

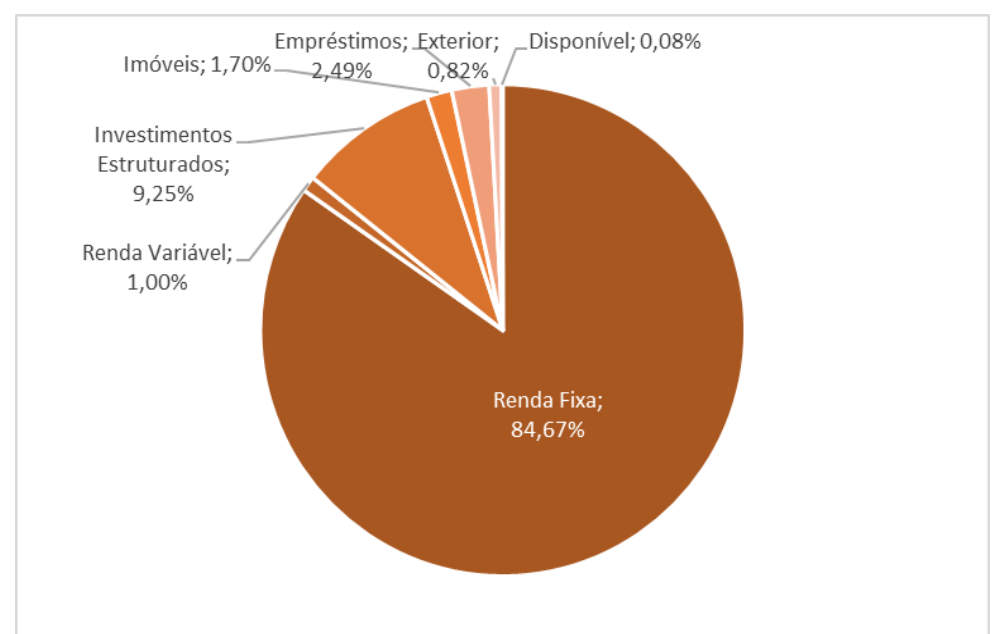
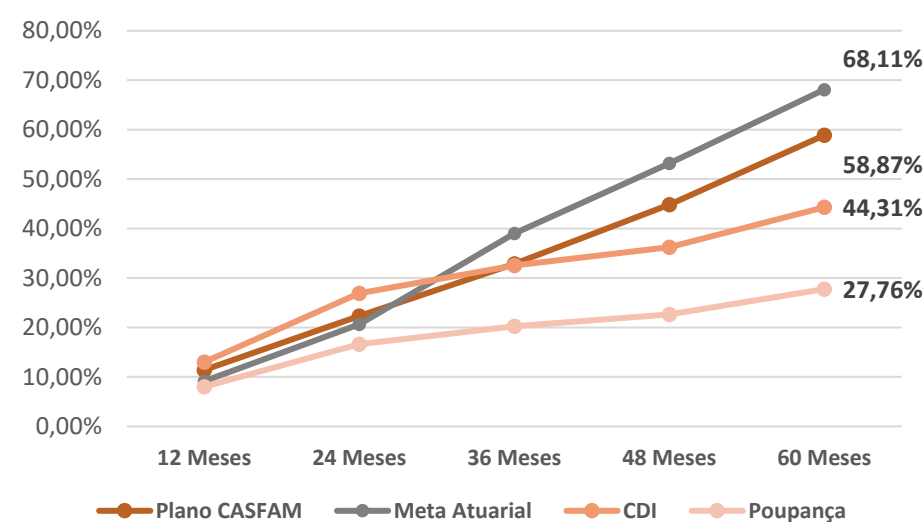
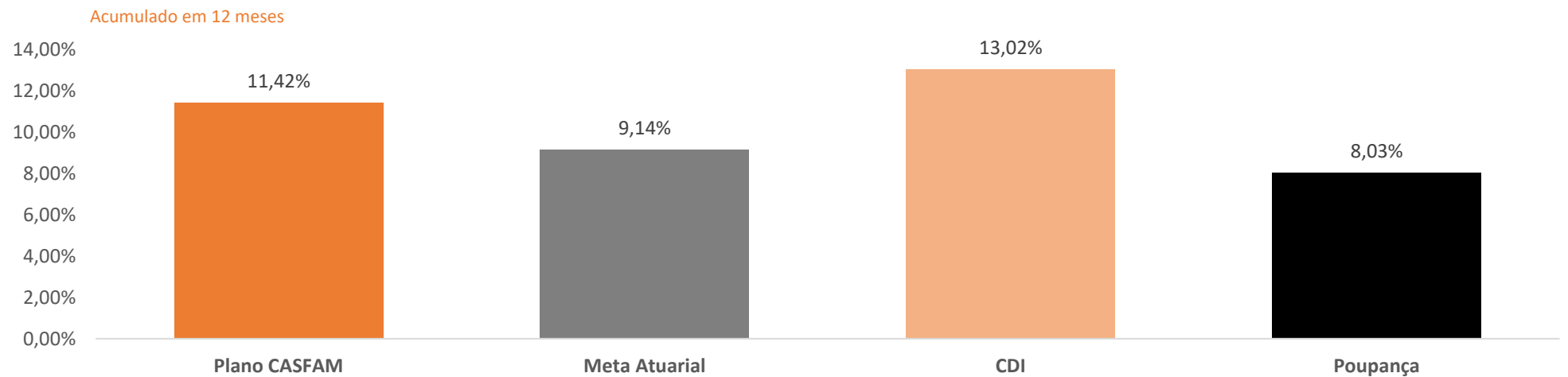
# Informativo Mensal de Rentabilidade

