — RJU</i>	.....	<b>02</b>
<i>CARTEIRA DE INVESTIMENTOS — PREVSIA S</i>	.....	<b>03</b>
<i>CARTEIRA DE INVESTIMENTOS — PGA</i>	.....	<b>04</b>
<i>RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS</i>	.....	<b>05</b>
<i>HISTÓRICO DE RENTABILIDADE</i>	.....	<b>07</b>

# Carteira de Investimentos CLT

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
<b>RENDA FIXA</b>	<b>28.764.499,94</b>	<b>100,0</b>	<b>72,4</b>
Títulos Públicos Federais	24.069.621,53	83,7	60,6
Quotas de Fundos de Investimentos	4.694.878,41	16,3	11,8
<b>RENDA VARIÁVEL</b>	<b>4.076.905,85</b>	<b>100,0</b>	<b>10,3</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	4.076.905,85	100,0	10,3
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	<b>6.330.693,92</b>	<b>100,0</b>	<b>15,9</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	6.330.693,92	100,0	15,9
<b>INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>16.051,88</b>	<b>100,0</b>	<b>0,0</b>
Valores a Receber	16.051,88	100,0	0,0
Direitos de alienações	16.051,88	100,0	0,0
<b>EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS</b>	<b>13.863,35</b>	<b>577,3</b>	<b>0,0</b>
Empréstimos e Financiamentos	13.863,35	100,0	0,0
Valores a receber	46.945,74	338,6	0,1
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	(33.082,39)	-238,6	-0,1
<b>OUTROS</b>	<b>418.433,65</b>	<b>100,0</b>	<b>1,1</b>
IR a recuperar	418.433,65	100,0	1,1
<b>TOTAL DOS INVESTIMENTOS</b>	<b>39.620.448,59</b>		<b>99,8</b>
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	84.235,45		0,2
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>	<b>39.704.684,04</b>		<b>100,0</b>

## Carteira de Investimentos RJU

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
<b>RENDA FIXA</b>	<b>54.963.649,73</b>	<b>100,0</b>	<b>73,2</b>
Títulos Públicos Federais	44.231.148,01	80,5	58,9
Quotas de Fundos de Investimentos	10.732.501,72	19,5	14,3
<b>RENDA VARIÁVEL</b>	<b>7.469.742,28</b>	<b>100,0</b>	<b>10,0</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	7.469.742,28	100,0	10,0
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	<b>11.599.152,36</b>	<b>100,0</b>	<b>15,5</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	11.599.152,36	100,0	15,5
<b>INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>29.697,71</b>	<b>100,0</b>	<b>0,0</b>
Valores a Receber	29.697,71	100,0	0,0
Direitos de alienações	29.697,71	100,0	0,0
<b>EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS</b>	<b>43.400,37</b>	<b>21345,3</b>	<b>0,1</b>
Empréstimos e Financiamentos	43.400,37	100,0	0,1
Valores a receber	4.653.662,32	10722,6	6,2
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	(4.610.261,95)	-10622,6	-6,1
<b>OUTROS</b>	<b>774.147,41</b>	<b>100,0</b>	<b>1,0</b>
IR a recuperar	774.147,41	100,0	1,0
<b>TOTAL DOS INVESTIMENTOS</b>	<b>74.879.789,86</b>		<b>99,8</b>
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	159.397,21		0,2
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>	<b>75.039.187,07</b>		<b>100,0</b>

## Carteira de Investimentos PREVSIAS

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
<b>RENDA FIXA</b>	<b>6.374.419,54</b>	<b>100,0</b>	<b>73,3</b>
Títulos Públicos Federais	4.523.914,87	71,0	52,0
Quotas de Fundos de Investimentos	1.850.504,67	29,0	21,3
<b>RENDA VARIÁVEL</b>	<b>866.281,38</b>	<b>100,0</b>	<b>10,0</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	866.281,38	100,0	10,0
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	<b>1.345.177,56</b>	<b>100,0</b>	<b>15,5</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	1.345.177,56	100,0	15,5
<b>INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>3.457,10</b>	<b>100,0</b>	<b>0,0</b>
Valores a Receber	3.457,10	100,0	0,0
Direitos de alienações	3.457,10	100,0	0,0
<b>EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS</b>	<b>-</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
Empréstimos e Financiamentos	-	0,0	0,0
Valores a receber	-	0,0	0,0
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	-	0,0	0,0
<b>OUTROS</b>	<b>91.339,93</b>	<b>100,0</b>	<b>1,0</b>
IR a recuperar	91.339,93	100,0	1,0
<b>TOTAL DOS INVESTIMENTOS</b>	<b>8.680.675,51</b>		<b>99,8</b>
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	18.603,83		0,2
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>	<b>8.699.279,34</b>		<b>100,0</b>

