

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

Junho de 2024



# ÍNDICE

---

<i>CARTEIRA DE INVESTIMENTOS — CLT</i>	.....	<i>01</i>
<i>CARTEIRA DE INVESTIMENTOS — RJU</i>	.....	<i>02</i>
<i>CARTEIRA DE INVESTIMENTOS — PREVSIAS</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	Valor de Mercado (Dez/2023)
<b>RENDA FIXA</b>	<b>30.218.426,66</b>	<b>100,0</b>	<b>32,0</b>	<b>31.643.119,24</b>
Títulos Públicos Federais	28.222.926,73	93,4	29,9	27.475.339,47
Quotas de Fundos de Investimentos	1.995.499,93	6,6	2,1	4.167.779,77
<b>RENDA VARIÁVEL</b>	<b>868.784,05</b>	<b>100,0</b>	<b>0,9</b>	<b>981.480,85</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	868.784,05	100,0	0,9	981.480,85
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	<b>3.862.679,19</b>	<b>100,0</b>	<b>4,1</b>	<b>3.841.225,96</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	3.862.679,19	100,0	4,1	3.841.225,96
<b>INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>47.483,09</b>	<b>100,0</b>	<b>0,1</b>	<b>11.239,40</b>
Valores a Receber	47.483,09	100,0	0,1	11.239,40
Direitos de alienações	47.483,09	100,0	0,1	11.239,40
<b>EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS</b>	<b>7.986,60</b>	<b>100,0</b>	<b>0,0</b>	<b>10.038,65</b>
Empréstimos e Financiamentos	7.986,60	100,0	0,0	10.038,65
<b>Valores a receber</b>	<b>46.116,48</b>	<b>577,4</b>	<b>0,0</b>	<b>46.401,65</b>
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	(38.129,88)	-477,4	0,0	(36.363,00)
<b>OUTROS</b>	<b>59.444.653,24</b>	<b>100,0</b>	<b>62,9</b>	<b>57.999.454,72</b>
IR a recuperar	6.736,66	0,0	0,0	-
Recursos a recuperar - OFND	58.629.580,46	98,6	62,1	57.191.118,60
Outros Realizáveis - Investimentos	808.336,12	1,4	0,9	808.336,12
<b>TOTAL DOS INVESTIMENTOS</b>	<b>94.450.012,83</b>	<b>100,0</b>	<b>100,0</b>	<b>94.486.558,82</b>
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	591,55		0,0	1.127,45
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>	<b>94.450.604,38</b>	<b>100,0</b>	<b>100,0</b>	<b>94.487.686,27</b>

## Carteira de Investimentos RJU

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seq	% s/ RG	Valor de Mercado (Dez/2023)
<b>RENDA FIXA</b>	<b>63.805.135,62</b>	<b>100,0</b>	<b>83,3</b>	<b>65.191.366,65</b>
Títulos Públicos Federais	51.815.411,62	81,2	67,6	50.443.096,54
Quotas de Fundos de Investimentos	11.989.724,00	18,8	15,7	14.748.270,11
<b>RENDA VARIÁVEL</b>	<b>1.591.793,67</b>	<b>100,0</b>	<b>2,1</b>	<b>1.798.277,73</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	1.591.793,67	100,0	2,1	1.798.277,73
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	<b>8.658.781,05</b>	<b>100,0</b>	<b>11,3</b>	<b>8.636.730,72</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	8.658.781,05	100,0	11,3	8.636.730,72
<b>INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>213.509,19</b>	<b>100,0</b>	<b>0,3</b>	<b>46.933,92</b>
Valores a Receber	213.509,19	100,0	0,3	46.933,92
Direitos de alienações	213.509,19	100,0	0,3	46.933,92
<b>EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS</b>	<b>40.463,91</b>	<b>100,0</b>	<b>0,1</b>	<b>47.350,59</b>
Empréstimos e Financiamentos	40.463,91	100,0	0,1	47.350,59
Valores a receber	4.802.250,57	11868,0	6,3	4.602.392,15
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	(4.761.786,66)	-11768,0	-6,2	(4.555.041,56)
<b>OUTROS</b>	<b>2.194.851,89</b>	<b>100,0</b>	<b>2,9</b>	<b>1.699.120,02</b>
IR a recuperar	550.696,45	25,1	0,7	54.964,58
Outros Realizáveis - Investimentos	1.644.155,44	74,9	2,1	1.644.155,44
<b>TOTAL DOS INVESTIMENTOS</b>	<b>76.504.535,33</b>		<b>99,9</b>	<b>77.419.779,63</b>
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	99.136,24		0,1	2.066,36
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>	<b>76.603.671,57</b>		<b>100,0</b>	<b>77.421.845,99</b>

