

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

Novembro de 2022



ÍNDICE

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

Carteira de Investimentos CLT

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
RENDA FIXA	28.260.413,90	100,0	72,9
Títulos Públicos Federais	24.086.399,69	85,2	62,1
Quotas de Fundos de Investimentos	4.174.014,21	14,8	10,8
RENDA VARIÁVEL	3.721.987,78	100,0	9,6
Quotas de Fundos de Investimentos	3.721.987,78	100,0	9,6
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	6.289.152,54	100,0	16,2
Quotas de Fundos de Investimentos	6.289.152,54	100,0	16,2
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	16.051,88	100,0	0,0
Valores a Receber	16.051,88	100,0	0,0
Direitos de alienações	16.051,88	100,0	0,0
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	13.147,19	603,5	0,0
Empréstimos e Financiamentos	13.147,19	100,0	0,0
Valores a receber	46.245,85	351,8	0,1
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	(33.098,66)	-251,8	-0,1
OUTROS	463.372,55	100,0	1,2
IR a recuperar	463.372,55	100,0	1,2
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	38.764.125,84		100,0
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	1.861,13		0,0
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	38.765.986,97		100,0

Carteira de Investimentos RJU

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
RENDA FIXA	54.591.627,51	100,0	74,1
Títulos Públicos Federais	44.259.213,62	81,1	60,1
Quotas de Fundos de Investimentos	10.332.413,89	18,9	14,0
RENDA VARIÁVEL	6.819.458,32	100,0	9,3
Quotas de Fundos de Investimentos	6.819.458,32	100,0	9,3
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	11.523.039,90	100,0	15,6
Quotas de Fundos de Investimentos	11.523.039,90	100,0	15,6
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	29.697,71	100,0	0,0
Valores a Receber	29.697,71	100,0	0,0
Direitos de alienações	29.697,71	100,0	0,0
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	40.862,84	22672,0	0,1
Empréstimos e Financiamentos	40.862,84	100,0	0,1
Valores a receber	4.652.639,78	11386,0	6,3
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	(4.611.776,94)	-11286,0	-6,3
OUTROS	662.664,47	100,0	0,9
IR a recuperar	662.664,47	100,0	0,9
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	73.667.350,75		100,0
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	1.261,31		0,0
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	73.668.612,06		100,0

Carteira de Investimentos PREVSIAS

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
RENTA FIXA	6.465.889,52	100,0	73,8
Títulos Públicos Federais	4.537.655,70	70,2	51,8
Quotas de Fundos de Investimentos	1.928.233,82	29,8	22,0
RENTA VARIÁVEL	790.866,60	100,0	9,0
Quotas de Fundos de Investimentos	790.866,60	100,0	9,0
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	1.336.350,65	100,0	15,3
Quotas de Fundos de Investimentos	1.336.350,65	100,0	15,3
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	3.457,10	100,0	0,0
Valores a Receber	3.457,10	100,0	0,0
Direitos de alienações	3.457,10	100,0	0,0
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	-	0,0	0,0
Empréstimos e Financiamentos	-	0,0	0,0
Valores a receber	-	0,0	0,0
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	-	0,0	0,0
OUTROS	160.259,04	100,0	1,8
IR a recuperar	160.259,04	100,0	1,8
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	8.756.822,91		100,0
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	1.801,48		0,0
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	8.758.624,39		100,0

Carteira de Investimentos PGA

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
RENDA FIXA	12.051.229,11	100,0	73,5
Títulos Públicos Federais	9.725.280,36	80,7	59,3
Quotas de Fundos de Investimentos	2.325.948,75	19,3	14,2
RENDA VARIÁVEL	1.512.603,15	100,0	9,2
Quotas de Fundos de Investimentos	1.512.603,15	100,0	9,2
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	2.555.890,19	100,0	15,6
Quotas de Fundos de Investimentos	2.555.890,19	100,0	15,6
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	6.453,94	100,0	0,0
Valores a Receber	6.453,94	100,0	0,0
Direitos de alienações	6.453,94	100,0	0,0
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	-	0,0	0,0
Empréstimos e Financiamentos	-	0,0	0,0
Valores a receber	-	0,0	0,0
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	-	0,0	0,0
OUTROS	272.075,65	100,0	1,7
IR a recuperar	272.075,65	100,0	1,7
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	16.398.252,04		100,0
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	(7.815,31)		0,0
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	16.390.436,73		100,0

