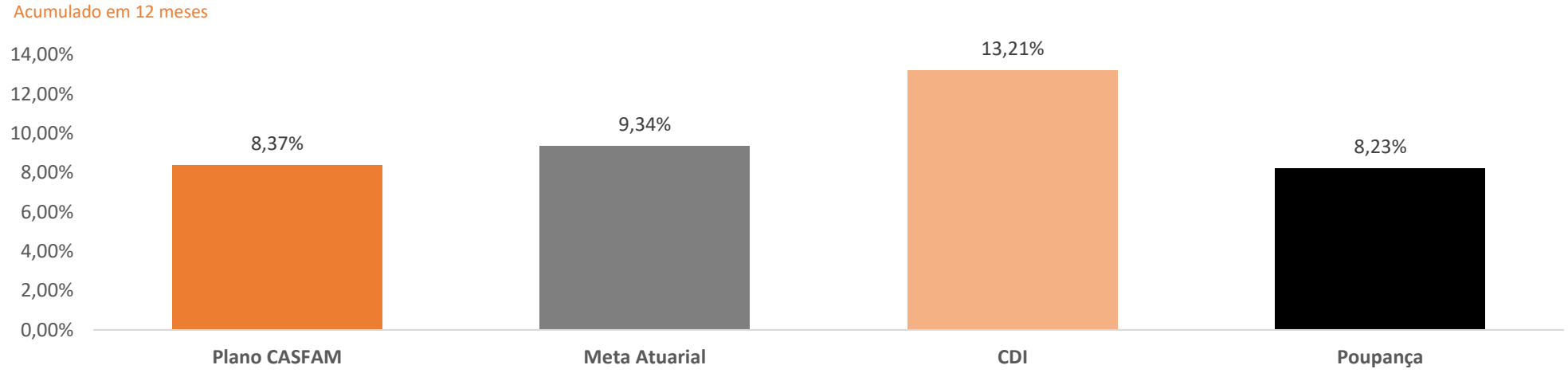
Informativo Mensal de Rentabilidade – Plano CASFAM
Março - 2023

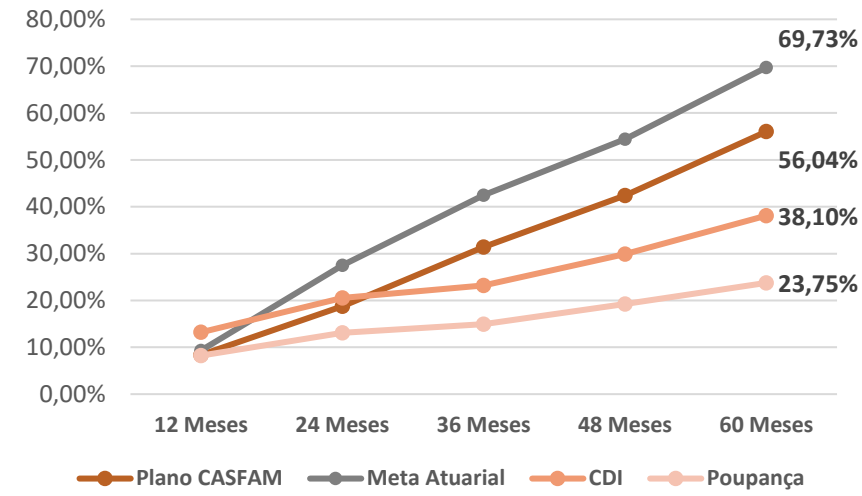
O mês de março foi marcado por uma reviravolta dos mercados globais. A expectativa de retomada de crescimento global, com a reabertura em curso da China, os Estados Unidos apresentando dados de atividade econômica acima do esperado e a Europa se recuperando de um choque de energia, apontavam para um cenário mais positivo. Repentinamente, o 16º maior banco por ativos norte-americanos quebra, seguido por dois outros menores, causando tensões financeiras relevantes. Nesse ambiente, a aversão ao risco por parte dos investidores, desfavorece particularmente os países emergentes. A redução da demanda por moedas emergentes provoca a valorização do dólar, e consequentemente, mais inflação. Por outro lado, o abalo na economia global tende a puxar os preços das commodities para baixo, aliviando em parte a inflação. Em março, o plano atingiu 1,03%. Sobre os resultados gerais, o segmento de Renda Fixa apresentou retorno de 0,98%. Já os demais segmentos apresentaram as seguintes rentabilidades mensais: Renda Variável: -4,98%; Estruturado: -0,28%; Investimentos no Exterior: 0,26% - Investimentos Imobiliários: 0,20% - Operação com Participantes: 1,14%.

