

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

Março de 2023



ÍNDICE

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

Carteira de Investimentos CLT

| Descrição | Valor de Mercado | % s/ Seg | % s/ RG |
|--|----------------------|--------------|--------------|
| RENDA FIXA | 27.929.955,75 | 100,0 | 30,2 |
| Títulos Públicos Federais | 24.736.697,28 | 88,6 | 26,7 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 3.193.258,47 | 11,4 | 3,4 |
| RENDA VARIÁVEL | 3.236.472,09 | 100,0 | 3,5 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 3.236.472,09 | 100,0 | 3,5 |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | 6.354.666,05 | 100,0 | 6,9 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 6.354.666,05 | 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 | 12.422,44 | 652,0 | 0,0 |
| Empréstimos e Financiamentos | 12.422,44 | 100,0 | 0,0 |
| Valores a receber | 46.709,23 | 376,0 | 0,1 |
| (-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa | (34.286,79) | -276,0 | 0,0 |
| OUTROS | 54.879.885,26 | 0,5 | 59,3 |
| IR a recuperar | 262.356,62 | 0,5 | 0,3 |
| Recursos a recuperar - OFND | 54.617.528,64 | 99,5 | 59,0 |
| TOTAL DOS INVESTIMENTOS | 92.592.054,54 | | 100,0 |
| (+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos | 17.472,99 | | 0,0 |
| TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES | 92.609.527,53 | | 100,0 |

Carteira de Investimentos RJU

| Descrição | Valor de Mercado | % s/ Seg | % s/ RG |
|--|----------------------|----------------|--------------|
| RENDA FIXA | 56.089.739,86 | 100,0 | 75,0 |
| Títulos Públicos Federais | 45.457.016,02 | 81,0 | 60,8 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 10.632.723,84 | 19,0 | 14,2 |
| RENDA VARIÁVEL | 5.929.892,24 | 100,0 | 7,9 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 5.929.892,24 | 100,0 | 7,9 |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | 11.643.074,32 | 100,0 | 15,6 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 11.643.074,32 | 100,0 | 15,6 |
| 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 | 53.054,94 | 17751,6 | 0,1 |
| Empréstimos e Financiamentos | 53.054,94 | 100,0 | 0,1 |
| Valores a receber | 4.735.582,11 | 8925,8 | 6,3 |
| (-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa | (4.682.527,17) | -8825,8 | -6,3 |
| OUTROS | 930.843,12 | 100,0 | 1,2 |
| IR a recuperar | 930.843,12 | 100,0 | 1,2 |
| TOTAL DOS INVESTIMENTOS | 74.790.873,70 | | 100,0 |
| (+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos | 2.455,45 | | 0,0 |
| TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES | 74.793.329,15 | | 100,0 |

Carteira de Investimentos PREVSIAS

| Descrição | Valor de Mercado | % s/ Seg | % s/ RG |
|--|---------------------|--------------|--------------|
| RENTA FIXA | 6.921.882,95 | 100,0 | 75,2 |
| Títulos Públicos Federais | 4.649.650,18 | 67,2 | 50,5 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 2.272.232,77 | 32,8 | 24,7 |
| RENTA VARIÁVEL | 687.701,79 | 100,0 | 7,5 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 687.701,79 | 100,0 | 7,5 |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | 1.350.271,27 | 100,0 | 14,7 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 1.350.271,27 | 100,0 | 14,7 |
| 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 | 206.862,12 | 100,0 | 2,2 |
| IR a recuperar | 206.862,12 | 100,0 | 2,2 |
| TOTAL DOS INVESTIMENTOS | 9.184.474,17 | | 99,8 |
| (+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos | 14.370,87 | | 0,2 |
| TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES | 9.198.845,04 | | 100,0 |

Carteira de Investimentos PGA

| Descrição | Valor de Mercado | % s/ Seg | % s/ RG |
|--|----------------------|--------------|--------------|
| RENDA FIXA | 11.129.632,08 | 100,0 | 73,1 |
| Títulos Públicos Federais | 9.986.942,03 | 89,7 | 65,6 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 1.142.690,05 | 10,3 | 7,5 |
| RENDA VARIÁVEL | 1.315.291,23 | 100,0 | 8,6 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 1.315.291,23 | 100,0 | 8,6 |
| INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS | 2.582.514,65 | 100,0 | 17,0 |
| Quotas de Fundos de Investimentos | 2.582.514,65 | 100,0 | 17,0 |
| 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 | 158.309,85 | 100 | 1,0 |
| IR a recuperar | 158.309,85 | 100 | 1,0 |
| TOTAL DOS INVESTIMENTOS | 15.215.069,60 | | 99,9 |
| (+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos | 13.001,72 | | 0,1 |
| TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES | 15.228.071,32 | | 100,0 |

