

# Informativo Mensal de Rentabilidade

## Setembro - 2021

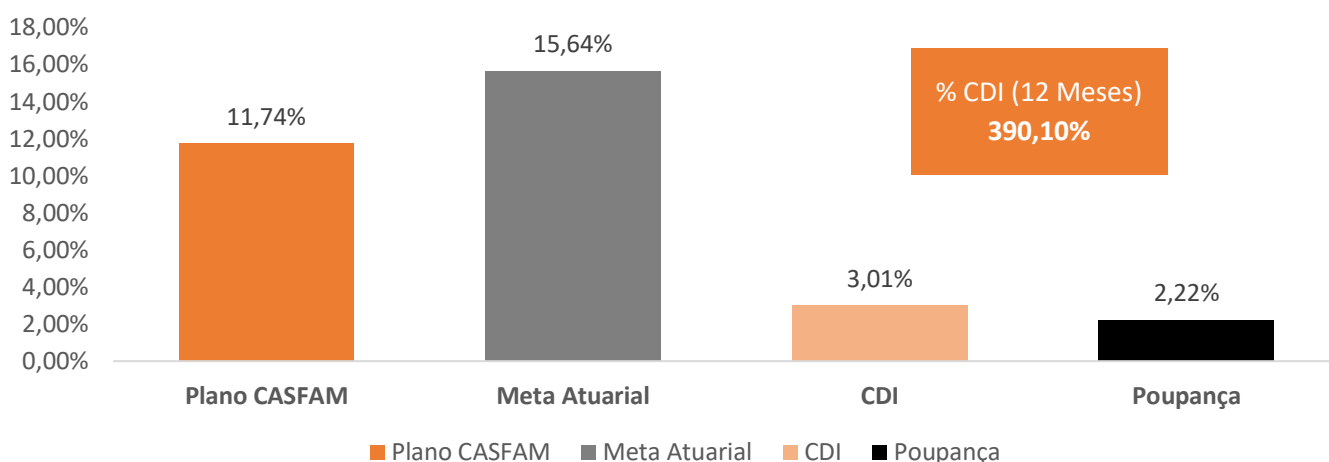


### Comentários:

O retorno do mês de setembro do Plano CASFAM foi de 0,96%, o que representa um acúmulo no ano de 7,64% e supera os principais índices de mercado (CDI: 2,53% no ano - Poupança: 1,85% no ano). Em relação à meta estabelecida para o plano (IPCA + 4,5%), a Mais Previdência atingiu 71,54%. Atualmente, a carteira de investimentos da entidade é, majoritariamente, composta por Títulos Públicos (NTN-B), que representam 77,44%. Sobre os resultados gerais, o segmento de Renda Fixa apresentou retorno de 1,59%, acumulando alta de 11,30% no ano. Já os demais segmentos apresentaram as seguintes rentabilidades: Renda Variável: -5,98% -Estruturado: -0,38% -Investimentos no Exterior: -0,11% -Investimentos Imobiliários: 0,34% - Operação com Participantes: 1,65%. A partir do mês de julho/2021, conforme aprovação do Conselho Deliberativo da Entidade, o indexador da meta atuarial passou a ser o IPCA ao invés de INPC.

