

Informativo Mensal de Rentabilidade

Maio - 2021

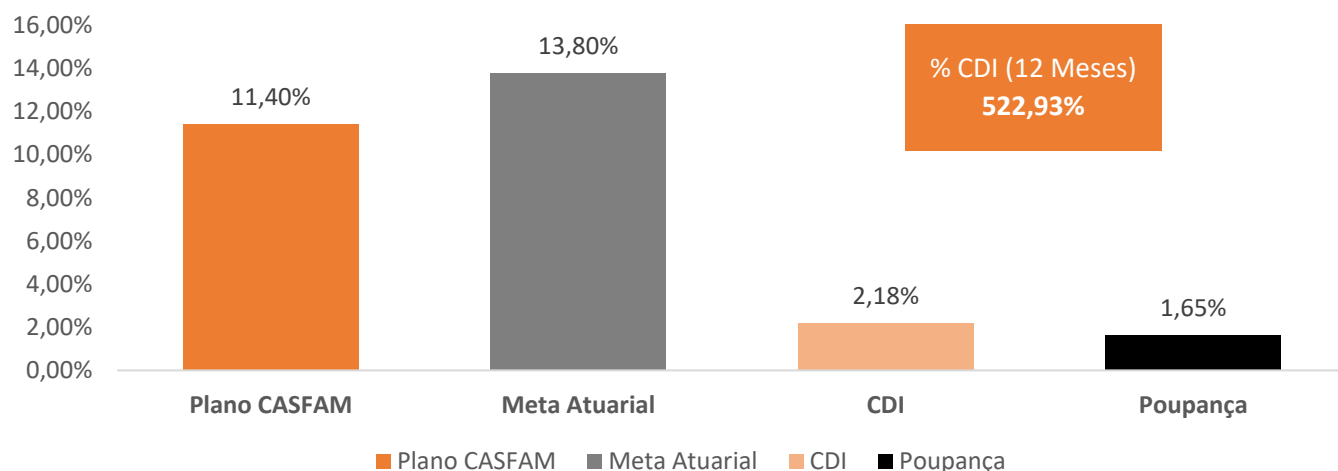


Comentários:

O retorno do mês de maio do Plano CASFAM foi de 0,89%, o que representa um acúmulo no ano de 4,51% e supera os principais índices de mercado (CDI: 0,97% - Poupança: 0,74%). Em relação à meta estabelecida para o plano (INPC + 4,5%), a Mais Previdência atingiu 85,98%. Atualmente, a carteira de investimentos da entidade é, majoritariamente, composta por Títulos Públicos (NTN-B), que representam 76,43%. Sobre os resultados gerais, o segmento de Renda Fixa apresentou retorno de 1,00%, acumulando alta de 5,64% no ano. Já os demais segmentos apresentaram as seguintes rentabilidades no mês: Renda Variável: 5,17% - Estruturado: 0,48% - Investimentos no Exterior: -4,08% - Investimentos Imobiliários: 0,36% - Operação com Participantes: 1,54%.