## Carteira de Investimentos PREVSIAS

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seq	% s/ RG	Valor de Mercado (Dez/2023)
<b>RENDA FIXA</b>	<b>9.199.440,91</b>	<b>100,0</b>	<b>87,3</b>	<b>8.796.471,87</b>
Títulos Públicos Federais	4.933.901,95	53,6	46,8	4.801.661,26
Quotas de Fundos de Investimentos	4.265.538,96	46,4	40,5	3.994.810,61
<b>RENDA VARIÁVEL</b>	<b>184.603,59</b>	<b>100,0</b>	<b>1,8</b>	<b>208.549,97</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	184.603,59	100,0	1,8	208.549,97
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	<b>955.615,46</b>	<b>100,0</b>	<b>9,1</b>	<b>949.502,88</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	955.615,46	100,0	9,1	949.502,88
<b>INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>15.999,36</b>	<b>100,0</b>	<b>0,2</b>	<b>15.528,15</b>
Valores a Receber	15.999,36	100,0	0,2	15.528,15
Direitos de alienações	-	0,0	0,0	-
<b>EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS</b>	<b>-</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>-</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>171.473,88</b>	<b>100,0</b>	<b>1,6</b>	<b>251.271,21</b>
IR a recuperar	171.473,88	100,0	1,6	251.271,21
<b>TOTAL DOS INVESTIMENTOS</b>	<b>10.527.133,20</b>	<b>99,9</b>	<b>100,0</b>	<b>10.221.324,08</b>
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	6.242,45		0,1	1.979,16
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>	<b>10.533.375,65</b>	<b>100,0</b>	<b>100,0</b>	<b>10.223.303,24</b>

## Carteira de Investimentos PGA

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG	Valor de Mercado (Dez/2023)
<b>RENTA FIXA</b>	<b>11.656.638,56</b>	<b>100,0</b>	<b>78,1</b>	<b>11.480.326,73</b>
Títulos Públicos Federais	10.571.969,26	90,7	70,9	10.289.628,30
Quotas de Fundos de Investimentos	1.084.669,30	9,3	7,3	1.190.698,43
<b>RENTA VARIÁVEL</b>	<b>353.070,88</b>	<b>100,0</b>	<b>2,4</b>	<b>398.870,48</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	353.070,88	100,0	2,4	398.870,48
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	<b>2.039.881,34</b>	<b>100,0</b>	<b>13,7</b>	<b>2.021.438,32</b>
Quotas de Fundos de Investimentos	2.039.881,34	100,0	13,7	2.021.438,32
<b>INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS</b>	<b>23.008,36</b>	<b>100,0</b>	<b>0,2</b>	<b>226.298,32</b>
Valores a Receber	23.008,36	100,0	0,2	226.298,32
Direitos de alienações	-	0,0	0,2	226.298,32
<b>EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS</b>	<b>-</b>	<b>0,0</b>	<b>0,0</b>	<b>-</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>829.464,72</b>	<b>100</b>	<b>5,6</b>	<b>1.252.135,92</b>
IR a recuperar	829.464,72	100	5,6	1.252.135,92
<b>TOTAL DOS INVESTIMENTOS</b>	<b>14.902.063,86</b>	<b>99,9</b>	<b>15,3</b>	<b>15.379.069,77</b>
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	16.702,81		0,1	4.247,03
<b>TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES</b>	<b>14.918.766,67</b>	<b>100,0</b>	<b>15,4</b>	<b>15.383.316,80</b>

