

Informativo Mensal de Rentabilidade

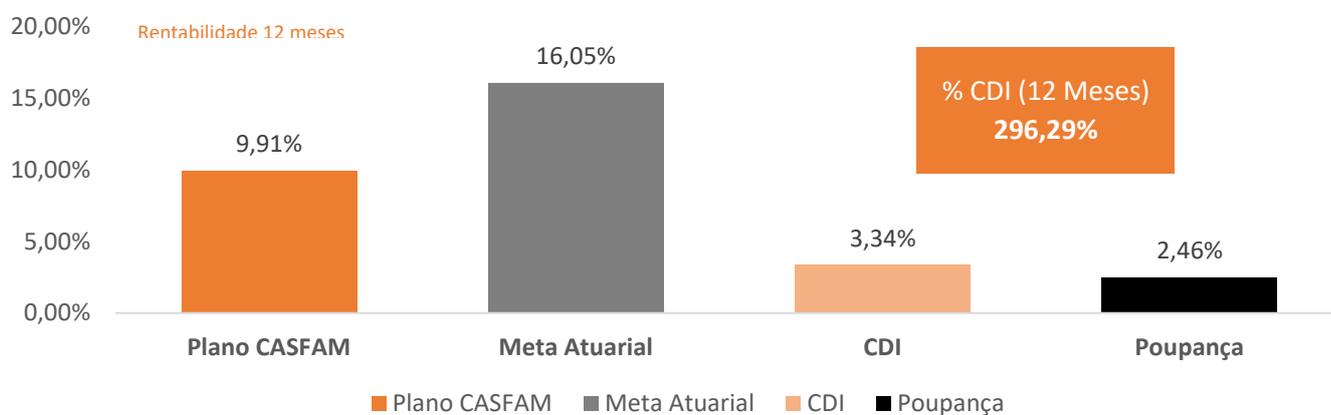
Outubro - 2021

Comentários:

O retorno do mês de outubro do Plano CASFAM foi de -0,70%, o que representa um acúmulo no ano de 6,88% e supera os principais índices de mercado (CDI: 3,02% no ano - Poupança: 2,22% no ano). Em relação à meta estabelecida para o plano (IPCA + 4,5%), a Mais Previdência atingiu 55,13%. Atualmente, a carteira de investimentos da entidade é, majoritariamente, composta por Títulos Públicos (NTN-B), que representam 79,08%. Sobre os resultados gerais, o segmento de Renda Fixa apresentou retorno de 1,43%, acumulando alta de 12,89% no ano. Já os demais segmentos apresentaram as seguintes rentabilidades: Renda Variável: -11,45% -Estruturado: -0,31% -Investimentos no Exterior: 9,05% -Investimentos Imobiliários: -21,82% - Operação com Participantes: 1,54%. No mês de Outubro/2021, ocorreu a reavaliação do imóvel RBA (Edifício FIEMG), com uma variação negativa de 7.978 Mil, -1,65% do patrimônio, impactando fortemente o desempenho mensal.