## Carteira de Investimentos PGA

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
<b>RENDA FIXA</b>	<b>12.476.863,36</b>	<b>100,0</b>	<b>74,4</b>
Títulos Públicos Federais	9.717.538,10	77,9	57,9
Quotas de Fundos de Investimentos	2.759.325,26	22,1	16,4
<b>RENDA VARIÁVEL</b>	<b>1.656.840,66</b>	<b>100,0</b>	<b>9,9</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	1.656.840,66	100,0	9,9
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	<b>2.572.772,46</b>	<b>100,0</b>	<b>15,3</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	2.572.772,46	100,0	15,3
<b>INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>6.453,94</b>	<b>100,0</b>	<b>0,0</b>
Valores a Receber	6.453,94	100,0	0,0
Direitos de alienações	6.453,94	100,0	0,0
<b>EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS</b>	<b>-</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>
Empréstimos e Financiamentos	-	0,0	0,0
Valores a receber	-	0,0	0,0
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	-	0,0	0,0
<b>OUTROS</b>	<b>274.450,72</b>	<b>100,0</b>	<b>1,6</b>
IR a recuperar	274.450,72	100,0	1,6
<b>TOTAL DOS INVESTIMENTOS</b>	<b>16.987.381,14</b>		<b>101,2</b>
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	(206.743,03)		-1,2
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>	<b>16.780.638,11</b>		<b>100,0</b>