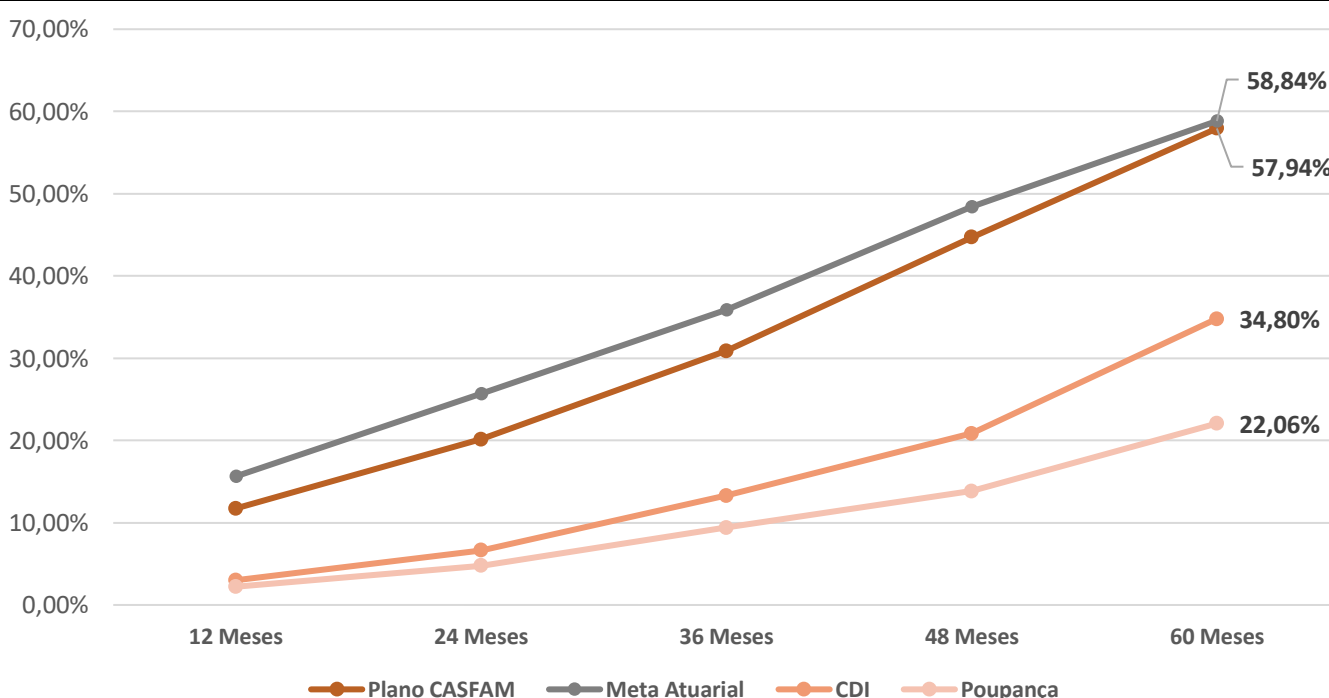
### Rentabilidades 12 Meses (%)

Plano	out/20	nov/20	dez/20	jan/21	fev/21	mar/21	abr/21	mai/21	jun/21	jul/21	ago/21	set/21	2021
<b>Plano CASFAM</b>	0,94%	1,33%	1,49%	1,03%	0,70%	1,24%	0,57%	0,89%	0,55%	0,79%	0,67%	0,96%	7,64%
<b>Meta Atuarial</b>	1,26%	1,32%	1,83%	0,64%	1,19%	1,23%	0,75%	1,33%	0,97%	1,33%	1,24%	1,53%	10,68%
<b>CDI</b>	0,16%	0,15%	0,16%	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,31%	0,36%	0,43%	0,44%	2,53%
<b>Poupança</b>	0,12%	0,12%	0,12%	0,12%	0,12%	0,14%	0,16%	0,20%	0,20%	0,24%	0,30%	0,36%	1,85%



### Rentabilidades acumulada (%)

Plano	12 Meses	24 Meses	36 Meses	48 Meses	60 Meses
<b>Plano CASFAM</b>	11,74%	20,14%	30,90%	44,72%	57,94%
Meta Atuarial	15,64%	25,71%	35,88%	48,46%	58,84%
CDI	3,01%	6,65%	13,32%	20,86%	34,80%
Poupança	2,22%	4,77%	9,42%	13,83%	22,06%

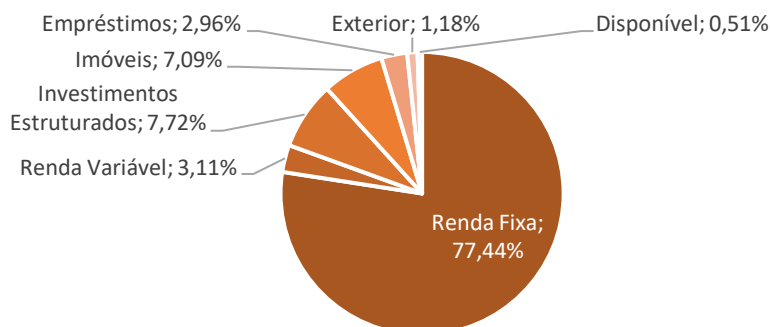


# Informativo Mensal de Rentabilidade

## Setembro - 2021



Segmento	Patrimônio (R\$)	% Alocação	Limites P. I
Renda Fixa	378.078.828	77,44%	100%
Renda Variável	15.161.518	3,11%	10%
Investimentos Estruturados	37.683.911	7,72%	15%
Imóveis	34.592.412	7,09%	10%
Empréstimos	14.428.900	2,96%	7%
Exterior	5.772.905	1,18%	5%
Disponível	2.486.044	0,51%	
<b>Total</b>	<b>484.922.280</b>		



