



Demonstrativo de Investimentos

Janeiro/2021

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).

ÍNDICE

DESCRIÇÃO	PÁGINAS
<i>CARTEIRA DE INVESTIMENTOS</i>	<i>1</i>
<i>GESTÃO INTERNA x EXTERNA</i>	<i>2</i>
<i>RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS</i>	<i>3</i>
<i>HISTÓRICO DE RENTABILIDADE</i>	<i>5</i>

Carteira de Investimentos

Valores em R\$

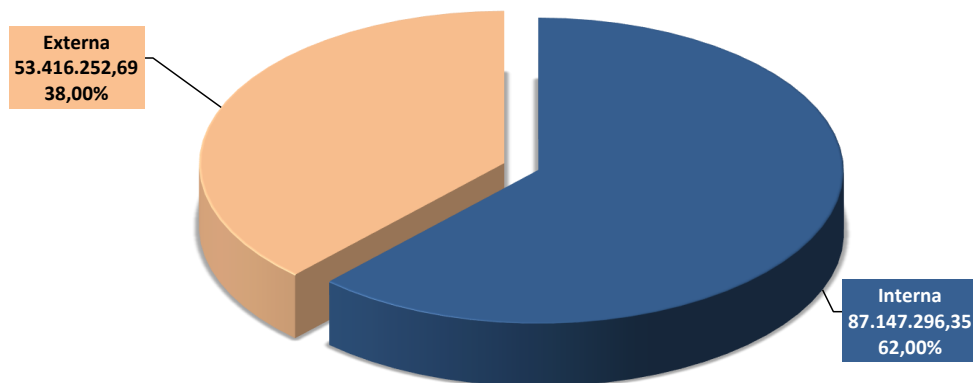
Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
Renda Fixa	104.192.054,79	100,0	
Títulos Públicos Federais	85.394.631,92	82,0	60,7
Quotas de Fundos de Investimentos	18.797.422,87	18,0	13,4
Renda Variável	17.512.309,92	100,0	12,4
Quotas de Fundos de Investimentos	17.512.309,92	100,0	12,4
Investimentos Estruturados	17.106.519,90	100,0	12,2
Quotas de Fundos de Investimentos	17.106.519,90	100,0	12,2
Investimentos Imobiliários	55.660,63	100,0	0,0
Direitos de alienações	55.660,63	100,0	0,0
Empréstimos e Financiamentos	138.632,09	100,0	0,1
Outros	1.558.371,71	100,0	1,1
Total dos Investimentos	140.563.549,04		99,9
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	146.063,74		0,1
Total dos Recursos Garantidores	140.709.612,78		100,0

Gestão interna x externa

Valores em R\$

Descrição	Interna	%	Externa	%	Total	%
Carteira de Títulos Públicos Federais	85.394.631,92	97,99%			85.394.631,92	60,75%
Quotas Fundos de Investimentos de RF			18.797.422,87	35,19%	18.797.422,87	13,37%
Quotas Fundos de Investimentos de RV			17.512.309,92	32,78%	17.512.309,92	12,46%
Investimentos Estruturados			17.106.519,90	32,02%	17.106.519,90	12,17%
Investimentos Imobiliários	55.660,63	0,06%			55.660,63	0,04%
Empréstimos e Financiamentos	138.632,09	0,16%			138.632,09	0,10%
Outros Investimentos	1.558.371,71	1,79%			1.558.371,71	1,11%
Total	87.147.296,35	100,00%	53.416.252,69	100,00%	140.563.549,04	100,00%