## Rentabilidade dos Investimentos em 2022

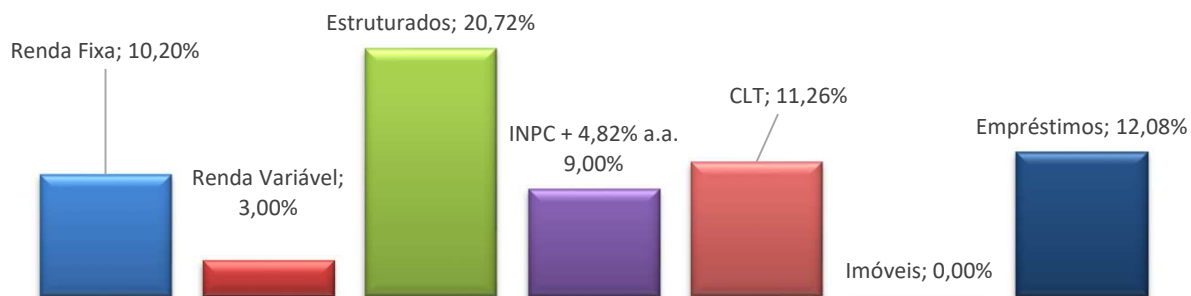
Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
<b>CLT</b>	<b>1,65%</b>	<b>0,90%</b>	<b>2,54%</b>	<b>0,75%</b>	<b>1,42%</b>	<b>-0,06%</b>	<b>0,86%</b>	<b>1,24%</b>	<b>0,75%</b>	<b>0,70%</b>			<b>11,26%</b>
Renda Fixa	1,10%	1,13%	1,73%	1,72%	1,46%	1,02%	0,53%	0,07%	0,38%	0,63%			10,20%
Renda Variável	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%	-10,38%	5,59%	7,43%	-0,07%	1,58%			3,00%
Estruturados	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%	0,93%	-0,30%	3,04%	2,97%	0,51%			20,72%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%			0,00%
Empréstimos	1,18%	1,15%	1,15%	1,15%	1,15%	1,15%	1,14%	1,14%	1,14%	1,13%			12,08%
<b>RJU</b>	<b>1,64%</b>	<b>0,92%</b>	<b>2,53%</b>	<b>0,76%</b>	<b>1,42%</b>	<b>-0,06%</b>	<b>0,85%</b>	<b>1,22%</b>	<b>0,74%</b>	<b>0,71%</b>			<b>11,24%</b>
Renda Fixa	1,10%	1,13%	1,73%	1,72%	1,46%	1,02%	0,53%	0,07%	0,38%	0,64%			10,21%
Renda Variável	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%	-10,38%	5,59%	7,43%	-0,07%	1,58%			3,00%
Estruturados	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%	0,93%	-0,30%	3,04%	2,97%	0,51%			20,72%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%			0,00%
Empréstimos	-3,17%	19,00%	-2,98%	-2,94%	-2,17%	-2,29%	-1,14%	-2,70%	0,07%	-3,11%			-3,27%
<b>PREVSIAS</b>	<b>1,62%</b>	<b>0,89%</b>	<b>2,53%</b>	<b>0,64%</b>	<b>1,42%</b>	<b>-0,07%</b>	<b>0,82%</b>	<b>1,17%</b>	<b>0,74%</b>	<b>0,74%</b>			<b>10,99%</b>
Renda Fixa	1,10%	1,13%	1,73%	1,72%	1,46%	1,02%	0,53%	0,07%	0,38%	0,68%			10,26%
Renda Variável	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%	-10,38%	5,59%	7,43%	-0,07%	1,58%			3,00%
Estruturados	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%	0,93%	-0,30%	3,04%	2,97%	0,51%			20,72%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%			0,00%
<b>PGA</b>	<b>1,66%</b>	<b>0,90%</b>	<b>2,55%</b>	<b>0,75%</b>	<b>1,42%</b>	<b>-0,06%</b>	<b>0,86%</b>	<b>1,24%</b>	<b>0,75%</b>	<b>0,72%</b>			<b>11,31%</b>
Renda Fixa	1,10%	1,13%	1,73%	1,72%	1,46%	1,02%	0,53%	0,07%	0,38%	0,65%			10,22%
Renda Variável	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%	-10,38%	5,59%	7,43%	-0,07%	1,58%			3,00%
Estruturados	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%	0,93%	-0,30%	3,04%	2,97%	0,51%			20,72%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%			0,00%
<b>INPC + 4,82% a.a.</b>	<b>1,07%</b>	<b>1,40%</b>	<b>2,11%</b>	<b>1,44%</b>	<b>0,84%</b>	<b>1,02%</b>	<b>-0,21%</b>	<b>0,08%</b>	<b>0,07%</b>	<b>0,86%</b>			<b>9,00%</b>
<b>INPC + 4,79% a.a.</b>	<b>1,06%</b>	<b>1,39%</b>	<b>2,11%</b>	<b>1,43%</b>	<b>0,84%</b>	<b>1,01%</b>	<b>-0,21%</b>	<b>0,08%</b>	<b>0,07%</b>	<b>0,86%</b>			<b>8,98%</b>
<b>INPC + 4,00% a.a.</b>	<b>1,00%</b>	<b>1,33%</b>	<b>2,04%</b>	<b>1,37%</b>	<b>0,78%</b>	<b>0,95%</b>	<b>-0,27%</b>	<b>0,02%</b>	<b>0,01%</b>	<b>0,80%</b>			<b>8,29%</b>
<b>CDI + 1,00% a.a.</b>	<b>0,82%</b>	<b>0,83%</b>	<b>1,01%</b>	<b>0,92%</b>	<b>1,11%</b>	<b>1,09%</b>	<b>1,11%</b>	<b>1,25%</b>	<b>1,15%</b>	<b>1,10%</b>			<b>10,91%</b>
CDI + 2,00% a.a.	0,90%	0,92%	1,09%	1,00%	1,20%	1,18%	1,20%	1,34%	1,24%	1,19%			11,82%
INPC	0,67%	1,00%	1,71%	1,04%	0,45%	0,62%	-0,60%	-0,31%	-0,32%	0,47%			4,81%
IPCA	0,54%	1,01%	1,62%	1,06%	0,47%	0,67%	-0,68%	-0,36%	-0,29%	0,59%			4,70%
Ibovespa	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%	0,47%	5,45%			10,69%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%			9,99%
Poupança	0,56%	0,50%	0,60%	0,56%	0,67%	0,65%	0,66%	0,74%	0,68%	0,65%			6,44%
IFIX	-0,99%	-1,29%	1,42%	1,19%	0,26%	-0,88%	0,66%	5,76%	0,49%	0,02%			6,65%
IMA-B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%	-0,88%	1,10%	1,48%	1,23%			7,42%

### Observações:

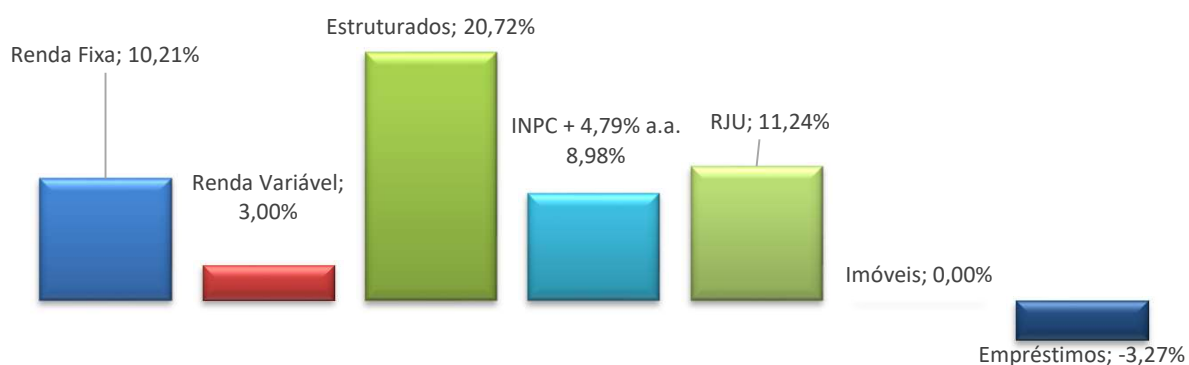
1. A rentabilidade do Plano PREVSIAS reflete a variação da cota do Plano, a qual leva em consideração a dedução da taxa de administração.
2. Benchmark = referência de rentabilidade. Definidos na Política de Investimentos 2022-2026.
3. Meta Atuarial => Plano CLT: INPC + 4,82% a.a.; Plano RJU: INPC + 4,79% 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 dos Investimentos em 2022