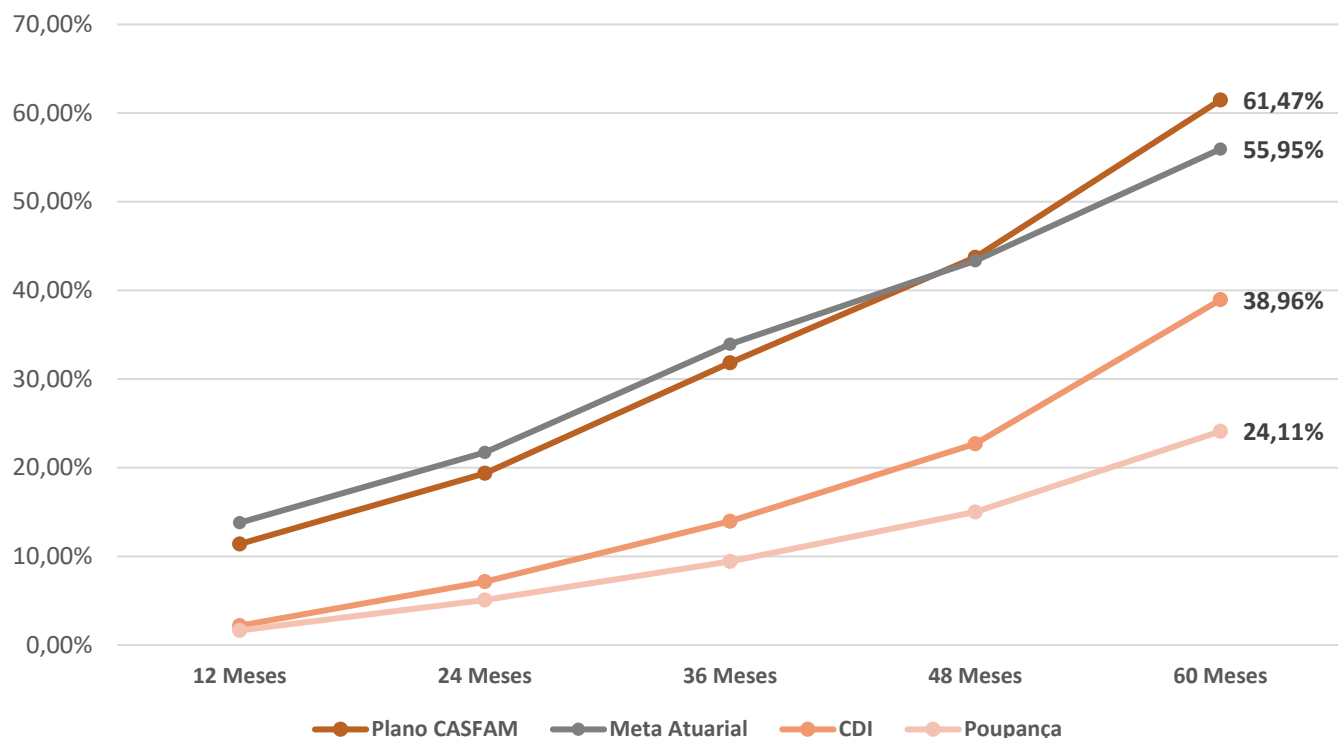
Rentabilidades 12 Meses (%)

Plano	jun/20	jul/20	ago/20	set/20	out/20	nov/20	dez/20	jan/21	fev/21	mar/21	abr/21	mai/21	2021
Plano CASFAM	0,61%	0,96%	0,56%	0,53%	0,94%	1,33%	1,49%	1,03%	0,70%	1,24%	0,57%	0,89%	4,51%
Meta Atuarial	0,67%	0,81%	0,73%	1,24%	1,26%	1,32%	1,83%	0,64%	1,19%	1,23%	0,75%	1,33%	5,24%
CDI	0,22%	0,19%	0,16%	0,16%	0,16%	0,15%	0,16%	0,15%	0,13%	0,20%	0,21%	0,27%	0,97%
Poupança	0,17%	0,13%	0,13%	0,12%	0,12%	0,12%	0,12%	0,12%	0,12%	0,14%	0,16%	0,20%	0,74%



Rentabilidades acumulada (%)

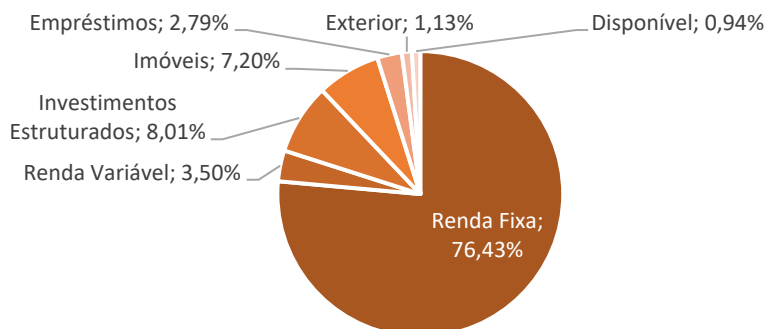
Plano	12 Meses	24 Meses	36 Meses	48 Meses	60 Meses
Plano CASFAM	11,40%	19,37%	31,83%	43,74%	61,47%
Meta Atuarial	13,80%	21,73%	33,94%	43,34%	55,95%
CDI	2,18%	7,15%	13,96%	22,70%	38,96%
Poupança	1,65%	5,07%	9,43%	15,01%	24,11%



