



CIFRÃO

Fundação de Previdência
da Casa da Moeda do Brasil

DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS OUTUBRO / 2024

Carteira de Investimentos

Rentabilidades

Carteira Própria - TP

Gráficos

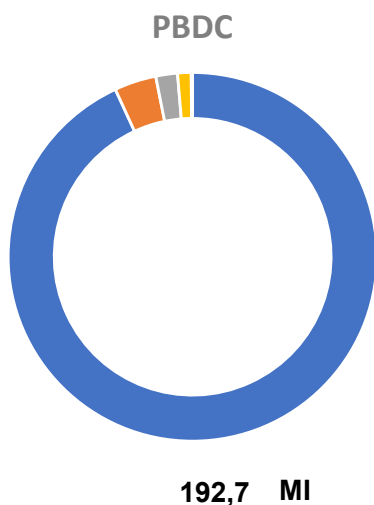
Composição de Carteira

Custos

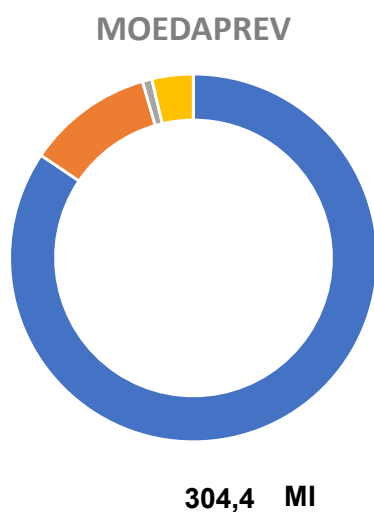
Carteira de Investimentos Outubro/2024



DESCRIÇÃO	PLANO PBDC	% s/RG	PLANO MOEDAPREV	% s/RG	PGA	% s/RG	CONSOLIDADO	% s/RG
Renda Fixa	R\$ 179.400.880,44	93,17	R\$ 256.968.909,24	84,59	R\$ 7.369.786,47	97,34	R\$ 443.739.576,15	88,06
Títulos Públicos	R\$ 172.889.124,26	89,79	R\$ 88.666.152,87	29,19	R\$ -	0,00	R\$ 261.555.277,13	51,90
NOTA DO TESOURO NACIONAL - NTN-B	R\$ 172.889.124,26	89,79	R\$ 88.666.152,87	29,19	R\$ -	0,00	R\$ 261.555.277,13	51,90
Quotas de Fundos de Investimentos	R\$ 6.511.756,18	3,38	R\$ 168.302.756,37	55,40	R\$ 7.369.786,47	97,34	R\$ 182.184.299,02	36,15
CIFRÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	R\$ 1.386.584,44	0,72	R\$ 97.864.291,96	32,21	R\$ 710.924,43	9,39	R\$ 99.961.800,83	19,84
CIFRÃO MACRO ESTRUTURADO MULTIMERCADO	R\$ -	0,00	R\$ 33.386.201,40	10,99	R\$ -	0,00	R\$ 33.386.201,40	6,63
BRAD RF DI FED EXTRA	R\$ 5.125.171,74	2,66	R\$ 37.052.263,01	12,20	R\$ 6.658.862,04	87,95	R\$ 48.836.296,79	9,69
Renda Variável	R\$ 7.051.136,32	3,66	R\$ 33.798.515,73	11,13	R\$ -	0,00	R\$ 40.849.652,05	8,11
Quotas de Fundos de Investimentos	R\$ 7.051.136,32	3,66	R\$ 33.798.515,73	11,13	R\$ -	0,00	R\$ 40.849.652,05	8,11
CIFRAO FIC FIA	R\$ 7.051.136,32	3,66	R\$ 33.798.515,73	11,13	R\$ -	0,00	R\$ 40.849.652,05	8,11
Investimentos Imobiliários	R\$ 3.703.098,50	1,92	R\$ 2.557.901,50	0,84	R\$ -	0,00	R\$ 6.261.000,00	1,24
Operações com Participantes	R\$ 2.245.872,48	1,17	R\$ 11.063.681,19	3,64	R\$ -	0,00	R\$ 13.309.553,67	2,64
Outros Realizáveis - Investimentos	R\$ 255.840,10	0,13	R\$ -	0,00	R\$ 200.292,14	2,65	R\$ 456.132,24	0,09
Total dos Investimentos	R\$ 192.656.827,84	100,06	R\$ 304.389.007,66	100,19	R\$ 7.570.078,61	99,99	R\$ 504.615.914,11	100,14
(+) Disponível (-) Exigível Investimentos	R\$ (111.533,49)	-0,06	R\$ (590.046,43)	-0,19	R\$ 1.105,00	0,01	R\$ (700.474,92)	-0,14
TOTAL DOS RECURSOS GARANTIDORES	R\$ 192.545.294,35	100,00	R\$ 303.798.961,23	100,00	R\$ 7.571.183,61	100,00	R\$ 503.915.439,19	100,00



