

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 2023



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	28.151.942,72	100,0	30,4
Títulos Públicos Federais	24.986.736,28	88,8	27,0
Quotas de Fundos de Investimentos	3.165.206,44	11,2	3,4
RENDA VARIÁVEL	2.983.265,75	100,0	3,2
Quotas de Fundos de Investimentos	2.983.265,75	100,0	3,2
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	6.407.626,07	100,0	6,9
Quotas de Fundos de Investimentos	6.407.626,07	100,0	6,9
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	178.652,95	100,0	0,2
Valores a Receber	178.652,95	100,0	0,2
Direitos de alienações	178.652,95	100,0	0,2
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	11.383,22	715,5	0,0
Empréstimos e Financiamentos	11.383,22	100,0	0,0
Valores a receber	46.412,69	407,7	0,1
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	(35.029,47)	-307,7	0,0
OUTROS	54.761.187,01	0,3	59,2
IR a recuperar	143.658,37	0,3	0,2
Recursos a recuperar - OFND	54.617.528,64	99,7	59,0
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	92.494.057,72		100,0
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	376,16		0,0
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	92.494.433,88		100,0

Carteira de Investimentos RJU

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
RENDA FIXA	57.755.578,23	100,0	75,9
Títulos Públicos Federais	45.913.641,32	79,5	60,3
Quotas de Fundos de Investimentos	11.841.936,91	20,5	15,6
RENDA VARIÁVEL	5.465.965,41	100,0	7,2
Quotas de Fundos de Investimentos	5.465.965,41	100,0	7,2
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	11.740.108,11	100,0	15,4
Quotas de Fundos de Investimentos	11.740.108,11	100,0	15,4
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	144.269,22	100,0	0,2
Valores a Receber	144.269,22	100,0	0,2
Direitos de alienações	144.269,22	100,0	0,2
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	52.081,59	18292,2	0,1
Empréstimos e Financiamentos	52.081,59	100,0	0,1
Valores a receber	4.789.475,66	9196,1	6,3
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	(4.737.394,07)	-9096,1	-6,2
OUTROS	946.675,78	100,0	1,2
IR a recuperar	946.675,78	100,0	1,2
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	76.104.678,34		100,0
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	17.603,91		0,0
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	76.122.282,25		100,0

Carteira de Investimentos PREVSIAS

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
RENDA FIXA	7.293.011,77	100,0	76,5
Títulos Públicos Federais	4.707.789,69	64,6	49,4
Quotas de Fundos de Investimentos	2.585.222,08	35,4	27,1
RENDA VARIÁVEL	633.899,26	100,0	6,7
Quotas de Fundos de Investimentos	633.899,26	100,0	6,7
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	1.361.524,48	100,0	14,3
Quotas de Fundos de Investimentos	1.361.524,48	100,0	14,3
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	17.756,04	100,0	0,2
Valores a Receber	17.756,04	100,0	0,2
Direitos de alienações	17.756,04	100,0	0,2
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	179.562,63	100,0	1,9
IR a recuperar	179.562,63	100,0	1,9
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	9.485.754,18		99,6
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	42.441,17		0,4
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	9.528.195,35		100,0

Carteira de Investimentos PGA

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG
RENDA FIXA	10.851.491,50	100,0	72,4
Títulos Públicos Federais	10.088.939,20	93,0	67,3
Quotas de Fundos de Investimentos	762.552,30	7,0	5,1
RENDA VARIÁVEL	1.212.389,05	100,0	8,1
Quotas de Fundos de Investimentos	1.212.389,05	100,0	8,1
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	2.604.037,42	100,0	17,4
Quotas de Fundos de Investimentos	2.604.037,42	100,0	17,4
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	29.321,79	100,0	0,2
Valores a Receber	29.321,79	100,0	0,2
Direitos de alienações	29.321,79	100,0	0,2
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	288.474,93	100	1,9
IR a recuperar	288.474,93	100	1,9
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	14.985.714,69	100,0	100,0
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	2.022,52		0,0
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	14.987.737,21		100,0