### CLT - Rentabilidade em 2022



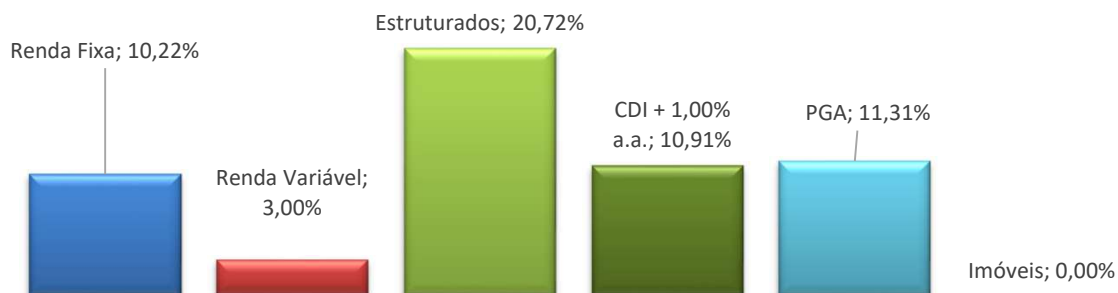
### RJU - Rentabilidade em 2022



### PREVSIAS - Rentabilidade em 2022



### PGA - Rentabilidade em 2022





## Histórico de Rentabilidade - Últimos 10 anos

	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
<b>Segmentos</b>										
Renda Fixa	3,56%	13,05%	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	9,91%	10,41%	12,99%	10,20%
Renda Variável	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-18,98%	3,00%
Estruturados	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	4,62%	20,72%
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%	12,08%
CLT	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	11,26%
RJU	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	11,24%
PREVSIAS	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	10,99%
PGA	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	11,31%
<b>Indicadores</b>										
CDI	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	4,40%	9,99%
Poupança	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	2,99%	6,44%
IBOVESPA	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-11,93%	10,69%
INPC	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	10,16%	4,81%
CDI +1,00%	9,14%	11,92%	14,35%	15,14%	11,04%	7,48%	7,03%	3,79%	5,43%	10,91%
Índice INPC +4,00%	9,80%	10,49%	15,69%	10,83%	6,10%	7,54%	8,68%	9,65%	14,55%	8,29%
Índice INPC +4,79%	10,64%	11,34%	16,56%	11,66%	6,90%	8,35%	9,51%	10,48%	15,42%	8,98%
Índice INPC +4,82%	10,67%	11,37%	16,60%	11,70%	6,93%	8,38%	9,54%	10,51%	15,45%	9,00%

<b>Rentabilidade acumulada</b>										
	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
CLT	3,03%	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	178,54%
RJU	3,03%	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	178,48%
PREVSIAS	3,03%	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	177,87%
PGA	3,03%	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	178,65%
CDI	8,06%	19,76%	35,62%	54,61%	69,99%	80,91%	91,70%	97,01%	105,67%	126,22%
Poupança	5,81%	13,31%	22,46%	32,64%	41,41%	47,95%	54,24%	57,50%	62,20%	72,66%
CDI +1,00%	9,14%	22,15%	39,68%	60,82%	78,57%	91,93%	105,42%	113,21%	124,80%	149,32%
INPC +4,00%	9,80%	21,33%	40,36%	55,56%	65,05%	77,49%	92,89%	111,50%	142,27%	162,36%
INPC +4,79%	10,64%	23,18%	43,59%	60,33%	71,39%	85,70%	103,35%	124,66%	159,29%	182,57%
INPC +4,82%	10,67%	23,25%	43,71%	60,52%	71,64%	86,02%	103,76%	125,17%	159,96%	183,36%

### Evolução - Rentabilidade x Meta atuarial x Indicadores de mercado