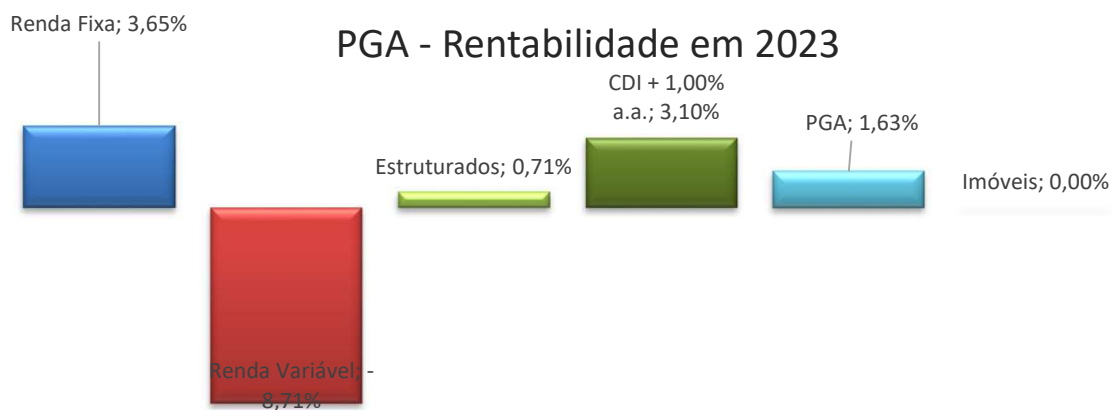
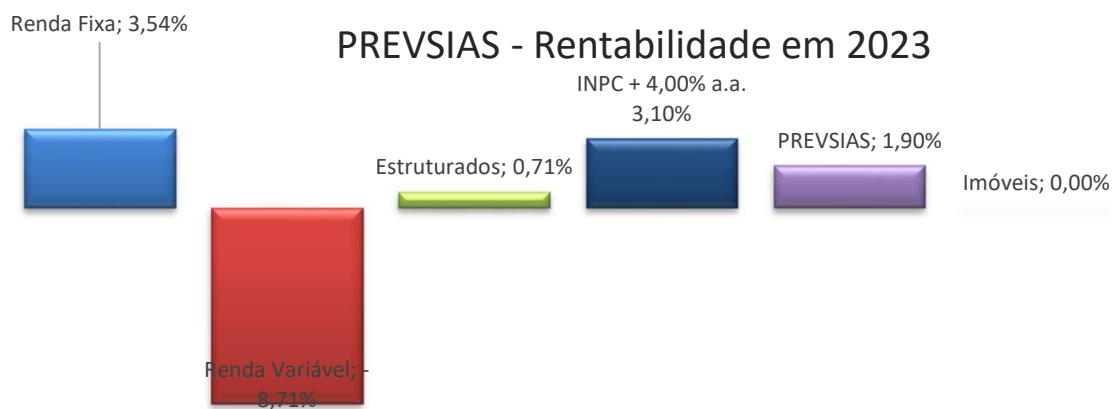
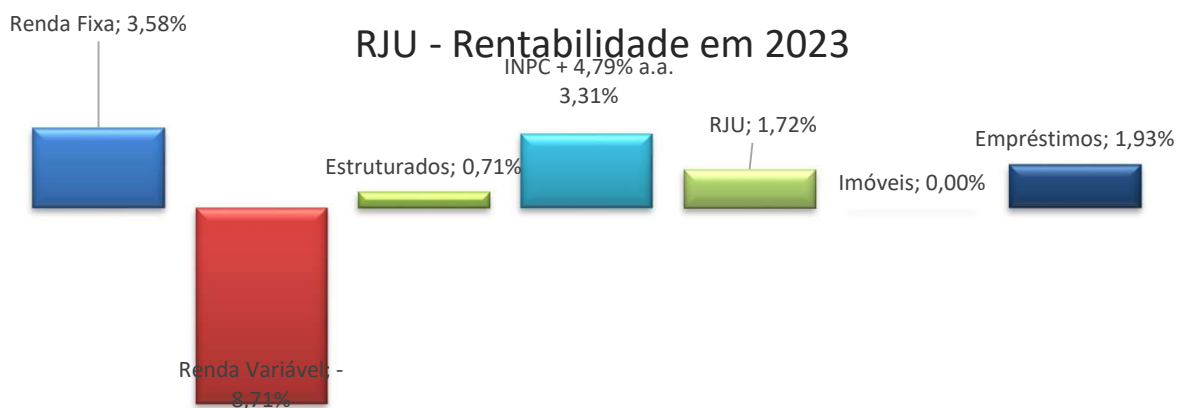
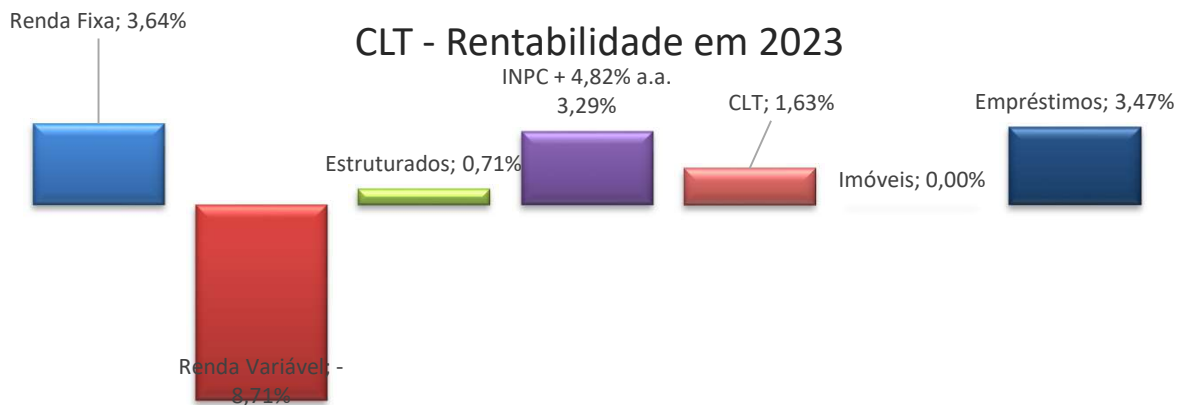
Rentabilidade dos Investimentos em 2023