Informativo Mensal de Rentabilidade

Maio - 2021

Segmento	Patrimônio (R\$)	% Alocação	Limites P.I
Renda Fixa	367.212.470	76,43%	100%
Renda Variável	16.798.680	3,50%	10%
Investimentos Estruturados	38.463.159	8,01%	15%
Imóveis	34.592.497	7,20%	10%
Empréstimos	13.423.684	2,79%	7%
Exterior	5.449.661	1,13%	5%
Disponível	4.507.727	0,94%	
Total	480.447.878		



Ativo	Saldo do Mês	% do Plano	Rentabilidade do Mês	Rentabilidade 2021
Renda Fixa	367.212.469,67	76,43%	1,00%	5,64%
NTN-B'S	348.235.011,49	72,48%	1,02%	5,93%
Debêntures	1.203.204,74	0,25%	6,69%	28,06%
Itaú Soberano	3.061.780,22	0,64%	0,19%	0,70%
Votorantim Atuarial	6.983.769,18	1,45%	0,89%	1,63%
WA Max Ativo RF	7.728.704,04	1,61%	0,07%	-3,96%
Renda Variável	16.798.679,87	3,50%	5,17%	4,06%
Navi Institucional FIA	5.006.033,40	1,04%	7,74%	8,79%
Moat Capital FIC FIA	3.776.453,05	0,79%	7,25%	-0,74%
Constellation Inst. FIA	8.016.193,42	1,67%	2,70%	0,51%
Investimentos Estruturados	38.463.159,25	8,01%	0,48%	4,13%
FIP's	18.043.911,69	3,76%	0,43%	5,43%
Brasil Energia Renovável	554.483,78	0,12%	-0,14%	1,87%
Oria Tech I	1.898.043,37	0,40%	-0,03%	-9,99%
FIP Lacan Florestal	3.671.297,10	0,76%	-0,07%	4,45%
BTG Pactual Infra II	3.143.312,72	0,65%	-0,12%	15,68%
FIP Santo Antonio (PUT)	9.082.940,94	1,89%	0,95%	6,57%
FIP NORDESTE III	1.964.569,02	0,41%	0,45%	21,58%
Provisão de perda	(2.270.735,24)	-0,47%		
Multimercados Estruturados	20.419.247,56	4,25%	0,54%	2,37%
Ibiuna Hedge FIC FIM	5.164.913,91	1,08%	0,26%	2,49%
Canvas Enduro FIC FIM	3.817.271,07	0,79%	1,30%	0,31%
Absolute Alpha Global	4.769.961,19	0,99%	0,28%	1,68%
Spx Nimitz Estruturado	2.598.305,18	0,54%	-0,58%	6,73%
Giant Zarathustra FIC	4.068.796,21	0,85%	1,18%	3,24%
Investimentos Exterior	5.449.660,96	1,13%	-4,08%	7,60%
FoF Itaú Global Eq.	5.449.660,96	1,13%	-4,08%	7,60%
Imóveis	34.592.497,08	7,20%	0,36%	1,83%
José de Alencar	9.357.707,86	1,95%	0,26%	1,31%
Villa Lobos	25.099.789,22	5,22%	0,40%	2,02%
Flat Maceió	135.000,00	0,03%	0,50%	2,54%
Empréstimos	13.423.684,18	2,79%	1,54%	7,97%
Disponível	4.507.727,08	0,94%		

