

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

Julho 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/ Seq	% s/ RG	Valor de Mercado (Dez/2023)
RENDA FIXA	29.393.774,22	100,0	31,2	31.643.119,24
Títulos Públicos Federais	28.446.579,51	96,8	30,2	27.475.339,47
Quotas de Fundos de Investimentos	947.194,71	3,2	1,0	4.167.779,77
RENDA VARIÁVEL	902.930,83	100,0	1,0	981.480,85
Quotas de Fundos de Investimentos	902.930,83	100,0	1,0	981.480,85
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	3.922.497,12	100,0	4,2	3.841.225,96
Quotas de Fundos de Investimentos	3.922.497,12	100,0	4,2	3.841.225,96
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	47.483,09	100,0	0,1	11.239,40
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
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	6.750,71	100,0	0,0	10.038,65
Empréstimos e Financiamentos	6.750,71	100,0	0,0	10.038,65
Valores a receber	45.183,77	669,3	0,0	46.401,65
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	(38.433,06)	-569,3	0,0	(36.363,00)
OUTROS	60.002.368,13	100,0	63,6	57.999.454,72
IR a recuperar	564.451,55	0,9	0,6	-
Recursos a recuperar - OFND	58.629.580,46	97,7	62,2	57.191.118,60
Outros Realizáveis - Investimentos	808.336,12	1,3	0,9	808.336,12
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	94.275.804,10	100,0	99,9	94.486.558,82
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	49.690,85		0,1	1.127,45
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	94.325.494,95	100,0		94.487.686,27

Carteira de Investimentos RJU

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seq	% s/ RG	Valor de Mercado (Dez/2023)
RENDA FIXA	62.651.694,65	100,0	82,8	65.191.366,65
Títulos Públicos Federais	52.225.846,32	83,4	69,0	50.443.096,54
Quotas de Fundos de Investimentos	10.425.848,33	16,6	13,8	14.748.270,11
RENDA VARIÁVEL	1.654.357,71	100,0	2,2	1.798.277,73
Quotas de Fundos de Investimentos	1.654.357,71	100,0	2,2	1.798.277,73
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	8.788.920,73	100,0	11,6	8.636.730,72
Quotas de Fundos de Investimentos	8.788.920,73	100,0	11,6	8.636.730,72
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	213.509,19	100,0	0,3	46.933,92
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
EMPRÉSTIMOS E FINANCIAMENTOS	39.575,12	100,0	0,1	47.350,59
Empréstimos e Financiamentos	39.575,12	100,0	0,1	47.350,59
Valores a receber	4.843.685,56	12239,2	6,4	4.602.392,15
(-) Provisões para Créditos de Liquidação Duvidosa	(4.804.110,44)	-12139,2	-6,4	(4.555.041,56)
OUTROS	2.291.322,75	100,0	3,0	1.699.120,02
IR a recuperar	647.167,31	28,2	0,9	54.964,58
Outros Realizáveis - Investimentos	1.644.155,44	71,8	2,2	1.644.155,44
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	75.639.380,15	100,0	100,0	77.419.779,63
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	802,57		0,0	2.066,36
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	75.640.182,72	100,0	100,0	77.421.845,99

Carteira de Investimentos PREVSIAS

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seq	% s/ RG	Valor de Mercado (Dez/2023)
RENDA FIXA	9.233.206,90	100,0	87,0	8.796.471,87
Títulos Públicos Federais	4.973.422,59	53,9	46,9	4.801.661,26
Quotas de Fundos de Investimentos	4.259.784,31	46,1	40,1	3.994.810,61
RENDA VARIÁVEL	191.859,27	100,0	1,8	208.549,97
Quotas de Fundos de Investimentos	191.859,27	100,0	1,8	208.549,97
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	971.513,37	100,0	9,2	949.502,88
Quotas de Fundos de Investimentos	971.513,37	100,0	9,2	949.502,88
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	15.999,36	100,0	0,2	15.528,15
Valores a Receber	15.999,36	100,0	0,2	15.528,15
Direitos de alienações	-	0,0	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	199.209,23	100,0	1,9	251.271,21
IR a recuperar	199.209,23	100,0	1,9	251.271,21
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	10.611.788,13	100,0	100,0	10.221.324,08
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	1.121,78		0,0	1.979,16
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	10.612.909,91	100,0	100,0	10.223.303,24