Ativo	Saldo do Mês	% do Plano	Rentabilidade do Mês	Rentabilidade 2021
<b>Renda Fixa</b>	<b>378.078.827,98</b>	<b>77,44%</b>	<b>1,59%</b>	<b>11,30%</b>
NTN-B'S	362.808.552,26	74,31%	1,66%	11,86%
Debêntures	1.127.833,90	0,23%	-4,18%	20,04%
Itaú Soberano	2.180.873,44	0,45%	0,46%	2,23%
Votorantim Atuarial	7.111.654,80	1,46%	0,83%	3,45%
Icatu Vanguarda CP LP	4.060.415,55	0,83%	0,55%	1,84%
WA Max Ativo RF	710.744,80	0,15%	-0,30%	-5,62%
Fundo caixa*	42.881,13	0,01%	-	-
Disponível*	99,69	0,00%	-	-
Valores a receber/pagar*	35.772,41	0,01%	-	-
<b>Renda Variável</b>	<b>15.161.517,73</b>	<b>3,11%</b>	<b>-5,98%</b>	<b>-6,28%</b>
Navi Institucional FIA	4.633.072,77	0,95%	-4,54%	0,44%
Moat Capital FIC FIA	3.227.941,82	0,66%	-4,00%	-15,37%
Constellation Inst. FIA	7.300.503,14	1,50%	-7,76%	-8,68%
<b>Investimentos Estruturados</b>	<b>37.683.911,18</b>	<b>7,72%</b>	<b>-0,38%</b>	<b>-14,10%</b>
Provisão de perda <sup>1</sup>	(7.200.988,84)	-1,47%		
<b>FIP's</b>	<b>21.141.220,21</b>	<b>4,33%</b>	<b>-1,39%</b>	<b>10,02%</b>
Brasil Energia Renovável	522.815,84	0,11%	-0,12%	-4,21%
Oria Tech I	2.318.777,00	0,47%	-15,92%	9,30%
FIP Lacan Florestal	3.660.503,12	0,75%	-0,07%	4,14%
BTG Pactual Infra II	3.129.604,98	0,64%	-0,10%	15,17%
FIP Santo Antonio (PUT)	9.601.318,45	1,97%	1,51%	12,65%
FIP NORDESTE III	1.908.200,82	0,39%	0,20%	23,25%
<b>Multimercados Estruturados</b>	<b>23.743.679,80</b>	<b>4,86%</b>	<b>0,10%</b>	<b>2,12%</b>
Canvas Enduro FIC FIM	3.635.643,13	0,74%	-2,26%	-4,50%
Spx Nimitz Estruturado	6.776.951,94	1,39%	3,49%	9,48%
Giant Zarathustra FIC	4.208.376,59	0,86%	0,18%	6,72%
Vinland Macro FIC FIM	4.088.086,61	0,84%	2,23%	2,52%
Itaú Hedge Plus	5.034.621,53	1,03%	0,69%	0,69%
<b>Investimentos Exterior</b>	<b>5.772.905,45</b>	<b>1,18%</b>	<b>1,44%</b>	<b>15,32%</b>
FoF Itaú Global Eq.	5.772.905,45	1,18%	-0,11%	15,19%
<b>Imóveis</b>	<b>34.592.411,83</b>	<b>7,09%</b>	<b>0,34%</b>	<b>3,24%</b>
José de Alencar	9.357.622,61	1,92%	0,19%	2,10%
Villa Lobos	25.099.789,22	5,14%	0,40%	3,66%
Flat Maceió	135.000,00	0,03%	0,50%	4,62%
<b>Empréstimos</b>	<b>14.428.899,59</b>	<b>2,96%</b>	<b>1,65%</b>	<b>14,13%</b>
<b>Disponível</b>	<b>2.486.043,80</b>	<b>0,51%</b>		
<b>Total</b>	<b>488.204.517,54</b>			

\* ALOCAÇÃO NO MAIS PREVIDÊNCIA FIC FIM CP, CNPJ: 39.959.611/0001-05

<sup>1</sup> A rentabilidade do segmento estruturado tem sofrido impacto relevante devido ao provisionamento de perda do FIP Santo Antônio. O valor lançado contabilmente em PDD (Provisão de Devedores Duvidosos) de acordo com a Instrução PREVIC no 31/2020 é objeto de um processo de arbitragem em andamento na CAM-CCBC (CCBC Nº 99/2020/SEC5).