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

Relatório de Enquadramento - Limites CMN 4.661

REGRAS BACEN 4.661	Limite	Posição	Situação	Recursos Garantidores	480.414.386,40
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 22 - RF 100%	100,00%	76,61%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 21 I "a", "b" - RF Tit. Fed / ETF TIT PUB - 100%	100,00%	75,13%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 21 § 1º - RF 80% Total dos Incisos II e III	80,00%	1,48%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 21 II 'a', 'b' e 'c' - RF 80%	80,00%	1,46%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 21 III a, b, c, d, e, f - RF 20%	20,00%	0,01%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 21 III 'a' - RF 20% Títulos Estad e Municipais	20,00%	0,00%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 21 III 'b' - RF 20% Organismos Multilaterais	20,00%	0,00%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 21 III c - RF 20% IF Ñ Bancárias, Coop. Crédito	20,00%	0,00%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 21 III 'd' - RF 20% Debêntures Capital Fechado	20,00%	0,00%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 21 III 'e' - RF 20% FIDC, FIC FIDC, CCB, CCCB	20,00%	0,01%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 21 III 'f' - RF 20% CPR/CDCA/CRA/WA	20,00%	0,00%	Enquadrado		
• Vedação - LE - CMN 4.661 - Art. 21 § 2º - RF Compromissadas Lastro Privado	0,00%	0,00%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 22 - RV 70%	70,00%	3,24%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 22 I - RV 70% (Ações Segmento Especial)	70,00%	2,98%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 22 II - RV 50% (Ações Sem Segmento Especial)	50,00%	0,17%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 22 III - RV 10% (BDR N II e N III)	10,00%	0,09%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 22 IV - RV 3% (Ouro Físico - BM&F)	3,00%	0,00%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 23 - Estruturados 20% (Total)	20,00%	6,76%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 23 I 'a' - Estruturados 15% (FIP Entid Invest)	15,00%	2,50%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 23 I 'b' - Estruturados 15% (FIM / FIC FIM)	15,00%	4,26%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 23 I 'c' - Estruturados 15% (Ações M Acesso)	15,00%	0,00%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 23 II - Estruturados 10% (COE)	10,00%	0,00%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 24 - Segmento Imobiliário 20%	20,00%	7,20%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 25 - Operações com Participantes 15% (Total)	15,00%	2,79%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 26 - Segmento Exterior 10% (Total)	10,00%	1,20%	Enquadrado		
• Vedação - LE - CMN 4.661 - Art. 26 - Segmento Exterior § 3º	0,00%	0,00%	Enquadrado		
• Vedação - LE - CMN 4.661 - Art. 26 - Segmento Exterior § 4º	0,00%	0,00%	Enquadrado		
• Vedação - LE - CMN 4.661 - Art. 29 - Empréstimos Tomados	0,00%	0,00%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 30 V - 15% Margem Derivativos	15,00%	0,00%	Enquadrado		
• Limites - LE - CMN 4.661 - Art. 30 VI - Prêmios Pagos	5,00%	0,03%	Enquadrado		
• Vedação - LE - CMN 4.661 - Art. 36 III - Títulos Pessoa Física	0,00%	0,00%	Enquadrado		
• Vedação - LE - CMN 4.661 - Art. 36 VII 'a' - Opções a Descoberto	0,00%	0,00%	Enquadrado		
• Vedação - LE - CMN 4.661 - Art. 36 VII 'b' - Perda Superior ao PL	100,00%	1,67%	Enquadrado		

Relatório de Enquadramento - Concentração CMN 4.661

Main table with columns: CONCENTRAÇÃO - LE - CMN 4.661 - ART. 27 III - 100% INST. NÍ FINANC / NÍ BANCÁRIAS, Base de Cálculo, Limite Máximo, Posição, CONCENTRAÇÃO - LE - CMN 4.661 - ART. 27 I - 100% TESOURO NACIONAL, Base de Cálculo, Limite Máximo, Posição. Includes sub-sections for ART. 27 II and ART. 28.

CONCENTRAÇÃO - LE. CMN 4.661 - ART. 23 II 'C' - 25% PL FI ETF RF E FI ETF RV

Base de Cálculo Limite Máximo Posição

DEBN CVRDA6	388.559.056,00	25,00%	0,00%
DEBN ELPLB4	800.000,00	25,00%	0,02%
DEBN ENEV32	500.000,00	25,00%	0,10%
DEBN ENGA1	500.000,00	25,00%	0,05%
DEBN ENTV12	1.000.000,00	25,00%	0,01%
DEBN GEPA27	200.000,00	25,00%	0,06%
DEBN IRBR21	147.000,00	25,00%	0,23%
DEBN JSML28	71.751,00	25,00%	1,35%
DEBN NED016	802.746,00	25,00%	0,07%
DEBN RDC034	25.500,00	25,00%	0,01%
DEBN SBED31	10.600,00	25,00%	0,08%
DEBN TAE33	702.000,00	25,00%	0,02%
DEBN TERP34	12.000,00	25,00%	0,14%
DEBN TIET29	641.090,00	25,00%	0,07%