Carteira de Investimentos PGA

Descrição	Valor de Mercado	% s/ Seg	% s/ RG	Valor de Mercado (Dez/2023)
RENDA FIXA	12.245.518,75	100,0	82,4	11.480.326,73
Títulos Públicos Federais	10.656.318,56	87,0	71,7	10.289.628,30
Quotas de Fundos de Investimentos	1.589.200,19	13,0	10,7	1.190.698,43
RENDA VARIÁVEL	366.948,02	100,0	2,5	398.870,48
Quotas de Fundos de Investimentos	366.948,02	100,0	2,5	398.870,48
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS	2.072.520,44	100,0	13,9	2.021.438,32
Quotas de Fundos de Investimentos	2.072.520,44	100,0	13,9	2.021.438,32
INVESTIMENTOS IMOBILIÁRIOS	23.008,36	100,0	0,2	226.298,32
Valores a Receber	23.008,36	100,0	0,2	226.298,32
Direitos de alienações	-	0,0	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	147.543,62	100	1,0	1.252.135,92
IR a recuperar	147.543,62	100	1,0	1.252.135,92
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	14.855.539,19	100,0		15.379.069,77
(+) Disponível (-) Exigíveis de Investimentos	2.809,32		0,0	4.247,03
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	14.858.348,51	100,0		15.383.316,80

Rentabilidade dos Investimentos em 2024

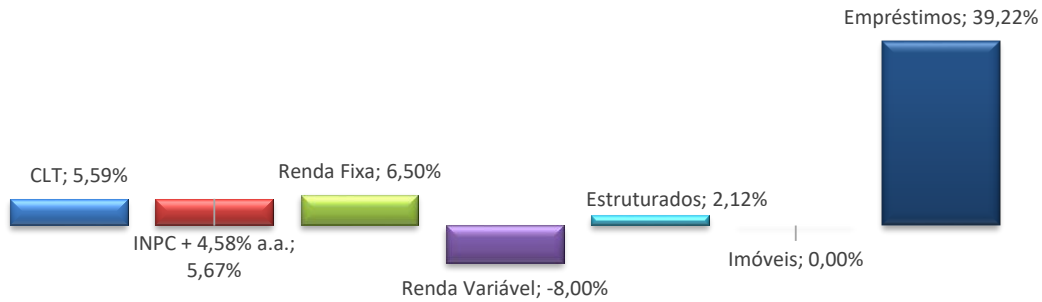
Descrição	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	Acum.
CLT	0,81%	0,85%	0,94%	0,33%	0,72%	0,84%	0,96%						5,59%
INPC + 4,58% a.a.	0,95%	1,19%	0,56%	0,75%	0,84%	0,62%	0,63%						5,67%
Renda Fixa	1,04%	1,00%	1,01%	0,74%	0,89%	0,85%	0,80%						6,50%
Renda Variável	-3,96%	1,19%	-0,39%	-6,28%	-3,27%	0,86%	3,93%						-8,00%
Estruturados	0,22%	-0,35%	0,77%	-1,23%	0,37%	0,79%	1,55%						2,12%
Imóveis	0,00%	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%	1,14%	1,10%						39,22%
RJU	0,81%	0,82%	0,92%	0,34%	0,73%	0,83%	0,96%						5,52%
INPC + 5,04% a.a.	0,98%	1,22%	0,60%	0,78%	0,87%	0,66%	0,67%						5,94%
Renda Fixa	1,04%	0,97%	0,98%	0,74%	0,88%	0,84%	0,81%						6,44%
Renda Variável	-3,96%	1,19%	-0,39%	-6,28%	-3,27%	0,86%	3,93%						-8,00%
Estruturados	0,13%	-0,36%	0,72%	-1,33%	0,35%	0,75%	1,50%						1,76%
Imóveis	0,00%	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%	-2,76%	-1,78%						-14,04%
PREVSIAS	0,85%	0,81%	0,89%	0,41%	0,74%	0,83%	0,98%						5,64%
PREVSIAS (Plano)	0,80%	0,79%	0,83%	0,37%	0,69%	0,78%	0,92%						5,30%
INPC + 4,00% a.a.	0,90%	1,14%	0,52%	0,70%	0,79%	0,58%	0,59%						5,33%
Renda Fixa	1,02%	0,92%	0,94%	0,74%	0,87%	0,83%	0,85%						6,34%
Renda Variável	-3,96%	1,19%	-0,39%	-6,28%	-3,27%	0,86%	3,93%						-8,00%
Estruturados	0,35%	-0,25%	0,65%	-1,23%	0,31%	0,82%	1,66%						2,32%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%						0,00%
PGA	0,77%	0,85%	0,92%	0,30%	0,72%	0,87%	0,99%						5,54%
INPC + 4,00% a.a.	0,90%	1,14%	0,52%	0,70%	0,79%	0,58%	0,59%						5,33%
Renda Fixa	1,01%	1,02%	1,00%	0,74%	0,90%	0,85%	0,80%						6,49%
Renda Variável	-3,96%	1,19%	-0,39%	-6,28%	-3,27%	0,86%	3,93%						-8,00%
Estruturados	0,28%	-0,26%	0,72%	-1,14%	0,34%	0,97%	1,60%						2,53%
Imóveis	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%						0,00%
CDI + 2,00% a.a.	1,13%	0,97%	1,00%	1,05%	1,00%	0,95%	1,07%						7,41%
INPC	0,57%	0,81%	0,19%	0,37%	0,46%	0,25%	0,26%						2,95%
IPCA	0,42%	0,83%	0,16%	0,38%	0,46%	0,21%	0,38%						2,87%
Ibovespa	-4,79%	0,99%	-0,71%	-1,70%	-3,04%	1,48%	3,02%						-4,87%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%						6,18%
Poupança	0,59%	0,51%	0,53%	0,60%	0,59%	0,54%	0,57%						4,00%
IFIX	0,67%	0,79%	1,43%	-0,77%	0,02%	-1,04%	0,52%						1,61%
IMA-B	-0,45%	0,55%	0,08%	-1,61%	1,33%	-0,97%	2,09%						0,97%