Rentabilidade dos Investimentos em 2023

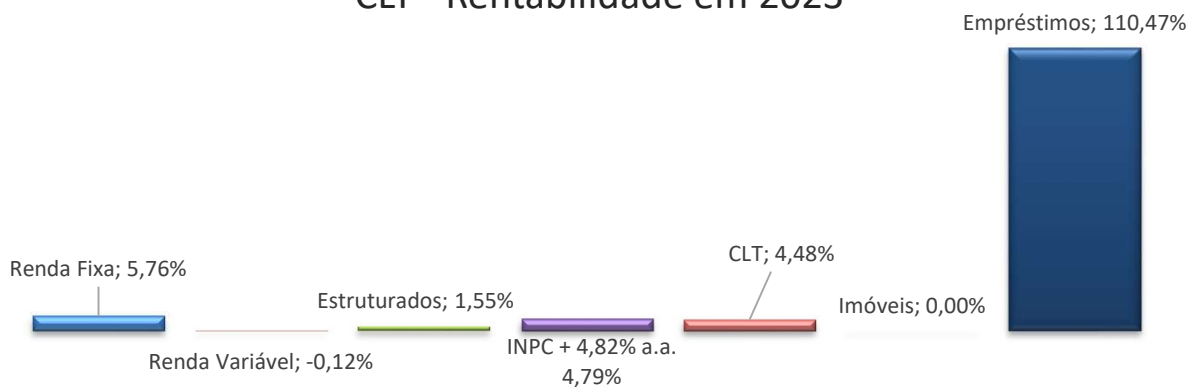
Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
CLT	1,25%	-0,16%	0,86%	0,92%	1,54%								4,48%
Renda Fixa	1,19%	0,96%	1,45%	0,96%	1,08%								5,76%
Renda Variável	2,56%	-7,69%	-3,57%	2,10%	7,16%								-0,12%
Estruturados	0,79%	-0,73%	0,65%	0,17%	0,67%								1,55%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%								0,00%
Empréstimos	1,14%	1,13%	1,15%	1,13%	101,13%								110,47%
RJU	1,24%	-0,10%	0,88%	0,91%	1,51%								4,51%
Renda Fixa	1,16%	0,95%	1,43%	0,94%	1,10%								5,71%
Renda Variável	2,56%	-7,69%	-3,57%	2,10%	7,16%								-0,12%
Estruturados	0,79%	-0,73%	0,65%	0,17%	0,67%								1,55%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%								0,00%
Empréstimos	-2,74%	-1,00%	5,85%	11,65%	11,65%								27,05%
PREVSIAS	1,16%	-0,10%	0,83%	0,84%	1,42%								4,21%
Renda Fixa	1,17%	0,94%	1,39%	0,93%	1,12%								5,68%
Renda Variável	2,56%	-7,69%	-3,57%	2,10%	7,16%								-0,12%
Estruturados	0,79%	-0,73%	0,65%	0,17%	0,67%								1,55%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%								0,00%
PGA	1,24%	-0,15%	0,87%	0,92%	1,54%								4,49%
Renda Fixa	1,19%	0,96%	1,46%	0,95%	1,09%								5,78%
Renda Variável	2,56%	-7,69%	-3,57%	2,10%	7,16%								-0,12%
Estruturados	0,79%	-0,73%	0,65%	0,17%	0,67%								1,55%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%								0,00%
INPC + 4,82% a.a.	0,85%	1,16%	1,03%	0,92%	0,75%								4,79%
INPC + 4,79% a.a.	0,86%	1,17%	1,04%	0,93%	0,76%								4,86%
INPC + 4,00% a.a.	0,79%	1,10%	0,97%	0,86%	0,69%								4,48%
CDI + 1,00% a.a.	1,20%	1,00%	1,25%	1,00%	1,20%								5,80%
CDI + 2,00% a.a.	1,29%	1,09%	1,34%	1,09%	1,29%								6,23%
INPC	0,46%	0,77%	0,64%	0,53%	0,36%								2,79%
IPCA	0,53%	0,84%	0,71%	0,61%	0,23%								2,95%
Ibovespa	3,37%	-7,49%	-2,91%	2,50%	3,74%								-1,27%
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,92%	1,12%								5,36%
Poupança	0,71%	0,58%	0,74%	0,58%	0,72%								3,37%
IFIX	-1,60%	-0,45%	-1,69%	3,52%	5,43%								5,10%
IMA-B	0,00%	1,28%	2,66%	2,02%	2,53%								8,76%