Relatório de Enquadramento - Limites POLÍTICA EFPC

POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	Limite	Posição	Situação
• Limites - OP - Ativos de RF - Total (100%)	100,00%	76,62%	Enquadrado
• Limites - OP - RF Títulos do Tesouro Nacional	100,00%	75,13%	Enquadrado
• Limites - OP - RF ETF Renda Fixa de Títulos Públicos	100,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - RF Emissão Financeira.	80,00%	0,20%	Enquadrado
• Limites - OP - RF Emissão Capital Aberto	80,00%	1,25%	Enquadrado
• Limites - OP - RF ETF Renda Fixa.	80,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - RF Títulos Estaduais e Municipais.	20,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - RF Organismos Multilaterais.	20,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - RF de Inst Financ Não Bancárias.	20,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - RF Debêntires de Emissão Capital Fechado.	20,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - FIDC; FIC FIDC; CCB; CCCB.	20,00%	0,01%	Enquadrado
• Limites - OP - RF CPR/CDCA/CRA/WA	20,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - RV Total (20%)	30,00%	3,24%	Enquadrado
• Limites - OP - RV Segmento Especial de Listagem + ETF RV	10,00%	2,98%	Enquadrado
• Limites - OP - RV Não Classificadas	10,00%	0,17%	Enquadrado
• Limites - OP - RV BDR Nivel II e III	10,00%	0,09%	Enquadrado
• Limites - OP - RV Ouro Físico BM&F	3,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - Ativos Estruturados Total (15%)	15,00%	6,76%	Enquadrado
• Limites - OP - Estruturados FI e FIC Participações	15,00%	2,50%	Enquadrado
• Limites - OP - Estruturados FIM / FIC FIM	15,00%	4,26%	Enquadrado
• Limites - OP - Estruturados FIA Mercado de Acesso	15,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - Estruturados COE (Cert Oper Estruturadas)	10,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - Imobiliário Total	15,00%	7,20%	Enquadrado
• Limites - OP - Imobiliários FII	10,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - Imobiliário CRI	10,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - Imobiliário CCI	10,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - Imobiliário Estoque	-	7,20%	Transição
• Limites - OP - Participantes Total (0%)	15,00%	2,79%	Enquadrado
• Limites - OP - Participantes (Emprest Pessoais)	15,00%	2,79%	Enquadrado
• Limites - OP - Participantes (Financ Imobiliários)	15,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - Segmento Exterior Total (10%)	10,00%	1,20%	Enquadrado
• Limites - OP - Investimentos no Exterior - FI e FIC DIV EXT	5,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - Investimentos no Exterior - ETFs IND EXT	5,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - Investimento no Exterior - FDO INV EXT (sufixo)	5,00%	1,13%	Enquadrado
• Limites - OP - BDR N1 / FIA BDR N1	10,00%	0,00%	Enquadrado
• Limites - OP - Outros Ativos Financeiros no Exterior	10,00%	0,06%	Enquadrado

MELNICK DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO S.A.	1.154.604.049,43	25,00%	0,00%
MAGAZINE LUIZA SA	6.070.911.472,00	25,00%	0,00%
MOSAICO TECNOLOGIA AO CONSUMIDOR S.A	642.032.915,89	25,00%	0,00%
MRV ENGENHARIA PARTICIPAÇÕES SA	4.974.532.450,51	25,00%	0,00%
MITRE REALTY EMPREENDIMENTOS E PARTICIPAÇÕES S.A.	1.014.924.026,00	25,00%	0,00%
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS SA	2.988.062.190,88	25,00%	0,00%
NEOENERGIA S.A.	12.919.982.151,70	25,00%	0,00%
NATURA & CO HOLDING S.A.	12.608.451.461,48	25,00%	0,00%
OI SA	32.538.937.370,00	25,00%	0,00%
OCEANPACT SERVICOS MARITIMOS S.A.	842.999.412,29	25,00%	0,00%
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	205.431.960.490,52	25,00%	0,00%
PET CENTER COMERCIO E PARTICIPACOES S.A.	409.041.134,42	25,00%	0,03%
RAIA DROGASIL SA	2.500.000.000,00	25,00%	0,00%
REDE DOR SAO LUIZ S.A	6.686.996.232,17	25,00%	0,00%
PETRORECONDICAO S.A.	1.992.316.637,37	25,00%	0,00%
LOCALIZA RENT A CAR S.A.	4.000.000.000,00	25,00%	0,01%
CIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO DE SAO PAULO	15.000.000.000,00	25,00%	0,00%
GRUPO DE MODA SOMA S.A.	1.493.839.687,92	25,00%	0,01%
TM S.A.	13.477.990.507,55	25,00%	0,00%
TOTVS SA	1.382.508.564,43	25,00%	0,05%
VALE SA	77.300.000.000,00	25,00%	0,00%
VIA VAREJO SA	5.133.378.349,12	25,00%	0,00%
WEG SA	5.504.516.508,00	25,00%	0,00%