Observações:

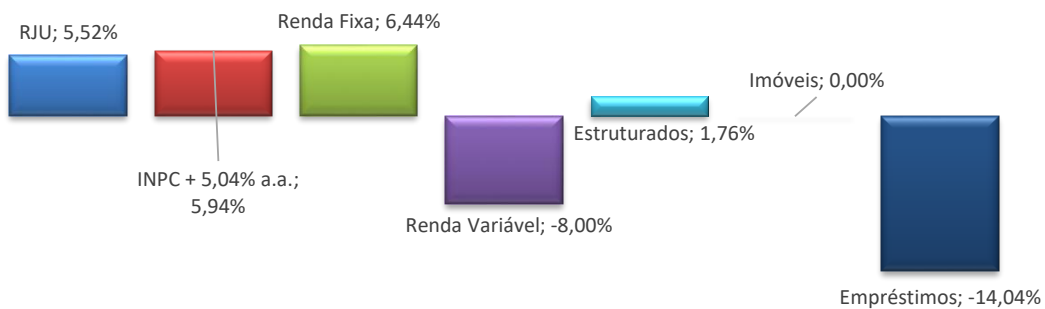
1. A rentabilidade do Plano PREVSIAS reflete a variação da cota do Plano, a qual leva em consideração a dedução da taxa de administração.
2. Benchmark = referência de rentabilidade. Definidos na Política de Investimentos 2024-2028.
3. Meta Atuarial => Plano CLT: INPC + 4,58% a.a.; Plano RJU: INPC + 5,04%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