## Dezembro – 2023 – Plano CASFAM

De acordo com as tendências observadas no mês anterior, dezembro mostrou-se favorável para os mercados e os ativos de risco, contribuindo positivamente para o fechamento do ano de 2023. Nos Estados Unidos, as expectativas em torno do término do ciclo de aumento das taxas de juros e dos cortes nas taxas no primeiro semestre de 2024 se mantiveram. No Brasil, o COPOM realizou cortes na taxa SELIC, reduzindo-a em 50 pontos-base, conforme previsto pelo mercado, e encerrando o ano em 11,75%. A inflação fechou o ano em 4,62%, alinhada com a meta estabelecida pelo Conselho Monetário Nacional. Por fim, o Ibovespa encerrou o ano com ganhos significativos, atingindo 22,25%. O retorno do Plano CASFAM em dezembro foi de 0,88%. No acumulado do ano, o plano atingiu 124,84% de sua meta (IPCA + 4,33% a.a.) Sobre os resultados gerais, o segmento de Renda Fixa apresentou retorno de 0,94%. Já os demais segmentos apresentaram as seguintes rentabilidades mensais: Renda Variável: 5,69%; Estruturado: 0,83%; Investimentos no Exterior: 0,48%; Investimentos Imobiliários: 0,20%; Operação com Participantes: 0,80%.

### Rentabilidade 12 meses

Plano	jan/23	fev/23	mar/23	abr/23	mai/23	jun/23	jul/23	ago/23	set/23	out/23	nov/23	dez/23	2023
Plano CASFAM	0,92%	0,55%	1,03%	0,75%	3,22%	0,46%	0,42%	0,63%	0,63%	0,58%	0,81%	0,88%	11,42%
Meta Atuarial	0,89%	1,20%	1,07%	0,97%	0,58%	0,27%	0,47%	0,58%	0,61%	0,59%	0,63%	0,92%	9,14%
CDI	1,12%	0,92%	1,17%	0,91%	1,12%	1,07%	1,07%	1,14%	0,97%	1,00%	0,92%	0,89%	13,02%
Poupança	0,71%	0,58%	0,67%	0,67%	0,71%	0,68%	0,66%	0,72%	0,57%	0,61%	0,58%	0,57%	8,03%



Ativo	% do Plano	Rentabilidade 2023
<b>Renda Fixa</b>	<b>84,67%</b>	<b>10,87%</b>
NTN-B'S	67,88%	11,00%
Debêntures	0,13%	3,83%
Itaú Soberano	10,63%	12,96%
Sparta Top RF*	2,60%	12,18%
Itaú Optimus	0,94%	6,40%
Itaú IMA-B5	2,44%	5,92%
Fundo caixa*	0,04%	-
Disponível*	0,00%	-
Valores a receber/pagar*	0,00%	-
<b>Renda Variável</b>	<b>1,00%</b>	<b>20,10%</b>
Navi Institucional FIA*	1,00%	20,10%
<b>Investimentos Estruturados</b>	<b>9,25%</b>	<b>20,32%</b>
<b>FIP's</b>	<b>1,74%</b>	<b>184,93%</b>
Oria Tech I	0,22%	-42,75%
FIP Lacan Florestal	0,54%	9,06%
BTG Pactual Infra II	0,02%	-28,63%
FIP NORDESTE III	0,36%	9,58%
Spectra VI	0,41%	435,05%
BTG Economia Real II	0,06%	-17,77%
Pátria VII	0,14%	-1,66%
<b>Multimercados Estruturados</b>	<b>7,51%</b>	<b>2,88%</b>
SN Capital FIC FIM*	2,28%	-1,67%
Vinland Macro FIC FIM*	4,76%	4,76%
Genoa Radar Capital*	0,46%	5,16%
<b>Investimentos Exterior</b>	<b>0,82%</b>	<b>11,07%</b>
FoF Itaú Global Eq.*	0,81%	11,07%
<b>Imóveis</b>	<b>1,70%</b>	<b>7,15%</b>
José de Alencar	1,66%	6,41%
Flat Maceió	0,05%	41,55%
<b>Empréstimos</b>	<b>2,49%</b>	<b>13,23%</b>
<b>Disponível</b>	<b>0,08%</b>	