CONCENTRAÇÃO - OP - TITULOS MESMA SÉRIE (DEBÊNTURES)	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
DEBN CMGD27	1.500.000,00	15,00%	0,01%
DEBN CPGT26	200.000,00	10,00%	0,15%
DEBN CVRD46	388.559.056,00	15,00%	0,00%
DEBN ELPLB4	800.000,00	15,00%	0,02%
DEBN ENEV22	900.000,00	15,00%	0,10%
DEBN ENGJA1	500.000,00	15,00%	0,05%
DEBN ENTV12	1.000.000,00	15,00%	0,01%
DEBN GEP427	200.000,00	15,00%	0,06%
DEBN IRBR21	147.000,00	15,00%	0,23%
DEBN JSML29	71.751,00	15,00%	1,35%
DEBN NEDE16	802.746,00	15,00%	0,07%
DEBN RDCC034	25.500,00	15,00%	0,01%
DEBN SSEED31	10.600,00	15,00%	0,08%
DEBN TAEES3	702.000,00	15,00%	0,02%
DEBN TEOP34	12.000,00	15,00%	0,14%
DEBN TIET29	641.090,00	15,00%	0,07%

CONCENTRAÇÃO - OP - ETF INDICE EXTERIOR	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-

CONCENTRAÇÃO - OP - ETF INDICE EXTERIOR (PL FDO INVESTIDO)	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-

CONCENTRAÇÃO - OP - FDO INV EXT (SUFIXO) CONDOMÍNIO ABERTO	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-

FOF MULTI GLOBAL EQUITIES FICFIM EX	480.447.782,20	10,00%	1,13%
-------------------------------------	----------------	--------	-------

CONCENTRAÇÃO - OP - FDO INV EXT (SUFIXO) COND ABERTO (PL FDO INVESTIDO)	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-

FOF MULTI GLOBAL EQUITIES FICFIM EX	511.346.166,05	100,00%	1,06%
-------------------------------------	----------------	---------	-------

CONCENTRAÇÃO - OP - BDR N I (CAPITAL EMISSOR)	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-

CONCENTRAÇÃO - OP - FIA BDR N I (PL FDO INVESTIDO)	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-

CONCENTRAÇÃO - OP - ATIVOS FINANCEIROS EXTERIOR	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-

CONCENTRAÇÃO - OP - ATIVOS FINANCEIROS EXTERIOR (PL EMISSOR)	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-

CONCENTRAÇÃO - OP - EMISSOR TESOIRO NACIONAL	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
SECRETARIA DO TESOIRO NACIONAL	480.447.782,20	100,00%	75,13%

CONCENTRAÇÃO - OP - EMISSOR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	480.447.782,20	20,00%	0,20%

CONCENTRAÇÃO - OP - EMISSOR ETF RF TIT PUBLICOS	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-

CONCENTRAÇÃO - OP - EMISSOR TESOIRO ESTADUAL E MUNICIPAL	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-

CONCENTRAÇÃO - OP - EMISSOR ORGANISMO MULTILATERAL	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-

CONCENTRAÇÃO - OP - EMISSOR FIDC E FIC FIDC	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
FIDC CELG DISTRIBUIÇÃO	480.447.782,20	25,00%	0,01%
FIDC SANEAMENTO DE GOIAS S.A. SANEAGO INFRAESTRUT	480.447.782,20	25,00%	0,00%

CONCENTRAÇÃO - OP - EMISSORES PL DE INSTITUIÇÃO FINANCEIRA	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
ITAU UNIBANCO HOLDING S.A.	143.813.000.000,00	20,00%	0,00%

CONCENTRAÇÃO - OP - EMISSORES ETF RF (PL FDO INVESTIDO)	Base de Cálculo	Limite Máximo	Posição
-	-	-	-