Gestão Interna x Externa



Rentabilidade dos Investimentos em 2021

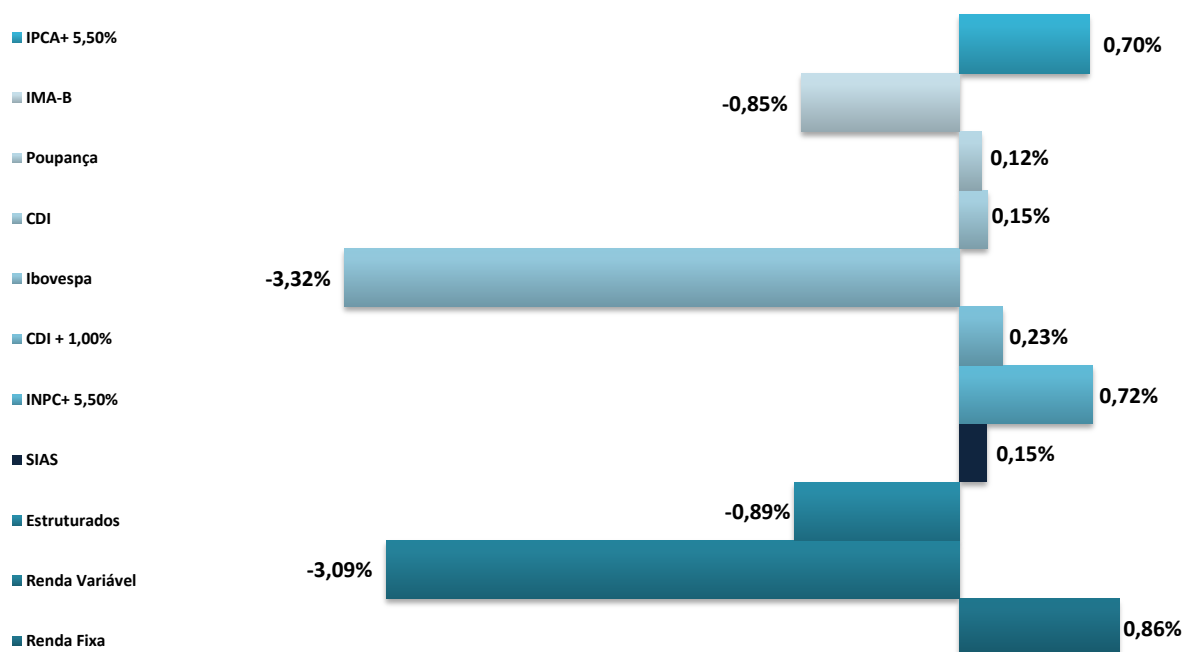
Rentabilidade

Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
Renda Fixa	0,86%												0,86%
Renda Variável	-3,09%												-3,09%
Estruturados	-0,89%												-0,89%
Imóveis	0,00%												0,00%
Empréstimos	3,43%												3,43%
SIAS	0,15%												0,15%
CLT	0,15%												0,15%
RJU	0,15%												0,15%
PREVSIAS	0,12%												0,12%
PGA	0,15%												0,15%
INPC+ 5,50%	0,72%												0,72%
CDI + 1,00%	0,23%												0,23%
CDI + 2,00%	0,31%												0,31%
INPC	0,27%												0,27%
IPCA	0,25%												0,25%
Ibovespa	-3,32%												-3,32%
CDI	0,15%												0,15%
Poupança	0,12%												0,12%
IPCA+ 5,50%	0,70%												0,70%
IMA-B	-0,85%												-0,85%
Bench. RF Planos	0,72%												0,72%

Observações:

1. Benchmark = referência de rentabilidade. Definidos na Política de Investimentos 2021-2025.
2. Meta Atuarial => Planos: INPC + 5,50% a.a.; Meta PGA => CDI + 1,00%
3. O Benchmark da Renda Variável => Ibovespa
4. O Benchmark da Renda Fixa => INPC + 5,50% a.a
5. O Benchmark de Estruturados => CDI + 2% a.a
6. O Benchmark de Empréstimos e Imóveis => INPC + 5,50% a.a
7. O Benchmark de Imóveis => IFIX

Rentabilidades e Indicadores (Acumulado no ano)

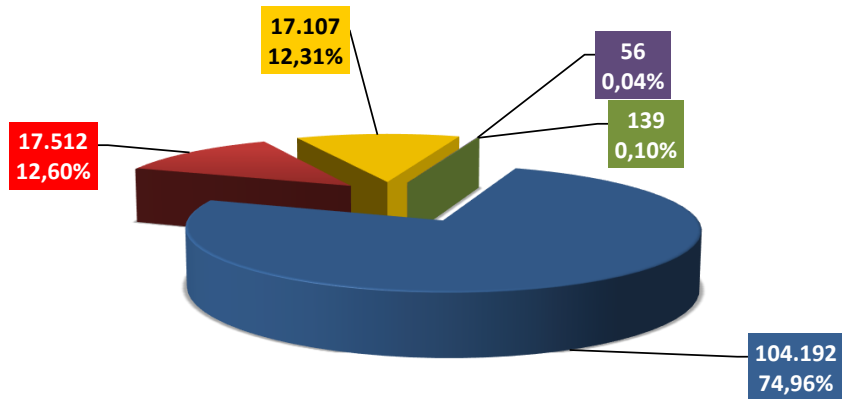


Rentabilidade dos Investimentos em 2021

Alocação (Mil R\$)

Descrição	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Média
Renda Fixa	104.192												104.192
Renda Variável	17.512												17.512
Estruturados	17.107												17.107
Imóveis	56												56
Empréstimos	139												139
Total	139.005												139.005

Carteira de Investimentos em Janeiro de 2021



■ Renda Fixa

■ Renda Variável

■ Estruturados

■ Imóveis

■ Empréstimos

Histórico de Rentabilidade - Últimos 10 anos

	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	Acum
Segmentos											
Renda Fixa	22,61%	3,56%	13,05%	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	9,91%	10,41%	0,86%	178,25%
Renda Variável	16,25%	-2,77%	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-3,09%	129,44%
Estruturados	0,00%	8,96%	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	-0,89%	117,57%
Imóveis	0,00%	0,00%	-42,34%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-42,34%
Empréstimos	3,03%	35,94%	37,01%	38,36%	9,55%	27,66%	-1,56%	-13,55%	32,33%	3,43%	332,56%
SIAS	21,90%	3,03%	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	0,15%	182,57%
Indicadores											
CDI	8,40%	8,06%	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	0,15%	113,87%
Poupança	6,48%	5,81%	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	0,12%	67,89%
IBOVESPA	7,40%	-15,50%	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-3,32%	102,77%
INPC(IBGE)	6,20%	5,56%	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	0,27%	64,72%
INPC + 5,50%	12,04%	11,37%	12,07%	17,40%	12,44%	7,68%	9,12%	10,23%	11,25%	0,72%	167,89%

Rentabilidade acumulada

	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
SIAS	21,90%	25,59%	40,04%	63,00%	84,36%	103,42%	124,05%	154,48%	182,15%	182,57%
INPC + 5,50%	12,04%	24,78%	39,84%	64,17%	84,59%	98,77%	116,90%	139,09%	165,98%	167,89%
Poupança	6,48%	12,67%	20,65%	30,39%	41,22%	50,56%	57,52%	64,23%	67,70%	67,89%
CDI	8,40%	17,14%	29,81%	47,01%	67,59%	84,26%	96,10%	107,80%	113,55%	113,87%

Evolução - Rentabilidade x INPC + 5,50% x CDI x Poupança