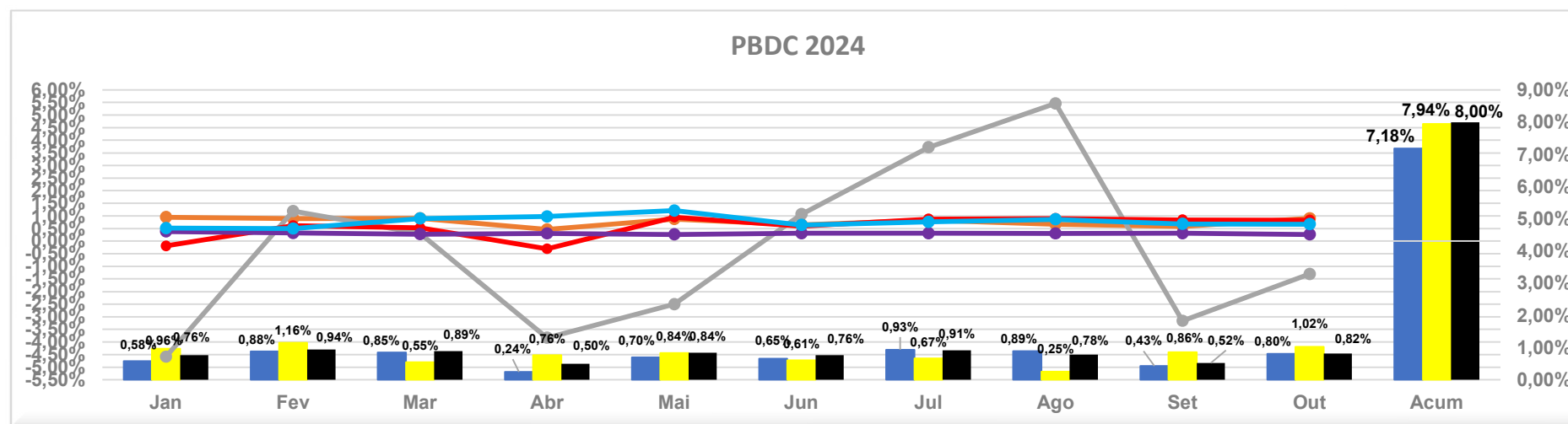
Segmento de Aplicação	MR\$	Percentual da Carteira
Renda Fixa	179,4	93,12%
Renda Variável	7,1	3,66%
Investimentos Imobiliários	3,7	1,92%
Operações com Participantes	2,2	1,17%
Outros Realizáveis - Investimentos	0,3	0,13%



Segmento de Aplicação	MR\$	Percentual da Carteira
Renda Fixa	257,0	84,42%
Renda Variável	33,8	11,10%
Investimentos Imobiliários	2,6	0,84%
Operações com Participantes	11,1	3,63%
Outros Realizáveis - Investimentos	-	0,00%

Rentabilidade do Plano PBDC - 2024









PBDC														
2024		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum
RENTABILIDADE PBDC	■	0,58%	0,88%	0,85%	0,24%	0,70%	0,65%	0,93%	0,89%	0,43%	0,80%			7,18%
TAXA ATUARIAL PBDC ²	■	0,96%	1,16%	0,55%	0,76%	0,84%	0,61%	0,67%	0,25%	0,86%	1,02%			7,94%
MEDIANA PLANOS BD ¹	■	0,76%	0,94%	0,89%	0,50%	0,84%	0,76%	0,91%	0,78%	0,52%	0,82%			8,00%
Renda Fixa	■	0,95%	0,89%	0,90%	0,46%	0,87%	0,65%	0,82%	0,67%	0,58%	0,90%			7,96%
Renda Variável	■	-4,59%	1,19%	0,30%	-3,83%	-2,50%	1,07%	3,72%	5,46%	-3,16%	-1,30%			-4,06%
Estruturado	■	-0,19%	0,61%	0,53%	-0,31%	0,95%	0,59%	0,87%	0,89%	0,84%	0,83%			5,74%
Imóveis	■	0,38%	0,32%	0,27%	0,30%	0,26%	0,31%	0,31%	0,30%	0,31%	0,26%			3,06%
Empréstimos	■	0,52%	0,50%	0,89%	0,97%	1,21%	0,64%	0,76%	0,86%	0,68%	0,67%			7,97%