| Descrição | jan | fev | mar | abr | mai | jun | jul | ago | set | out | nov | dez | Acum. |
|--------------------------|--------------|---------------|--------------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|--------------|
| CLT | 0,92% | -0,16% | 0,86% | | | | | | | | | | 1,63% |
| Renda Fixa | 1,19% | 0,96% | 1,45% | | | | | | | | | | 3,64% |
| Renda Variável | 2,56% | -7,69% | -3,57% | | | | | | | | | | -8,71% |
| Estruturados | 0,79% | -0,73% | 0,65% | | | | | | | | | | 0,71% |
| Imóveis | 0,00% | 0,00% | 0,00% | | | | | | | | | | 0,00% |
| Empréstimos | 1,14% | 1,13% | 1,15% | | | | | | | | | | 3,47% |
| RJU | 0,93% | -0,10% | 0,88% | | | | | | | | | | 1,72% |
| Renda Fixa | 1,16% | 0,95% | 1,43% | | | | | | | | | | 3,58% |
| Renda Variável | 2,56% | -7,69% | -3,57% | | | | | | | | | | -8,71% |
| Estruturados | 0,79% | -0,73% | 0,65% | | | | | | | | | | 0,71% |
| Imóveis | 0,00% | 0,00% | 0,00% | | | | | | | | | | 0,00% |
| Empréstimos | -2,74% | -1,00% | 5,85% | | | | | | | | | | 1,93% |
| PREVSIAS | 1,16% | -0,10% | 0,83% | | | | | | | | | | 1,90% |
| Renda Fixa | 1,17% | 0,94% | 1,39% | | | | | | | | | | 3,54% |
| Renda Variável | 2,56% | -7,69% | -3,57% | | | | | | | | | | -8,71% |
| Estruturados | 0,79% | -0,73% | 0,65% | | | | | | | | | | 0,71% |
| Imóveis | 0,00% | 0,00% | 0,00% | | | | | | | | | | 0,00% |
| PGA | 0,91% | -0,15% | 0,87% | | | | | | | | | | 1,63% |
| Renda Fixa | 1,19% | 0,96% | 1,46% | | | | | | | | | | 3,65% |
| Renda Variável | 2,56% | -7,69% | -3,57% | | | | | | | | | | -8,71% |
| Estruturados | 0,79% | -0,73% | 0,65% | | | | | | | | | | 0,71% |
| Imóveis | 0,00% | 0,00% | 0,00% | | | | | | | | | | 0,00% |
| INPC + 4,82% a.a. | 1,07% | 1,16% | 1,03% | | | | | | | | | | 3,29% |
| INPC + 4,79% a.a. | 1,06% | 1,17% | 1,04% | | | | | | | | | | 3,31% |
| INPC + 4,00% a.a. | 1,00% | 1,10% | 0,97% | | | | | | | | | | 3,10% |
| CDI + 1,00% a.a. | 0,81% | 1,00% | 1,25% | | | | | | | | | | 3,10% |
| CDI + 2,00% a.a. | 0,90% | 1,09% | 1,34% | | | | | | | | | | 3,36% |
| INPC | 0,67% | 0,77% | 0,64% | | | | | | | | | | 2,09% |
| IPCA | 0,54% | 0,84% | 0,71% | | | | | | | | | | 2,10% |
| Ibovespa | 6,98% | -7,49% | -2,91% | | | | | | | | | | -3,91% |
| CDI | 0,73% | 0,92% | 1,17% | | | | | | | | | | 2,85% |
| Poupança | 0,56% | 0,58% | 0,74% | | | | | | | | | | 1,89% |
| IFIX | -0,99% | -0,45% | -1,69% | | | | | | | | | | -3,10% |
| IMA-B | -0,73% | 1,28% | 2,66% | | | | | | | | | | 3,22% |