## Rentabilidade dos Investimentos em 2024

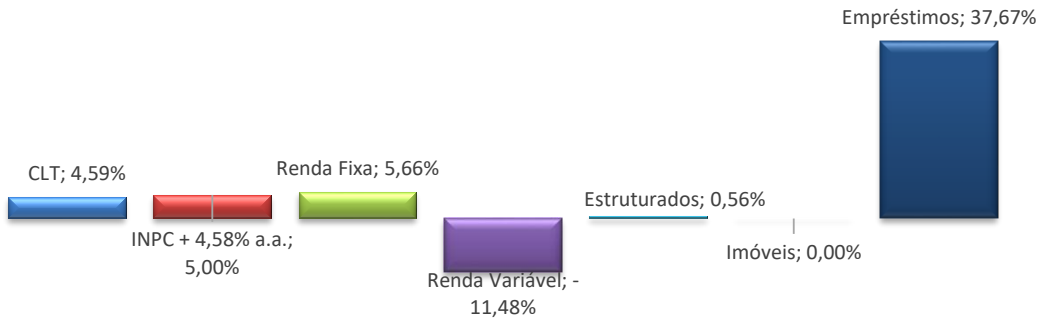
Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
<b>CLT</b>	<b>0,81%</b>	<b>0,85%</b>	<b>0,94%</b>	<b>0,33%</b>	<b>0,72%</b>	<b>0,84%</b>							<b>4,59%</b>
<b>INPC + 4,58% a.a.</b>	<b>0,95%</b>	<b>1,19%</b>	<b>0,56%</b>	<b>0,75%</b>	<b>0,84%</b>	<b>0,62%</b>							<b>5,00%</b>
Renda Fixa	1,04%	1,00%	1,01%	0,74%	0,89%	0,85%							5,66%
Renda Variável	-3,96%	1,19%	-0,39%	-6,28%	-3,27%	0,86%							-11,48%
Estruturados	0,22%	-0,35%	0,77%	-1,23%	0,37%	0,79%							0,56%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%							0,00%
Empréstimos	0,98%	1,15%	30,36%	1,11%	1,12%	1,12%							37,67%
<b>RJU</b>	<b>0,81%</b>	<b>0,82%</b>	<b>0,92%</b>	<b>0,34%</b>	<b>0,73%</b>	<b>0,83%</b>							<b>4,52%</b>
<b>INPC + 5,04% a.a.</b>	<b>0,98%</b>	<b>1,22%</b>	<b>0,60%</b>	<b>0,78%</b>	<b>0,87%</b>	<b>0,66%</b>							<b>5,23%</b>
Renda Fixa	1,04%	0,97%	0,98%	0,74%	0,88%	0,84%							5,58%
Renda Variável	-3,96%	1,19%	-0,39%	-6,28%	-3,27%	0,86%							-11,48%
Estruturados	0,13%	-0,36%	0,72%	-1,33%	0,35%	0,75%							0,26%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%							0,00%
Empréstimos	-1,79%	-1,74%	-1,80%	-2,40%	-2,69%	-2,69%							-12,42%
<b>PREVSIAS</b>	<b>0,85%</b>	<b>0,81%</b>	<b>0,89%</b>	<b>0,41%</b>	<b>0,74%</b>	<b>0,83%</b>							<b>4,62%</b>
<b>PREVSIAS (Plano)</b>	<b>0,80%</b>	<b>0,79%</b>	<b>0,83%</b>	<b>0,37%</b>	<b>0,69%</b>	<b>0,78%</b>							<b>4,34%</b>
<b>INPC + 4,00% a.a.</b>	<b>0,90%</b>	<b>1,14%</b>	<b>0,52%</b>	<b>0,70%</b>	<b>0,79%</b>	<b>0,58%</b>							<b>4,71%</b>
Renda Fixa	1,02%	0,92%	0,94%	0,74%	0,87%	0,83%							5,44%
Renda Variável	-3,96%	1,19%	-0,39%	-6,28%	-3,27%	0,86%							-11,48%
Estruturados	0,35%	-0,25%	0,65%	-1,23%	0,31%	0,82%							0,64%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%							0,00%
<b>PGA</b>	<b>0,77%</b>	<b>0,85%</b>	<b>0,92%</b>	<b>0,30%</b>	<b>0,72%</b>	<b>0,87%</b>							<b>4,51%</b>
<b>INPC + 4,00% a.a.</b>	<b>0,90%</b>	<b>1,14%</b>	<b>0,52%</b>	<b>0,70%</b>	<b>0,79%</b>	<b>0,58%</b>							<b>4,71%</b>
Renda Fixa	1,01%	1,02%	1,00%	0,74%	0,90%	0,85%							5,65%
Renda Variável	-3,96%	1,19%	-0,39%	-6,28%	-3,27%	0,86%							-11,48%
Estruturados	0,28%	-0,26%	0,72%	-1,14%	0,34%	0,97%							0,91%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%							0,00%
CDI + 2,00% a.a.	1,13%	0,97%	0,58%	1,05%	1,00%	0,95%							5,82%
INPC	0,57%	0,81%	0,59%	0,37%	0,46%	0,25%							3,09%
IPCA	0,42%	0,83%	0,52%	0,38%	0,46%	0,21%							2,85%
Ibovespa	-4,79%	0,99%	0,92%	-1,70%	-3,04%	1,48%							-6,15%
CDI	0,97%	0,80%	1,00%	0,89%	0,83%	0,79%							5,40%
Poupança	0,59%	0,51%	0,19%	0,60%	0,59%	0,54%							3,05%
IFIX	0,67%	0,79%	0,16%	-0,77%	0,02%	-1,04%							-0,18%
IMA-B	-0,45%	0,55%	-0,71%	-1,61%	1,33%	-0,97%							-1,87%