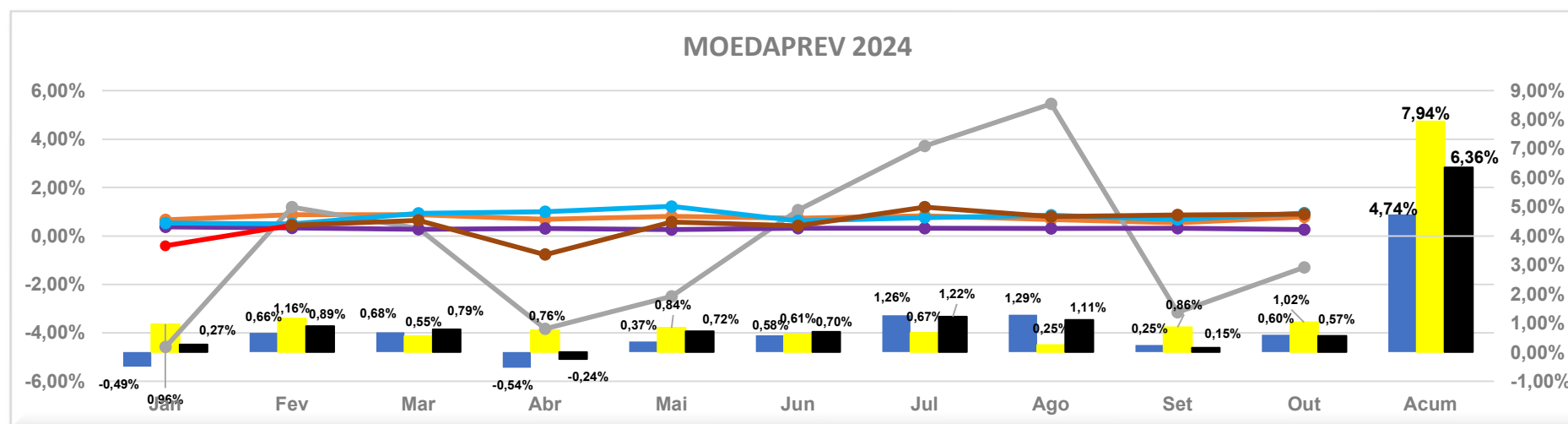


1: Estudo Comparativo de Desempenho - Aditus, Outubro/2024

2: Taxa Atuarial PBDC INPC+ 4,59%

Rentabilidade do Plano MOEDAPREV - 2024

MOEDAPREV														
2024		Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum
RENTABILIDADE MOEDAPREV		-0,49%	0,66%	0,68%	-0,54%	0,37%	0,58%	1,26%	1,29%	0,25%	0,60%			4,74%
TAXA ATUARIAL MOEDAPREV ²		0,96%	1,16%	0,55%	0,76%	0,84%	0,61%	0,67%	0,25%	0,86%	1,02%			7,94%
MEDIANA PLANOS CV ¹		0,27%	0,89%	0,79%	-0,24%	0,72%	0,70%	1,22%	1,11%	0,15%	0,57%			6,36%
Renda Fixa		0,66%	0,88%	0,88%	0,69%	0,81%	0,73%	0,83%	0,67%	0,54%	0,79%			7,74%
Renda Variável		-4,59%	1,19%	0,30%	-3,83%	-2,50%	1,07%	3,71%	5,46%	-3,16%	-1,30%			-4,06%
Estruturado		-0,41%	0,44%	0,64%	-0,77%	0,58%	0,42%	1,19%	0,80%	0,87%	0,90%			4,74%
Imóveis		0,38%	0,32%	0,27%	0,30%	0,26%	0,31%	0,31%	0,30%	0,31%	0,26%			3,06%
Empréstimos		0,53%	0,50%	0,93%	1,00%	1,22%	0,62%	0,76%	0,86%	0,68%	0,94%			8,33%