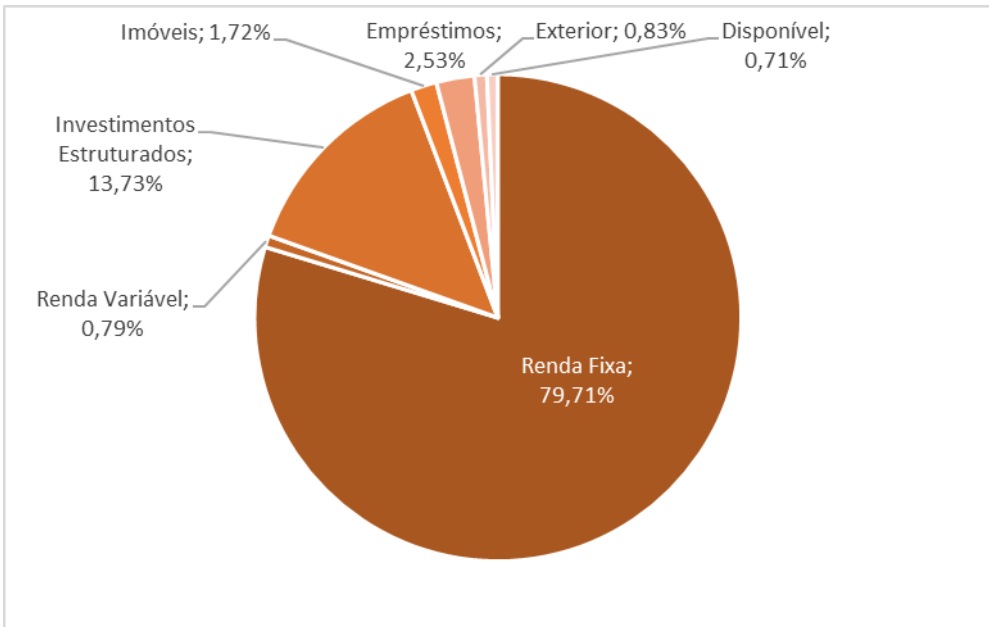
Rentabilidade 12 meses

Plano	abr/22	mai/22	jun/22	jul/22	ago/22	set/22	out/22	nov/22	dez/22	jan/23	fev/23	mar/23	2023
Plano CASFAM	1,18%	1,07%	0,57%	0,45%	0,29%	0,42%	0,48%	0,43%	0,68%	**0,92%**	**0,55%**	**1,03%**	**2,52%**
Meta Atuarial	1,43%	0,84%	1,04%	-0,29%	0,01%	0,08%	0,96%	0,78%	0,99%	**0,89%**	**1,20%**	**1,07%**	**3,19%**
CDI	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%	**1,12%**	**0,92%**	**1,12%**	**3,19%**
Poupança	0,55%	0,60%	0,69%	0,70%	0,71%	0,68%	0,65%	0,65%	0,71%	**0,71%**	**0,58%**	**0,67%**	**1,97%**



Rentabilidades acumulada (%)





Ativo	% do Plano	Rentabilidade 2023
Renda Fixa	**79,71%**	**2,05%**
NTN-B´S	72,07%	3,70%
Debêntures	0,14%	-3,74%
Itaú Soberano	2,60%	3,23%
Sparta Top RF*	4,87%	0,41%
Fundo caixa*	0,02%	-
Disponível*	0,00%	-
Valores a receber/pagar*	0,02%	-
Renda Variável	**0,79%**	**-10,20%**
Navi Institucional FIA*	0,79%	-10,20%
Investimentos Estruturados	**13,73%**	**-0,19%**
Provisão de perda	-2,21%	
FIP's	**3,44%**	**-1,40%**
Brasil Energia Renovável	0,00%	-14,04%
Oria Tech I	0,24%	-41,73%
FIP Lacan Florestal	0,57%	9,88%
BTG Pactual Infra II	0,04%	-7,59%
FIP Santo Antonio (PUT)	2,21%	3,83%
FIP NORDESTE III	0,37%	9,33%
Spectra VI	0,01%	0,00%
Multimercados Estruturados	**12,50%**	**0,49%**
SN Capital FIC FIM*	4,96%	1,58%
Giant Zarathustra FIC*	0,88%	-1,46%
Vinland Macro FIC FIM*	4,74%	-0,70%
Itaú Hedge Plus	1,91%	0,93%
Investimentos Exterior	**0,83%**	**4,52%**
FoF Itaú Global Eqt.*	0,83%	4,52%
Imóveis	**1,72%**	**0,60%**
José de Alencar	1,68%	0,57%
Flat Maceió	0,04%	1,82%
Empréstimos	**2,53%**	**3,54%**
Disponível	**0,71%**	