### Observações:

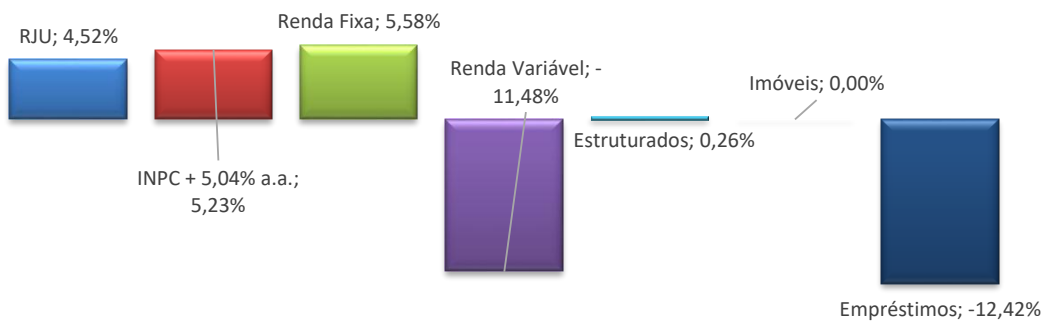
1. A rentabilidade do Plano PREVSIAS reflete a variação da cota do Plano, a qual leva em consideração a dedução da taxa de administração.
2. Benchmark = referência de rentabilidade. Definidos na Política de Investimentos 2024-2028.
3. Meta Atuarial => Plano CLT: INPC + 4,58% a.a.; Plano RJU: INPC + 5,04% a.a.; Plano PREVSIAS: INPC + 4,00% a.a.; Meta PGA => INPC + 4,00%
4. O Benchmark da Renda Fixa => Plano CLT: INPC + 4,58% a.a.; Plano RJU: INPC + 5,04% a.a.; Plano PREVSIAS e PGA: INPC + 4,00% a.a.
5. O Benchmark de Empréstimos => Plano CLT: INPC + 4,58% a.a.; Plano RJU: INPC + 5,04% 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 2024