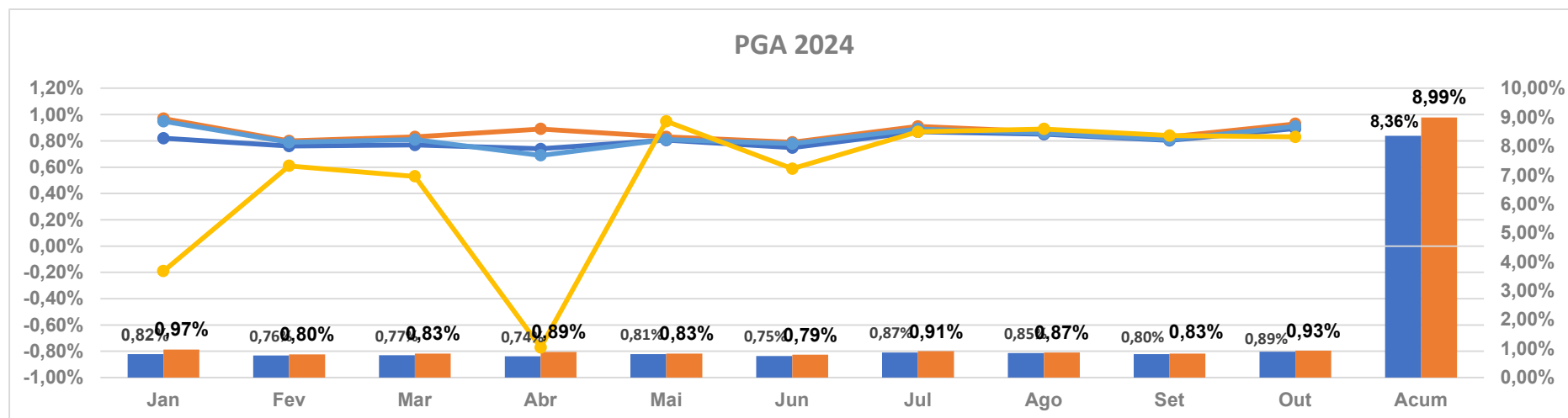


1: Estudo Comparativo de Desempenho - Aditus, Outubro/2024

2: Taxa Atuarial MOEDAPREV INPC+ 4,59%

Rentabilidade do Plano PGA - 2024

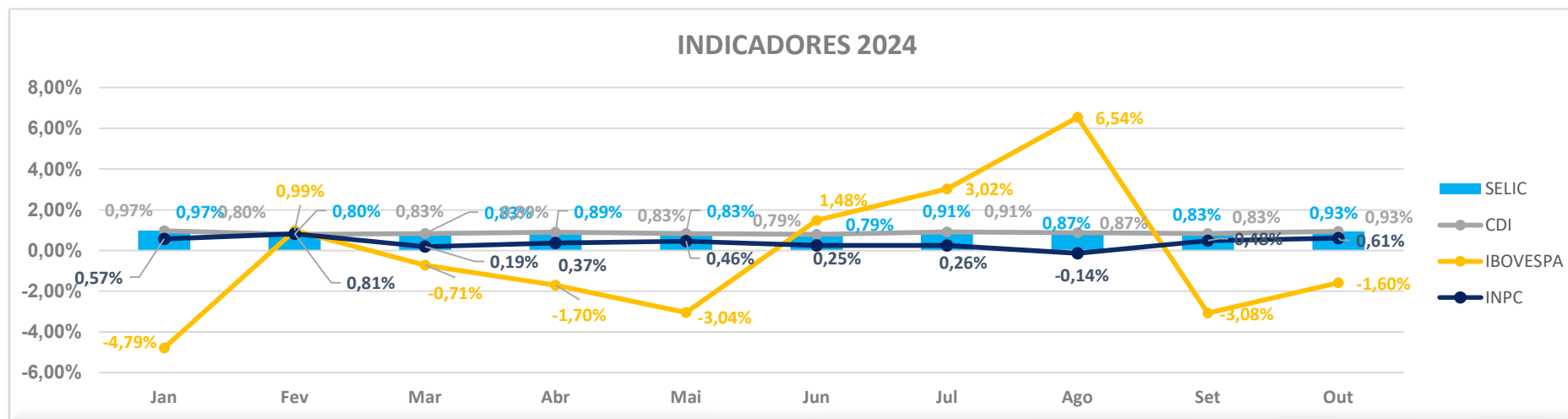
PGA													
2024	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum
RENTABILIDADE PGA	0,82%	0,76%	0,77%	0,74%	0,81%	0,75%	0,87%	0,85%	0,80%	0,89%			8,36%
Renda Fixa	0,95%	0,79%	0,81%	0,69%	0,81%	0,78%	0,89%	0,86%	0,81%	0,91%			8,62%
Estruturado	-0,19%	0,61%	0,53%	-0,77%	0,95%	0,59%	0,87%	0,89%	0,84%	0,83%			5,26%
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,83%	0,93%			8,99%