Observações:

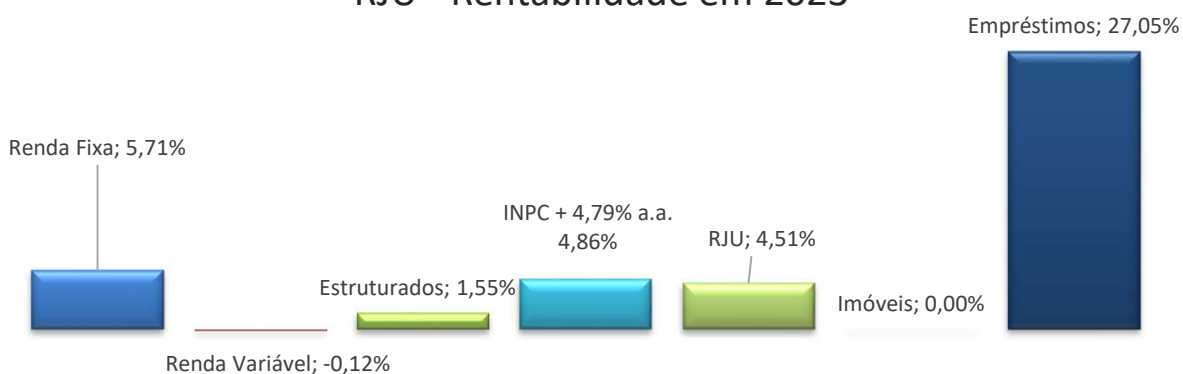
1. A rentabilidade do Plano PREVSIAS reflete a variação da cota do Plano, a qual leva em consideração a dedução da taxa de administração.
2. Benchmark = referência de rentabilidade. Definidos na Política de Investimentos 2022-2026.
3. Meta Atuarial => Plano CLT: INPC + 4,82% a.a.; Plano RJU: INPC + 4,79% 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 2023