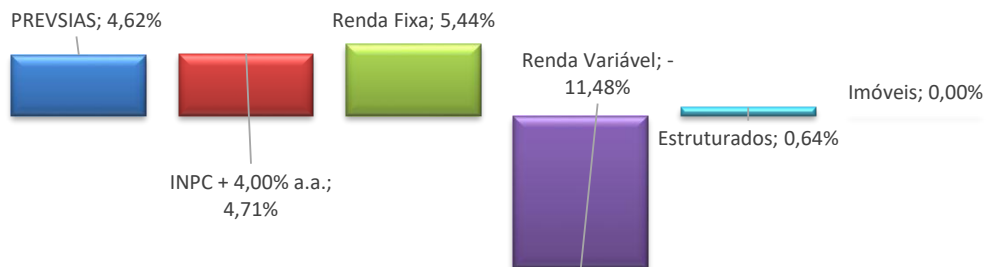
## CLT - Rentabilidade em 2024



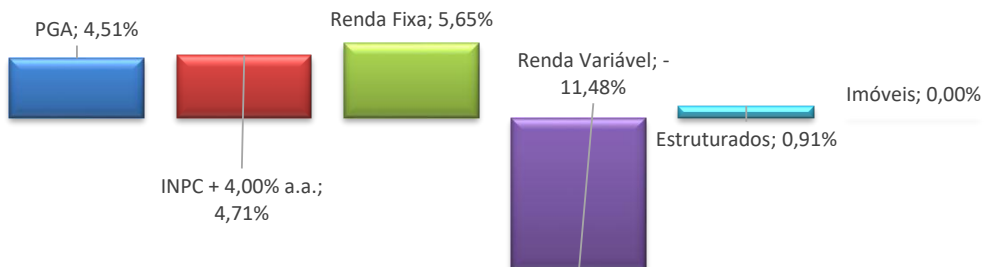
## RJU - Rentabilidade em 2024



## PREVSIAS - Rentabilidade em 2024



## PGA - Rentabilidade em 2024





## Histórico de Rentabilidade - Últimos 10 anos

	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024
<b>Segmentos</b>										
Renda Fixa	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	9,91%	10,41%	12,99%	12,41%	11,29%	5,66%
Renda Variável	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-18,98%	-10,43%	22,88%	-11,48%
Estruturados	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	4,62%	20,33%	8,57%	0,56%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	143,28%	0,00%	0,00%
Empréstimos	38,36%	9,55%	27,66%	-1,56%	-13,55%	32,33%	-14,54%	14,65%	14,47%	37,67%
CLT	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	11,35%	10,62%	4,59%
RJU	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	11,71%	10,89%	4,52%
PREVSIAS	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	13,18%	8,55%	4,62%
PGA	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	11,74%	10,79%	4,51%
<b>Indicadores</b>										
CDI	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	4,40%	12,36%	13,04%	5,40%
Poupança	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	2,99%	7,90%	8,04%	3,05%
IBOVESPA	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-11,93%	4,68%	22,28%	-6,15%
INPC	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	10,16%	5,93%	3,71%	3,09%
Meta PGA (NPC + 4,00%)	14,35%	15,14%	11,04%	7,48%	7,03%	3,79%	5,43%	13,48%	14,17%	4,71%
Meta PREVSIAS (NPC + 4,00%)	15,69%	10,83%	6,10%	7,54%	8,68%	9,65%	14,55%	10,17%	7,86%	4,71%
Meta CLT (NPC + 4,58%)	16,56%	11,66%	6,90%	8,35%	9,51%	10,48%	15,42%	11,01%	8,78%	5,00%
Meta RJU (NPC + 5,04%)	16,60%	11,70%	6,93%	8,38%	9,54%	10,51%	15,45%	11,04%	8,61%	5,23%

<b>Rentabilidade acumulada</b>										
	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024
CLT	16,40%	31,64%	45,26%	59,99%	81,72%	101,48%	117,91%	142,64%	168,40%	153,78%
RJU	16,40%	31,64%	45,26%	59,99%	81,72%	101,48%	117,91%	143,42%	169,92%	154,42%
PREVSIAS	16,40%	31,64%	45,26%	59,99%	81,72%	101,48%	117,91%	146,63%	167,71%	158,03%
PGA	16,40%	31,64%	45,26%	59,99%	81,72%	101,48%	117,91%	143,49%	169,77%	154,46%
CDI	13,25%	29,10%	41,94%	51,06%	60,08%	64,51%	71,74%	92,96%	118,12%	103,37%
Poupança	8,08%	17,05%	24,79%	30,56%	36,12%	39,00%	43,15%	54,45%	66,86%	59,16%
Meta PGA (NPC + 4,00%)	14,35%	31,66%	46,19%	57,13%	68,18%	74,55%	84,04%	108,85%	138,44%	118,69%
Meta PREVSIAS (NPC + 4,00%)	15,69%	28,22%	36,04%	46,29%	58,99%	74,33%	99,69%	120,00%	137,28%	130,36%
Meta CLT (NPC + 4,58%)	16,56%	30,16%	39,14%	50,75%	65,08%	82,38%	110,49%	133,66%	154,17%	145,35%
Meta RJU (NPC + 5,04%)	16,60%	30,23%	39,25%	50,92%	65,32%	82,69%	110,91%	134,19%	154,36%	146,45%

## Rentabilidade x Metas x Indicadores: últimos 10 anos