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



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% | 3,64% |
| Renda Variável | 0,14% | 3,33% | -1,94% | 31,18% | 6,84% | 42,46% | 3,39% | -18,98% | -10,43% | -8,71% |
| Estruturados | 8,21% | 16,42% | 18,79% | 13,88% | 5,86% | 8,99% | 2,47% | 4,62% | 20,33% | 0,71% |
| 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% | 3,47% |
| CLT | 11,51% | 16,40% | 13,10% | 10,34% | 10,14% | 13,58% | 10,87% | 8,16% | 12,02% | 1,63% |
| RJU | 11,51% | 16,40% | 13,10% | 10,34% | 10,14% | 13,58% | 10,87% | 8,16% | 12,06% | 1,72% |
| PREVSIAS | 11,51% | 16,40% | 13,10% | 10,34% | 10,14% | 13,58% | 10,87% | 8,16% | 12,92% | 1,90% |
| PGA | 11,51% | 16,40% | 13,10% | 10,34% | 10,14% | 13,58% | 10,87% | 8,16% | 12,11% | 1,63% |
| Indicadores | | | | | | | | | | |
| CDI | 10,82% | 13,25% | 14,00% | 9,95% | 6,42% | 5,97% | 2,77% | 4,40% | 12,36% | 2,85% |
| Poupança | 7,09% | 8,08% | 8,30% | 6,61% | 4,62% | 4,26% | 2,11% | 2,99% | 7,90% | 1,89% |
| IBOVESPA | -2,91% | -13,30% | 38,94% | 26,86% | 15,03% | 31,58% | 2,92% | -11,93% | 4,68% | -3,91% |
| INPC | 6,23% | 11,28% | 6,58% | 2,07% | 3,43% | 4,48% | 5,45% | 10,16% | 5,93% | 2,09% |
| CDI +1,00% | 11,92% | 14,35% | 15,14% | 11,04% | 7,48% | 7,03% | 3,79% | 5,43% | 13,48% | 3,10% |
| Índice INPC +4,00% | 10,49% | 15,69% | 10,83% | 6,10% | 7,54% | 8,68% | 9,65% | 14,55% | 10,17% | 3,10% |
| Índice INPC +4,79% | 11,34% | 16,56% | 11,66% | 6,90% | 8,35% | 9,51% | 10,48% | 15,42% | 11,01% | 3,31% |
| Índice INPC +4,82% | 11,37% | 16,60% | 11,70% | 6,93% | 8,38% | 9,54% | 10,51% | 15,45% | 11,04% | 3,29% |

| 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% | 185,00% |
| RJU | 14,89% | 33,72% | 51,24% | 66,88% | 83,81% | 108,77% | 131,47% | 150,34% | 180,54% | 185,36% |
| PREVSIAS | 14,89% | 33,72% | 51,24% | 66,88% | 83,81% | 108,77% | 131,47% | 150,34% | 182,70% | 188,06% |
| PGA | 14,89% | 33,72% | 51,24% | 66,88% | 83,81% | 108,77% | 131,47% | 150,34% | 180,65% | 185,23% |
| CDI | 19,76% | 35,62% | 54,61% | 69,99% | 80,91% | 91,70% | 97,01% | 105,67% | 131,08% | 137,66% |
| Poupança | 13,31% | 22,46% | 32,64% | 41,41% | 47,95% | 54,24% | 57,50% | 62,20% | 75,01% | 78,32% |
| CDI +1,00% | 22,15% | 39,68% | 60,82% | 78,57% | 91,93% | 105,42% | 113,21% | 124,80% | 155,11% | 163,02% |
| INPC +4,00% | 21,33% | 40,36% | 55,56% | 65,05% | 77,49% | 92,89% | 111,50% | 142,27% | 166,91% | 175,19% |
| INPC +4,79% | 23,18% | 43,59% | 60,33% | 71,39% | 85,70% | 103,35% | 124,66% | 159,29% | 187,83% | 197,37% |
| INPC +4,82% | 23,25% | 43,71% | 60,52% | 71,64% | 86,02% | 103,76% | 125,17% | 159,96% | 188,65% | 198,15% |

Evolução - Rentabilidade x Meta atuarial x Indicadores de mercado