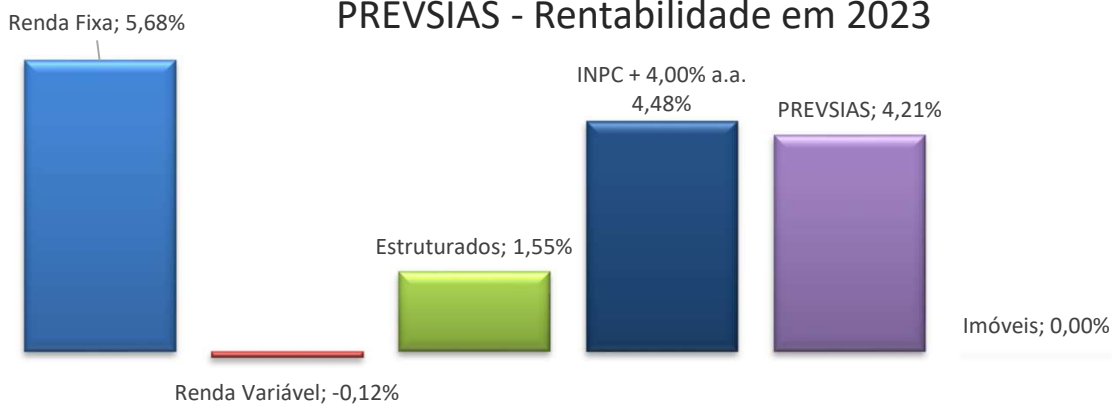
CLT - Rentabilidade em 2023



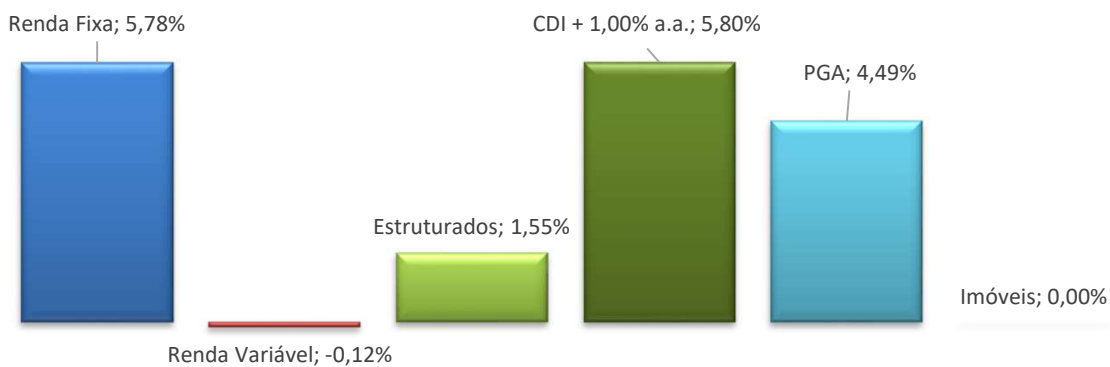
RJU - Rentabilidade em 2023



PREVSIAS - Rentabilidade em 2023



PGA - Rentabilidade em 2023



Histórico de Rentabilidade - Últimos 10 anos

	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023
Segmentos										
Renda Fixa	13,05%	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	9,91%	10,41%	12,99%	13,40%	5,76%
Renda Variável	0,14%	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-18,98%	-10,43%	-0,12%
Estruturados	8,21%	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	4,62%	20,33%	1,55%
Imóveis	-42,34%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Empréstimos	37,01%	38,36%	9,55%	27,66%	-1,56%	-13,55%	32,33%	-14,54%	14,65%	110,47%
CLT	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	12,02%	4,48%
RJU	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	12,06%	4,51%
PREVSIAS	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	12,92%	4,21%
PGA	11,51%	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	12,11%	4,49%
Indicadores										
CDI	10,82%	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	4,40%	12,36%	5,36%
Poupança	7,09%	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	2,99%	7,90%	3,37%
IBOVESPA	-2,91%	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-11,93%	4,68%	-1,27%
INPC	6,23%	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	10,16%	5,93%	2,79%
CDI +1,00%	11,92%	14,35%	15,14%	11,04%	7,48%	7,03%	3,79%	5,43%	13,48%	5,80%
Índice INPC +4,00%	10,49%	15,69%	10,83%	6,10%	7,54%	8,68%	9,65%	14,55%	10,17%	4,48%
Índice INPC +4,79%	11,34%	16,56%	11,66%	6,90%	8,35%	9,51%	10,48%	15,42%	11,01%	4,86%
Índice INPC +4,82%	11,37%	16,60%	11,70%	6,93%	8,38%	9,54%	10,51%	15,45%	11,04%	4,79%

Rentabilidade acumulada										
	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023
CLT	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	180,43%	192,98%
RJU	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	180,54%	193,20%
PREVSIAS	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	182,70%	194,60%
PGA	14,89%	33,72%	51,24%	66,88%	83,81%	108,77%	131,47%	150,34%	180,65%	193,25%
CDI	19,76%	35,62%	54,61%	69,99%	80,91%	91,70%	97,01%	105,67%	131,08%	143,47%
Poupança	13,31%	22,46%	32,64%	41,41%	47,95%	54,24%	57,50%	62,20%	75,01%	80,92%
CDI +1,00%	22,15%	39,68%	60,82%	78,57%	91,93%	105,42%	113,21%	124,80%	155,11%	169,90%
INPC +4,00%	21,33%	40,36%	55,56%	65,05%	77,49%	92,89%	111,50%	142,27%	166,91%	178,88%
INPC +4,79%	23,18%	43,59%	60,33%	71,39%	85,70%	103,35%	124,66%	159,29%	187,83%	201,81%
INPC +4,82%	23,25%	43,71%	60,52%	71,64%	86,02%	103,76%	125,17%	159,96%	188,65%	202,48%

Evolução - Rentabilidade x Meta atuarial x Indicadores de mercado