Indicadores de Investimento - 2024

INDICADORES

2024	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum
INDICADORES													
CDI	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,83%	0,93%			8,99%
SELIC	0,97%	0,80%	0,83%	0,89%	0,83%	0,79%	0,91%	0,87%	0,83%	0,93%			8,99%
IBOVESPA	-4,79%	0,99%	-0,71%	-1,70%	-3,04%	1,48%	3,02%	6,54%	-3,08%	-1,60%			-3,33%
INPC	0,57%	0,81%	0,19%	0,37%	0,46%	0,25%	0,26%	-0,14%	0,48%	0,61%			3,92%



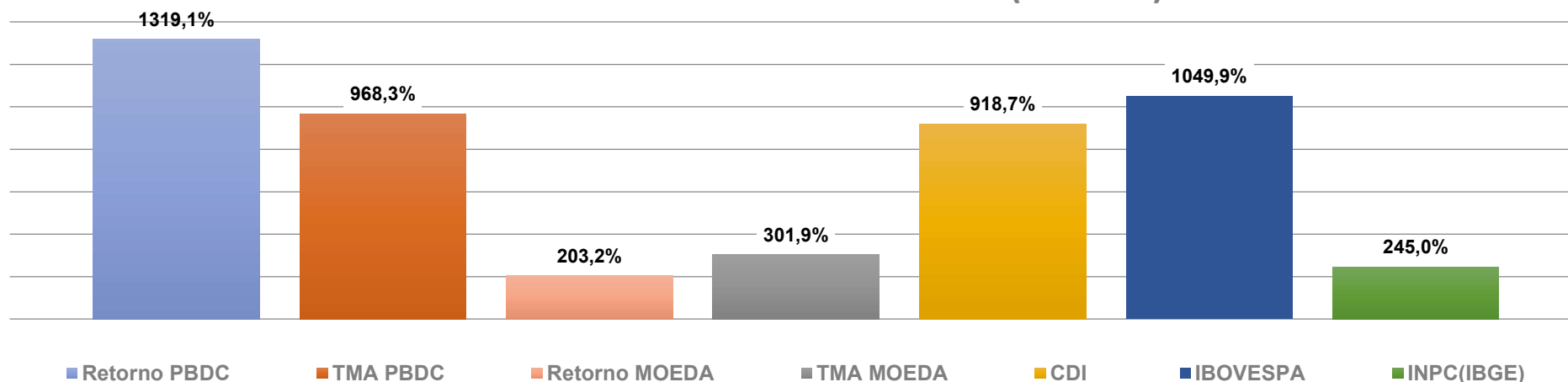
Histórico de Rentabilidade por Segmento dos Investimentos (Consolidado)