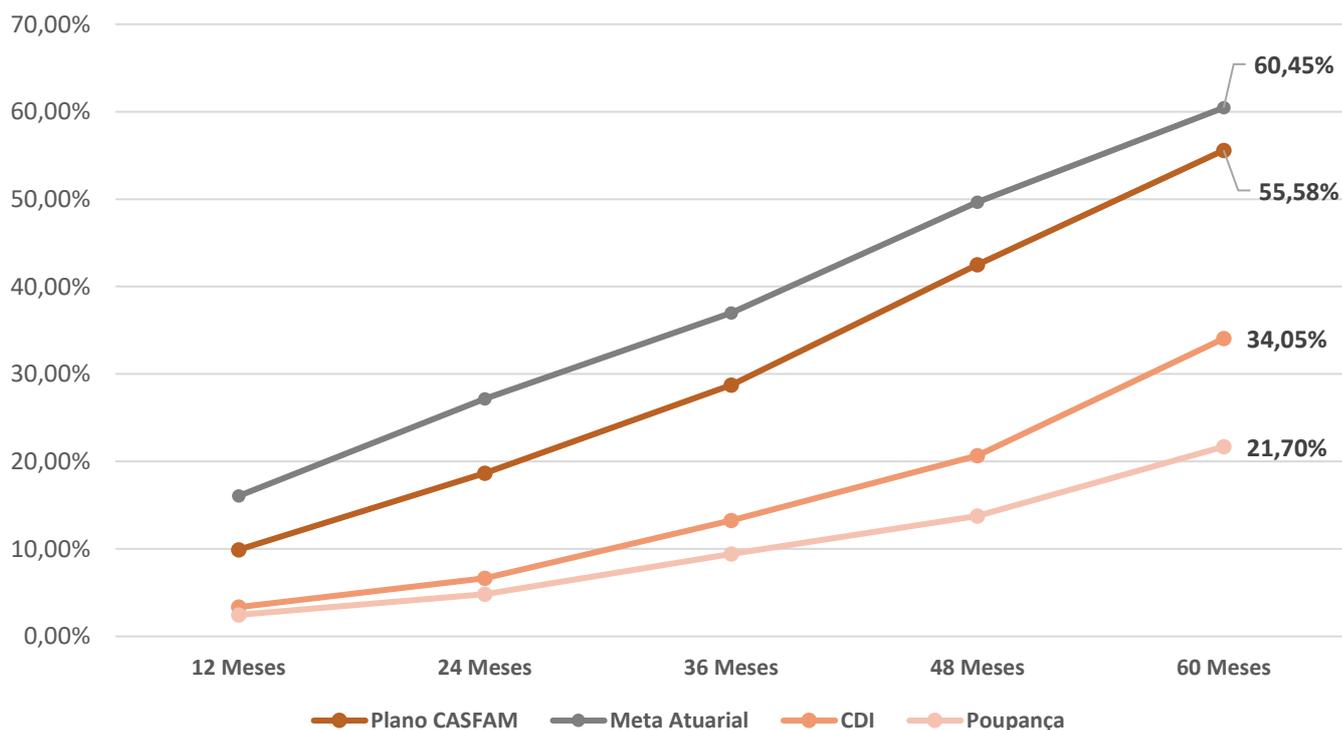
Rentabilidades 12 Meses (%)

Plano	out/20	nov/20	jan/21	fev/21	mar/21	abr/21	mai/21	jun/21	jul/21	ago/21	set/21	out/21	2021
Plano CASFAM	0,94%	1,33%	1,03%	0,70%	1,24%	0,57%	0,89%	0,55%	0,79%	0,67%	0,96%	-0,71%	6,88%
Meta Atuarial	1,26%	1,32%	0,64%	1,19%	1,23%	0,75%	1,33%	0,97%	1,33%	1,24%	1,53%	1,62%	12,48%
CDI	0,16%	0,15%	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,31%	0,36%	0,43%	0,44%	0,49%	3,02%
Poupança	0,12%	0,12%	0,12%	0,12%	0,14%	0,16%	0,20%	0,20%	0,24%	0,30%	0,36%	0,36%	2,22%



Rentabilidades acumulada (%)

Plano	12 Meses	24 Meses	36 Meses	48 Meses	60 Meses
Plano CASFAM	9,91%	18,65%	28,73%	42,49%	55,58%
Meta Atuarial	16,05%	27,18%	36,98%	49,67%	60,45%
CDI	3,34%	6,66%	13,26%	20,67%	34,05%
Poupança	2,46%	4,82%	9,41%	13,75%	21,70%