Segmento	Patrimônio (R\$)	% Alocação	Limites P.I
Renda Fixa	478.417.251	84,67%	100%
Renda Variável	5.625.792	1,00%	10%
Investimentos Estruturados	52.257.950	9,25%	15%
Imóveis	9.623.500	1,70%	10%
Empréstimos	14.044.157	2,49%	7%
Exterior	4.653.708	0,82%	5%
Disponível	463.450	0,08%	
Exigível	-20.005	0,00%	
<b>Total</b>	<b>565.065.802</b>		

\* ALOCAÇÃO NO MAIS PREVIDÊNCIA FIC FIM CP, CNPJ: 39.959.611/0001-05  
 † A rentabilidade do segmento estrutura teve impacto positivo relevante devido ao recebimento da PUT do FIP MALBEC.



## Relatório Demonstrativo de Investimento

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

Data-Base: 31 de dezembro 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\$) 565.065.932,80

Tipo do Ativo	Carteira Própria + Fundo Exclusivo		
		Quantidade	Valor (R\$)
<b>Renda Fixa</b>	<b>CNPJ</b>		
DISPONÍVEL	-	-	463.449,84
DEBÊNTURES CRVD6	-	19.952	721.740,27
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS (NTN-B)	-	88.970	383.567.348,81
ITAÚ SOBERANO RF FIC FI	06.175.696/0001-73	929.530	60.079.135,57
SPARTA TOP FIC RF CP LP	14.188.162/0001-00	4.829.746	14.716.492,40
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B5	09.093.819/0001-15	307.123	13.789.503,75
ITAÚ OPTIMUS RF LP FIC	40.668.849/0001-52	389.007	5.319.537,55
MAIS PREVIDENCIA FIC FIM CP (FUNDO EXCLUSIVO)	39.959.611/0001-05	44.728.728	48.258.763,59

### Renda Variável

#### Imobiliário

Edifício José de Alencar	-	-	9.360.000,00
Flat Maceió Atlantic Suites	-	-	263.500,20

#### Estruturado

LACAN FLORESTAL FIP MULTI	13.812.224/0001-40	251	3.036.674,81
NORDESTE III FIP	13.812.224/0001-40	2.323.328	2.019.101,86
BTG INFRA II FICFIP	14.584.094/0001-06	2.455.000	140.952,36
ORIA TECH 1 FIP	15.505.288/0001-23	1.200.000	1.246.803,63
SPECTRA VI FIP	46.280.055/0001-01	255.000	503.342,97
BTG ECONOMIA REAL II	44.172.951/0001-13	375.378	356.938,39
PATRIA VII	46.505.158/0001-14	990	775.148,28
SPECTRA VI FIP	46.280.055/0001-01	1.630.892	2.318.496,30
ECON REAL II FIP CLB	44.172.951/0001-13	375.378	311.420,38

#### Operações com Participantes

OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	-	-	14.044.156,58
-----------------------------	---	---	---------------

#### Exterior

FOF MULTI GLOBAL EQT	17.412.472/0001-54	104.878	4.653.708,17
----------------------	--------------------	---------	--------------

### ALOCAÇÃO EM FUNDO DE INVESTIMENTOS ( ATRAVÉS DOS EXCLUSIVOS)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor (R\$)
BNYM ARX LIQ FI REF	17.898.543/0001-70	99.245	238.955,73
GENOA CAP AB FIC FIM	42.794.466/0001-56	1.713.633	2.624.145,85
SN CAPITAL FIC FIM	26.210.471/0001-18	7.302.588	12.909.435,36
VINLAND MACRO FICFIM	28.581.166/0001-68	16.238.701	26.875.771,13
KONDOR EQT INST FIA	14.113.340/0001-33	1.242.060	5.625.791,57