	Acumulado 2003 a 2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021	2022	2023	2024	Acumulado Total
Renda Fixa	263,9%	7,5%	9,4%	11,7%	14,6%	9,5%	8,1%	9,7%	1,9%	3,7%	8,5%	12,1%	7,8%	885,7%
Renda Variável	950,5%	-5,8%	0,1%	-6,3%	32,7%	23,1%	24,0%	27,0%	-3,7%	-16,4%	4,5%	18,9%	-4,1%	2189,4%
Invest. Estruturado	30,5%	7,1%	4,5%	8,2%	5,3%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	5,1%	75,1%
Invest. Exterior	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%
Imóveis	80,9%	52,6%	17,9%	13,7%	30,4%	4,0%	7,1%	1,2%	-7,4%	9,8%	8,6%	-25,9%	3,0%	358,8%
Empréstimos	386,4%	15,4%	15,7%	18,5%	17,5%	9,4%	10,5%	10,7%	11,5%	17,6%	14,0%	17,0%	8,1%	2185,9%
Global	389,0%	6,9%	7,8%	8,9%	18,2%	10,4%	11,0%	12,9%	2,9%	1,3%	10,2%	12,7%	5,7%	1275,1%
Retorno PBDC	388,5%	6,9%	7,8%	8,9%	18,3%	10,3%	11,0%	13,0%	2,5%	2,0%	13,3%	11,4%	7,2%	1319,1%
Retorno MOEDA	15,3%	4,7%	7,0%	8,4%	17,0%	11,1%	11,5%	12,4%	3,4%	0,5%	7,8%	13,5%	4,7%	203,2%
TMA PBDC	213,8%	10,8%	11,5%	16,8%	12,1%	7,2%	8,6%	9,8%	10,5%	14,9%	10,8%	8,4%	7,9%	968,3%
TMA MOEDA	17,7%	10,8%	11,5%	16,8%	12,1%	7,2%	8,6%	9,8%	10,5%	15,3%	10,8%	8,4%	7,9%	301,9%
Indicadores														
CDI	258,2%	8,1%	10,8%	13,3%	14,0%	9,9%	6,4%	5,8%	2,8%	4,4%	12,4%	13,1%	9,0%	918,7%
IBOVESPA	440,5%	-15,5%	-2,9%	-13,3%	38,9%	26,9%	15,0%	31,6%	2,9%	-11,9%	4,7%	22,3%	-3,3%	1049,9%
INPC(IBGE)	76,9%	5,6%	6,2%	11,3%	6,8%	2,1%	3,4%	4,6%	5,4%	10,2%	5,9%	3,7%	3,9%	245,0%

Meta Atuarial (TMA): 2003 a 2011 INPC + 6% a.a.; 2012 a 2019 INPC + 5% a.a.; a partir de 2020 INPC + 4,8% a.a.; 2021, INPC + 4,34% a.a para o Plano PBDC e INPC + 4,71% a.a para o Plano MOEDAPREV; a partir de 2022, INPC + 4,59% a.a para o Plano PBDC e INPC + 4,59% a.a para o Plano MOEDAPREV. PLANO MOEDAPREV a partir de 2011.

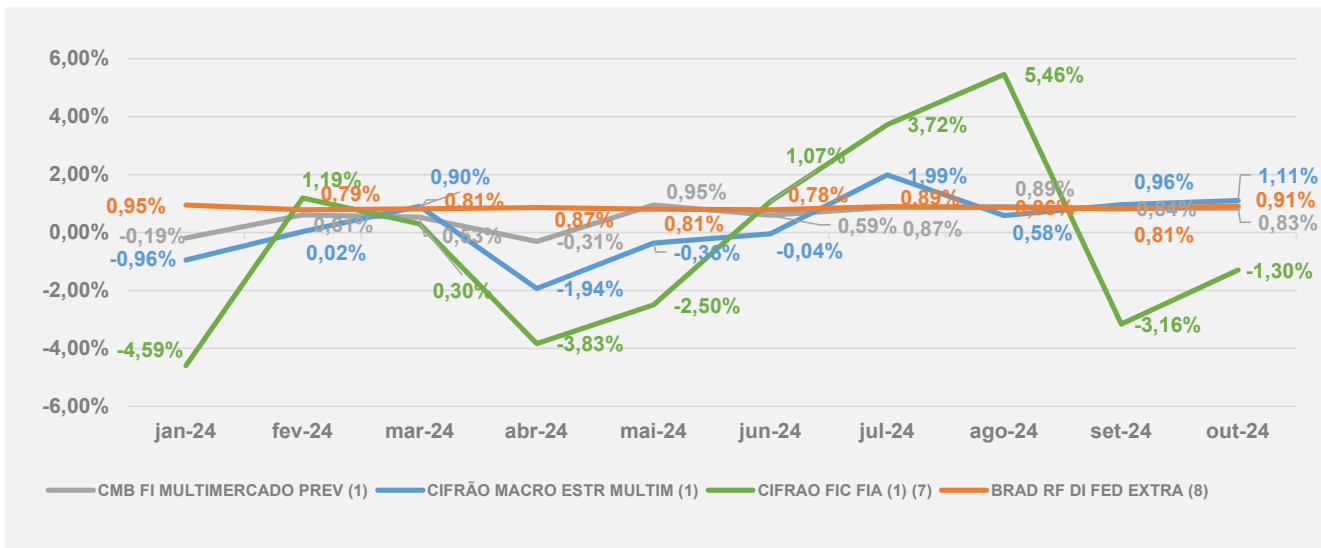
Rentabilidade Acumulada 2003 a 2024 (outubro)