Rentabilidade dos Investimentos em 2022

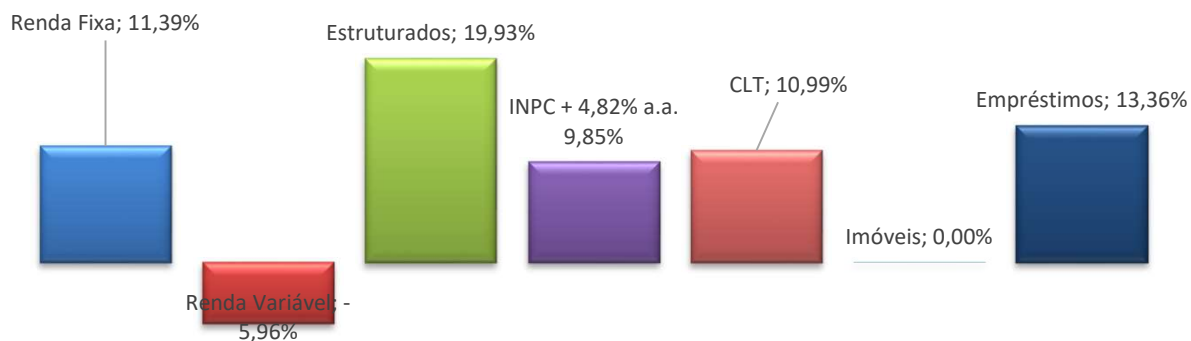
Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
CLT	1,65%	0,90%	2,54%	0,75%	1,42%	-0,06%	0,86%	1,24%	0,75%	0,70%	-0,24%		10,99%
Renda Fixa	1,10%	1,13%	1,73%	1,72%	1,46%	1,02%	0,53%	0,07%	0,38%	0,63%	1,08%		11,39%
Renda Variável	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%	-10,38%	5,59%	7,43%	-0,07%	1,58%	-8,71%		-5,96%
Estruturados	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%	0,93%	-0,30%	3,04%	2,97%	0,51%	-0,66%		19,93%
Imóveis	0,00%	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%	1,14%		13,36%
RJU	1,64%	0,92%	2,53%	0,76%	1,42%	-0,06%	0,85%	1,22%	0,74%	0,71%	-0,19%		11,03%
Renda Fixa	1,10%	1,13%	1,73%	1,72%	1,46%	1,02%	0,53%	0,07%	0,38%	0,64%	1,08%		11,40%
Renda Variável	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%	-10,38%	5,59%	7,43%	-0,07%	1,58%	-8,71%		-5,96%
Estruturados	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%	0,93%	-0,30%	3,04%	2,97%	0,51%	-0,66%		19,93%
Imóveis	0,00%	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%	10,41%		6,80%
PREVSIAS	1,62%	0,89%	2,53%	0,64%	1,42%	-0,07%	0,82%	1,17%	0,74%	0,74%	-0,19%		10,78%
Renda Fixa	1,10%	1,13%	1,73%	1,72%	1,46%	1,02%	0,53%	0,07%	0,38%	0,68%	1,06%		11,43%
Renda Variável	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%	-10,38%	5,59%	7,43%	-0,07%	1,58%	-8,71%		-5,96%
Estruturados	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%	0,93%	-0,30%	3,04%	2,97%	0,51%	-0,66%		19,93%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%		0,00%
PGA	1,66%	0,90%	2,55%	0,75%	1,42%	-0,06%	0,86%	1,24%	0,75%	0,72%	-0,19%		11,09%
Renda Fixa	1,10%	1,13%	1,73%	1,72%	1,46%	1,02%	0,53%	0,07%	0,38%	0,65%	1,07%		11,41%
Renda Variável	6,37%	-1,75%	5,22%	-9,65%	0,48%	-10,38%	5,59%	7,43%	-0,07%	1,58%	-8,71%		-5,96%
Estruturados	1,20%	1,53%	4,97%	2,41%	1,84%	0,93%	-0,30%	3,04%	2,97%	0,51%	-0,66%		19,93%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%		0,00%
INPC + 4,82% a.a.	1,07%	1,40%	2,11%	1,44%	0,84%	1,02%	-0,21%	0,08%	0,07%	0,86%	0,77%		9,85%
INPC + 4,79% a.a.	1,06%	1,39%	2,11%	1,43%	0,84%	1,01%	-0,21%	0,08%	0,07%	0,86%	0,77%		9,82%
INPC + 4,00% a.a.	1,00%	1,33%	2,04%	1,37%	0,78%	0,95%	-0,27%	0,02%	0,01%	0,80%	0,71%		9,06%
CDI + 1,00% a.a.	0,82%	0,83%	1,01%	0,92%	1,11%	1,09%	1,11%	1,25%	1,15%	1,10%	1,10%		12,13%
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%	1,19%		13,15%
INPC	0,67%	1,00%	1,71%	1,04%	0,45%	0,62%	-0,60%	-0,31%	-0,32%	0,47%	0,38%		5,21%
IPCA	0,54%	1,01%	1,62%	1,06%	0,47%	0,67%	-0,68%	-0,36%	-0,29%	0,59%	0,41%		5,13%
Ibovespa	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%	0,47%	5,45%	-3,06%		7,31%
CDI	0,73%	0,75%	0,92%	0,83%	1,03%	1,01%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%		11,11%
Poupança	0,56%	0,50%	0,60%	0,56%	0,67%	0,65%	0,66%	0,74%	0,68%	0,65%	0,65%		7,14%
IFIX	-0,99%	-1,29%	1,42%	1,19%	0,26%	-0,88%	0,66%	5,76%	0,49%	0,02%	-4,15%		2,22%
IMA-B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%	-0,88%	1,10%	1,48%	1,23%	-0,79%		6,57%