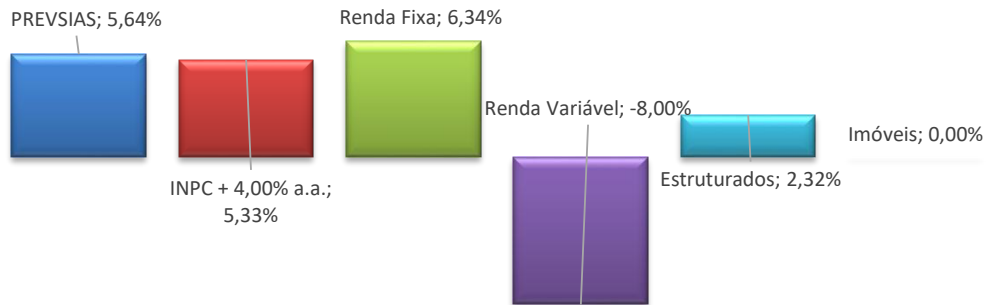
CLT - Rentabilidade em 2024



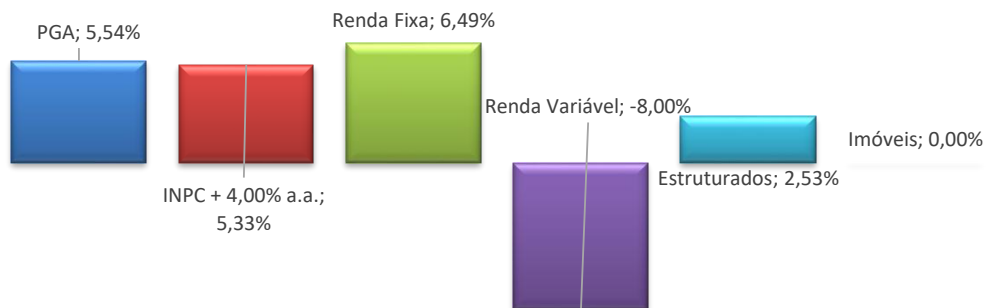
RJU - Rentabilidade em 2024



PREVSIAS - Rentabilidade em 2024



PGA - Rentabilidade em 2024



Histórico de Rentabilidade - Últimos 10 anos

	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024
Segmentos										
Renda Fixa	16,52%	13,17%	9,02%	10,17%	9,91%	10,41%	12,99%	12,41%	11,29%	6,50%
Renda Variável	3,33%	-1,94%	31,18%	6,84%	42,46%	3,39%	-18,98%	-10,43%	22,88%	-8,00%
Estruturados	16,42%	18,79%	13,88%	5,86%	8,99%	2,47%	4,62%	20,33%	8,57%	2,12%
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%	39,22%
CLT	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	11,35%	10,62%	5,59%
RJU	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	11,71%	10,89%	5,52%
PREVSIAS	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	13,18%	8,55%	5,64%
PGA	16,40%	13,10%	10,34%	10,14%	13,58%	10,87%	8,16%	11,74%	10,79%	5,54%
Indicadores										
CDI	13,25%	14,00%	9,95%	6,42%	5,97%	2,77%	4,40%	12,36%	13,04%	6,18%
Poupança	8,08%	8,30%	6,61%	4,62%	4,26%	2,11%	2,99%	7,90%	8,04%	4,00%
IBOVESPA	-13,30%	38,94%	26,86%	15,03%	31,58%	2,92%	-11,93%	4,68%	22,28%	-4,87%
INPC	11,28%	6,58%	2,07%	3,43%	4,48%	5,45%	10,16%	5,93%	3,71%	2,95%
Meta PGA (NPC + 4,00%)	14,35%	15,14%	11,04%	7,48%	7,03%	3,79%	5,43%	13,48%	14,17%	5,33%
Meta PREVSIAS (NPC + 4,00%)	15,69%	10,83%	6,10%	7,54%	8,68%	9,65%	14,55%	10,17%	7,86%	5,33%
Meta CLT (NPC + 4,58%)	16,56%	11,66%	6,90%	8,35%	9,51%	10,48%	15,42%	11,01%	8,78%	5,67%
Meta RJU (NPC + 5,04%)	16,60%	11,70%	6,93%	8,38%	9,54%	10,51%	15,45%	11,04%	8,61%	5,94%

Rentabilidade acumulada										
	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%	156,20%
RJU	16,40%	31,64%	45,26%	59,99%	81,72%	101,48%	117,91%	143,42%	169,92%	156,85%
PREVSIAS	16,40%	31,64%	45,26%	59,99%	81,72%	101,48%	117,91%	146,63%	167,71%	160,54%
PGA	16,40%	31,64%	45,26%	59,99%	81,72%	101,48%	117,91%	143,49%	169,77%	156,98%
CDI	13,25%	29,10%	41,94%	51,06%	60,08%	64,51%	71,74%	92,96%	118,12%	104,88%
Poupança	8,08%	17,05%	24,79%	30,56%	36,12%	39,00%	43,15%	54,45%	66,86%	60,62%
Meta PGA (NPC + 4,00%)	14,35%	31,66%	46,19%	57,13%	68,18%	74,55%	84,04%	108,85%	138,44%	119,98%
Meta PREVSIAS (NPC + 4,00%)	15,69%	28,22%	36,04%	46,29%	58,99%	74,33%	99,69%	120,00%	137,28%	131,72%
Meta CLT (NPC + 4,58%)	16,56%	30,16%	39,14%	50,75%	65,08%	82,38%	110,49%	133,66%	154,17%	146,91%
Meta RJU (NPC + 5,04%)	16,60%	30,23%	39,25%	50,92%	65,32%	82,69%	110,91%	134,19%	154,36%	148,11%

Rentabilidade x Metas x Indicadores: últimos 10 anos