Rentabilidade dos Fundos de Investimentos - 2024



	jan	fev	mar	abr	mai	jun	jul	ago	set	out	nov	dez	2024	2023	2022	2021	2020	2019	
FUNDO EXCLUSIVO																			
CMB FI MULTIMERCADO PREV (1)	-0,19%	0,61%	0,53%	-0,31%	0,95%	0,59%	0,87%	0,89%	0,84%	0,83%			5,75%	12,96%	10,96%	3,61%	1,41%	9,87%	
CIFRÃO MACRO ESTR MULTIM (1)	-0,96%	0,02%	0,90%	-1,94%	-0,36%	-0,04%	1,99%	0,58%	0,96%	1,11%			2,22%	12,45%	8,47%	-2,38%	7,57%	9,43%	
CIFRAO FIC FIA (1) (7)	-4,59%	1,19%	0,30%	-3,83%	-2,50%	1,07%	3,72%	5,46%	-3,16%	-1,30%			-4,07%	8,37%					
FUNDO NÃO EXCLUSIVO																			
BRAD RF DI FED EXTRA (8)	0,95%	0,79%	0,81%	0,87%	0,81%	0,78%	0,89%	0,86%	0,81%	0,91%			8,79%	2,75%					



(1) Fundos exclusivos - Cifrao é a única Cotista

(2) Início Abril de 2016

(5) Início Novembro de 2017

(7) Início Novembro de 2019

(8) Início Novembro de 2023 (7) Início Julho de 2023

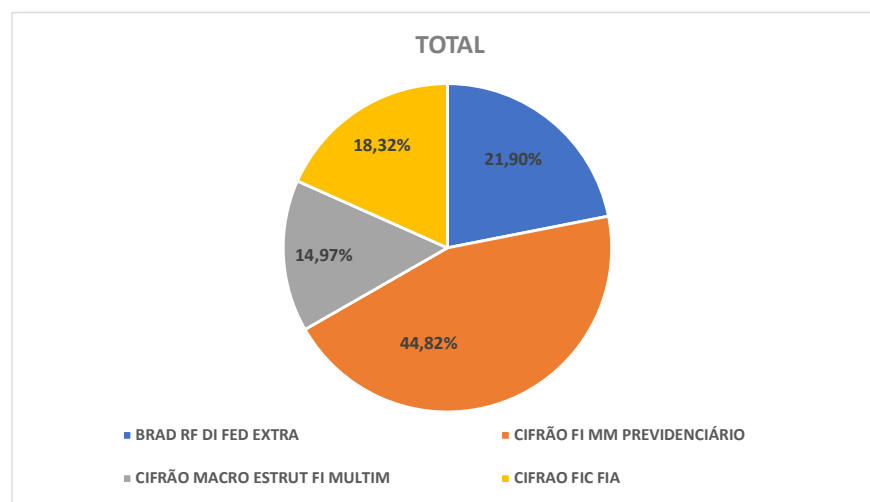
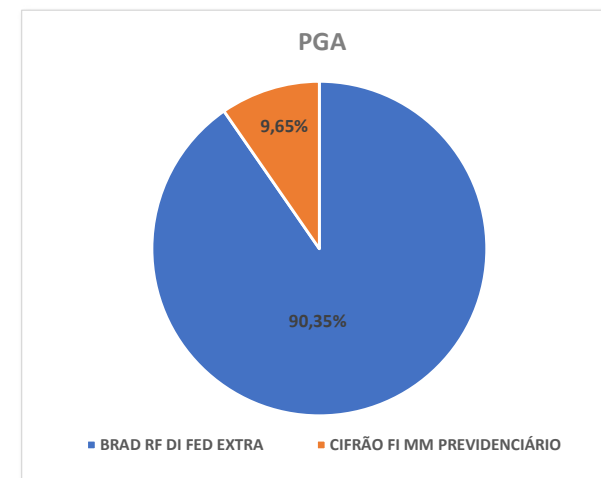
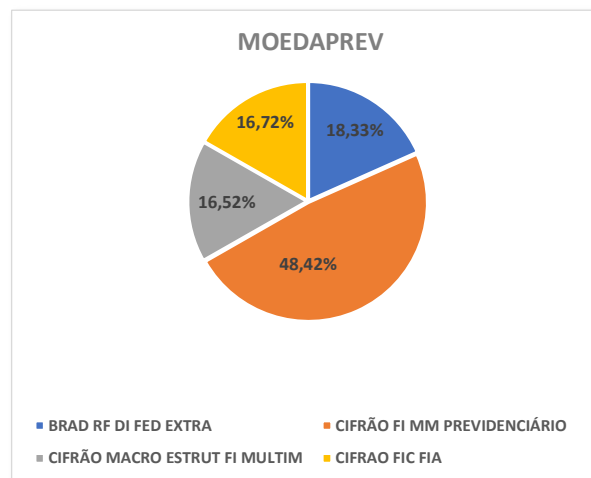
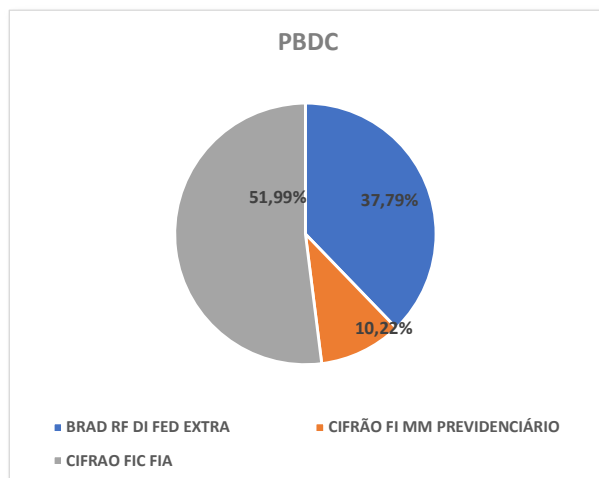
(8) Início Outubro de 2023