Observações:

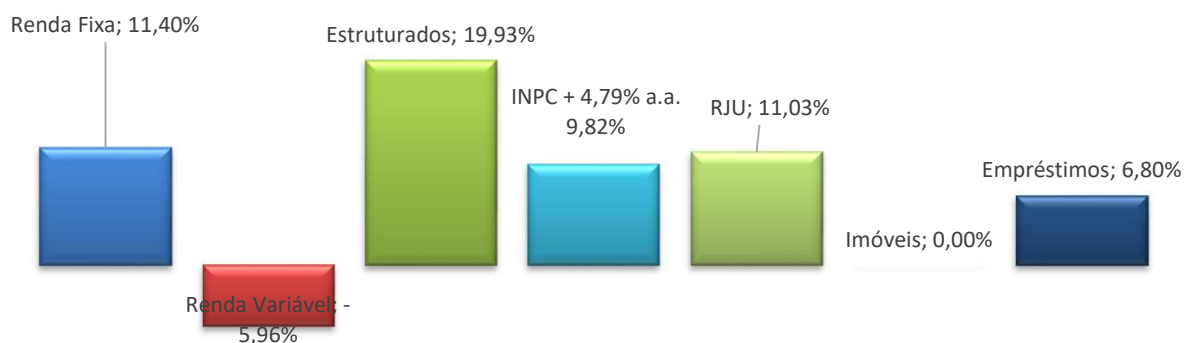
1. A rentabilidade do Plano PREVSIAS reflete a variação da cota do Plano, a qual leva em consideração a dedução da taxa de administração.
2. Benchmark = referência de rentabilidade. Definidos na Política de Investimentos 2022-2026.
3. Meta Atuarial => Plano CLT: INPC + 4,82% a.a.; Plano RJU: INPC + 4,79%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