Segmento	Patrimônio (R$)	% Alocação	Limites P.I
Renda Fixa	427.067.098	79,71%	100%
Renda Variável	4.206.620	0,79%	10%
Investimentos Estruturados	73.568.570	13,73%	15%
Imóveis	9.200.000	1,72%	10%
Empréstimos	13.556.798	2,53%	7%
Exterior	4.435.540	0,83%	5%
Disponível	3.822.184	0,71%	
Exigível	-48.835	-0,01%	
Total	535.807.975		

* 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).*

Rua: Bernardo Guimarães, 63- Funcionários- Belo Horizonte- MG- CEP 30.140-080
Telefones (31) 3284-8407- E-mail: investimentos@maisprevidencia.com

Relatório Demonstrativo de Investimento

EFPC: CASFAM-Caixa de Assistência Fábio de Araújo Motta
Plano: Plano de Benefícios do Sistema FIEMG

Data-Base: 31 de Março de 2023
CNPB: 1998003019

O Relatório de Demonstrativo de Investimentos tem como objetivo acompanhar os investimentos de acordo com o Art. 6º da Resolução CNPC nº 32, de 04 de dezembro de 2019. Para fins do disposto nesse artigo, cada ativo pertencente à carteira própria e aos fundos de investimentos exclusivos da EFPC deve ser especificado com, no mínimo, tipo de ativo, segmento de aplicação, bem como a quantidade e valor.

RECURSOS GARANTIDORES (R$) **535.807.974,76**

Tipo do Ativo		Carteira Própria + Fundo Exclusivo	
		Quantidade	Valor (R$)
Renda Fixa	**CNPJ**		
DISPONÍVEL	-	-	3.822.183,93
DEBÊNTURES CRVD6	-	19.952	732.598,87
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	-	91.737	386.141.083,50
ITAÚ SOBERANO RF FIC FI	06.175.696/0001-73	235.575	13.914.752,87
SPARTA TOP FIC RF CP LP	14.188.162/0001-00	9.570.627	26.079.943,19
MAIS PREVIDENCIA FIC FIM CP (FUNDO EXCLUSIVO)	39.959.611/0001-05	63.634.399	65.589.184,22
Renda Variável			
	-	-	-
Imobiliário			
Edífico José de Alencar	-	-	9.000.000,00
Flat Maceió Atlantic Suites	-	-	200.000,00
Estruturado			
LACAN FLORESTAL FIP MULTI	13.812.224/0001-40	251	3.059.837,92
NORDESTE III FIP	13.812.224/0001-40	2.288.360	1.990.860,50
BTG INFRA II FICFIP	14.584.094/0001-06	2.455.000	188.445,81
ORIA TECH 1 FIP	15.505.288/0001-23	1.200.000	1.269.163,08
SPECTRA VI FIP	46.280.055/0001-01	25	220.468,41
FIP MALBEC	19.195.493/0001-32	40	1.459.612,96
ITAÚ HEDGE PLUS MULTIMERCADO FIC FIM	17.419.592/0001-83	292.864	10.251.957,86
Operações com Participantes			
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	-	-	13.556.797,86
Exterior			

ALOCAÇÃO EM FUNDO DE INVESTIMENTOS (ATRAVÉS DOS EXCLUSIVOS)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor (R$)
BNYM ARX LIQ FI REF	17.898.543/0001-70	52.601	115.857,04
FOF MULT GB EQ IEFIC	17.412.472/0001-54	108.957	5.447.874,32
GIANT ZARA II FIC FM	26.525.548/0001-49	2.526.406	4.738.145,49
SN CAPITAL FIC FIM	26.210.471/0001-18	14.589.750	26.652.143,96
VINLAND MACRO FICFIM	28.581.166/0001-68	16.238.701	25.426.601,85
KONDOR EQT INST FIA	14.113.340/0001-33	1.242.060	4.280.749,69