(9) Início Julho de 2023

Carteira dos Fundos de Investimentos - 2024



	PBDC	MOEDAPREV	PGA	TOTAL
BRAD RF DI FED EXTRA	5.125.171,74	37.052.263,01	6.658.862,04	48.836.296,79
CIFRÃO FI MM PREVIDENCIÁRIO	1.386.584,44	97.864.291,96	710.924,43	99.961.800,83
CIFRÃO MACRO ESTRUT FI MULTIM	-	33.386.201,40	-	33.386.201,40
CIFRAO FIC FIA	7.051.136,32	33.798.515,73	-	40.849.652,05
Total FI	13.562.892,50	202.101.272,10	7.369.786,47	223.033.951,07

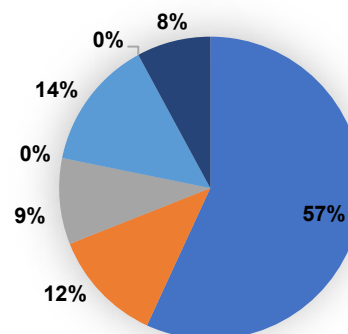


Custos com Administração dos Investimentos - 2024



Descrição		1º Trim	2º Trim	1º Sem	3º Trim	4º Trim	2º Sem	Ano
Gestão externa								
Taxa de Administração - Fundos Exclusivos(1)	■	136.583	163.803	300.387	149.477	37.913	187.390	487.777
Taxa de Administração - Carteira Administrada(2)	■	22.334	23.026	45.360	24.637	8.062	32.699	78.059
Taxa de Administração - Fundos Não Exclusivos	■	15.638	16.263	31.900	18.370	6.105	24.476	56.376
Taxa de Performance(3)	■	138.830	-	138.830	-	-	-	138.830
SELIC / CETIP / CBLC / CVM / Outras	■	29.043	76.506	105.549	29.558	9.285	38.843	144.392
Auditoria	■	-	-	-	-	-	-	-
Custódia	■	17.495	18.126	35.620	19.457	5.266	24.723	60.343
Total		359.922	297.724	657.646	241.499	66.631	308.131	965.776

Fonte: Santander Securities Service e 4UM Investimentos



Observações:

- Despesas incorridas dentro dos Fundos de Investimentos, onde a CIFRÃO realiza suas aplicações;
- Carteira Administrada (TPF);
- Taxa de Performance sobre Fundo Exclusivo Multimercado, paga ao gestor XP Investimentos no 1º Trim, referente ao ano de 2023.

- Taxa de Administração - Fundos Exclusivos(1)
- Taxa de Administração - Carteira Administrada(2)
- Taxa de Administração - Fundos Não Exclusivos
- Taxa de Performance(3)
- SELIC / CETIP / CBLC / CVM / Outras
- Auditoria
- Custódia