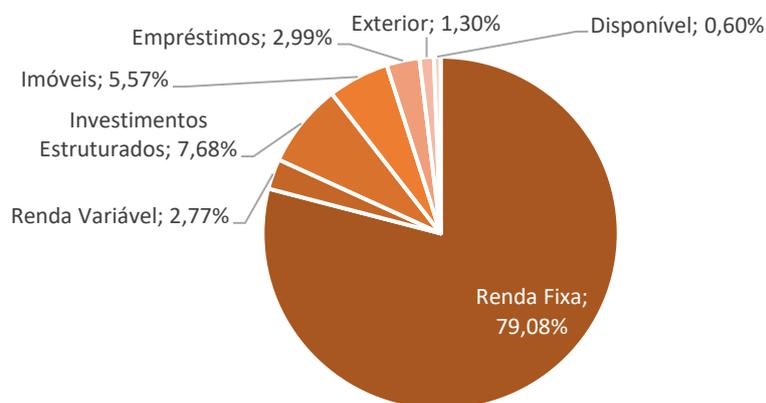


Informativo Mensal de Rentabilidade

Outubro - 2021



Segmento	Patrimônio (R\$)	% Alocação	Limites P. I
Renda Fixa	382.819.861	79,08%	100%
Renda Variável	13.416.643	2,77%	10%
Investimentos Estruturados	37.156.892	7,68%	15%
Imóveis	26.967.428	5,57%	10%
Empréstimos	14.496.159	2,99%	7%
Exterior	6.291.673	1,30%	5%
Disponível	2.926.305	0,60%	
Total	484.074.961		



Ativo	Saldo do Mês	% do Plano	Rentabilidade do Mês	Rentabilidade 2021
Renda Fixa	382.819.860,91	79,08%	1,43%	12,89%
NTN-B´S	368.240.772,83	76,07%	1,50%	13,54%
Debêntures	1.086.576,34	0,22%	2,12%	22,58%
Itaú Soberano	1.423.934,15	0,29%	0,49%	2,74%
Votorantim Atuarial	7.034.726,11	1,45%	-1,02%	2,39%
Icatu Vanguarda CP LP	4.083.058,28	0,84%	0,62%	2,47%
WA Max Ativo RF	705.111,48	0,15%	-0,73%	-6,31%
Fundo caixa*	69.954,85	0,01%	-	-
Disponível*	174,03	0,00%	-	-
Valores a receber/pagar*	175.552,83	0,04%	-	-
Renda Variável	13.416.642,86	2,77%	-11,45%	-17,02%
Navi Institucional FIA	4.161.249,73	0,86%	-10,13%	-9,73%
Moat Capital FIC FIA	2.894.583,08	0,60%	-10,27%	-24,06%
Constellation Inst. FIA	6.360.810,05	1,31%	-12,82%	-20,39%
Investimentos Estruturados	37.156.891,91	7,68%	-0,31%	-14,37%
Provisão de perda ¹	(7.323.897,05)	-1,51%		
FIP's	20.459.882,22	4,23%	-1,36%	8,52%
Brasil Energia Renovável	522.231,41	0,11%	-0,11%	-4,32%
Oria Tech I	2.005.504,83	0,41%	-13,51%	-5,47%
FIP Lacan Florestal	3.129.480,92	0,65%	-3,90%	0,08%
BTG Pactual Infra II	3.126.617,00	0,65%	-0,10%	15,06%
FIP Santo Antonio (PUT)	9.765.196,08	2,02%	1,71%	14,57%
FIP NORDESTE III	1.910.851,98	0,39%	0,14%	23,42%
Multimercados Estruturados	24.020.906,74	4,96%	1,22%	4,62%
Canvas Enduro FIC FIM	3.468.952,08	0,72%	-4,53%	-8,83%
Spx Nimitz Estruturado	6.887.740,88	1,42%	1,70%	11,34%
Giant Zarathustra FIC	4.409.470,64	0,91%	4,84%	11,89%
Vinland Macro FIC FIM	4.165.939,46	0,86%	0,59%	3,12%
Itaú Hedge Plus	5.088.803,69	1,05%	1,08%	1,78%
Investimentos Exterior	6.291.673,09	1,30%	9,05%	25,62%
FoF Itaú Global Eq.	6.291.673,09	1,30%	9,05%	25,62%
Imóveis	26.967.427,90	5,57%	-21,82%	-19,29%
José de Alencar	9.374.638,68	1,94%	0,37%	2,48%
Villa Lobos	17.457.789,22	3,61%	-30,26%	-27,71%
Flat Maceió	135.000,00	0,03%	0,50%	5,13%
Empréstimos	14.496.159,45	2,99%	1,54%	15,88%
Disponível	2.926.305,00	0,60%		
Total	484.074.961,12			

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

¹ 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).