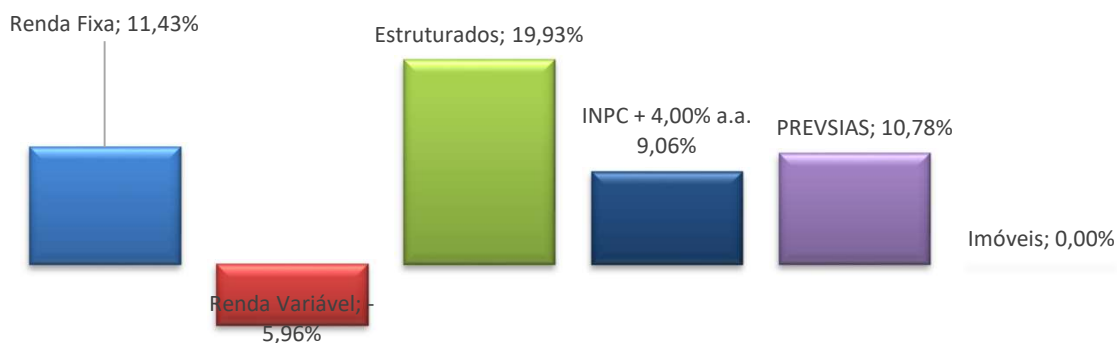
CLT - Rentabilidade em 2022



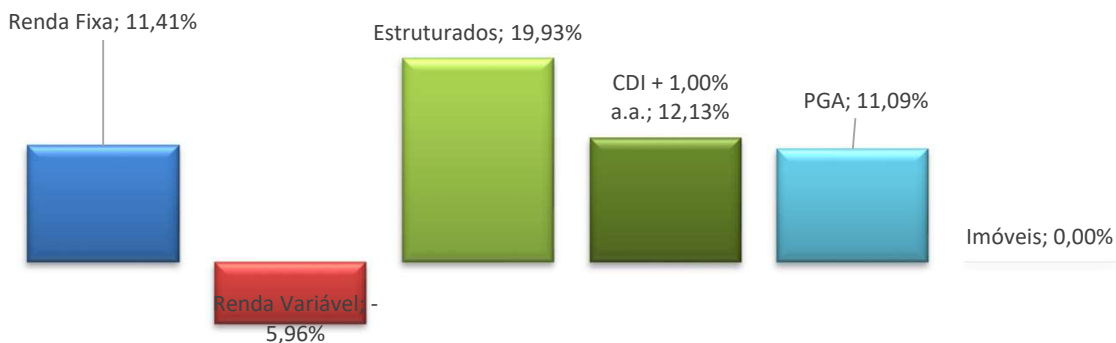
RJU - Rentabilidade em 2022



PREVSIAS - Rentabilidade em 2022



PGA - Rentabilidade em 2022



Histórico de Rentabilidade - Últimos 10 anos

	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022
Segmentos										
Renda Fixa	3,56%	13,05%	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	9,91%	10,41%	12,99%	11,39%
Renda Variável	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-18,98%	-5,96%
Estruturados	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	4,62%	19,93%
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%	13,36%
CLT	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	10,99%
RJU	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	11,03%
PREVSIAS	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	10,78%
PGA	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	11,09%
Indicadores										
CDI	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	4,40%	11,11%
Poupança	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	2,99%	7,14%
IBOVESPA	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-11,93%	7,31%
INPC	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	10,16%	5,21%
CDI +1,00%	9,14%	11,92%	14,35%	15,14%	11,04%	7,48%	7,03%	3,79%	5,43%	12,13%
Índice INPC +4,00%	9,80%	10,49%	15,69%	10,83%	6,10%	7,54%	8,68%	9,65%	14,55%	9,06%
Índice INPC +4,79%	10,64%	11,34%	16,56%	11,66%	6,90%	8,35%	9,51%	10,48%	15,42%	9,82%
Índice INPC +4,82%	10,67%	11,37%	16,60%	11,70%	6,93%	8,38%	9,54%	10,51%	15,45%	9,85%

Rentabilidade acumulada										
	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%	177,87%
RJU	3,03%	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	177,95%
PREVSIAS	3,03%	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	177,34%
PGA	3,03%	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	178,12%
CDI	8,06%	19,76%	35,62%	54,61%	69,99%	80,91%	91,70%	97,01%	105,67%	128,53%
Poupança	5,81%	13,31%	22,46%	32,64%	41,41%	47,95%	54,24%	57,50%	62,20%	73,78%
CDI +1,00%	9,14%	22,15%	39,68%	60,82%	78,57%	91,93%	105,42%	113,21%	124,80%	152,07%
INPC +4,00%	9,80%	21,33%	40,36%	55,56%	65,05%	77,49%	92,89%	111,50%	142,27%	164,22%
INPC +4,79%	10,64%	23,18%	43,59%	60,33%	71,39%	85,70%	103,35%	124,66%	159,29%	184,75%
INPC +4,82%	10,67%	23,25%	43,71%	60,52%	71,64%	86,02%	103,76%	125,17%	159,96%	185,55%

Evolução - Rentabilidade x Meta atuarial x Indicadores de mercado

