

PLANO IBAPREV

Informativo Mensal de Rentabilidade

Janeiro - 2023



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2004.0023-11
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 22.144.091
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	29/07/2022
Data	31/01/2023

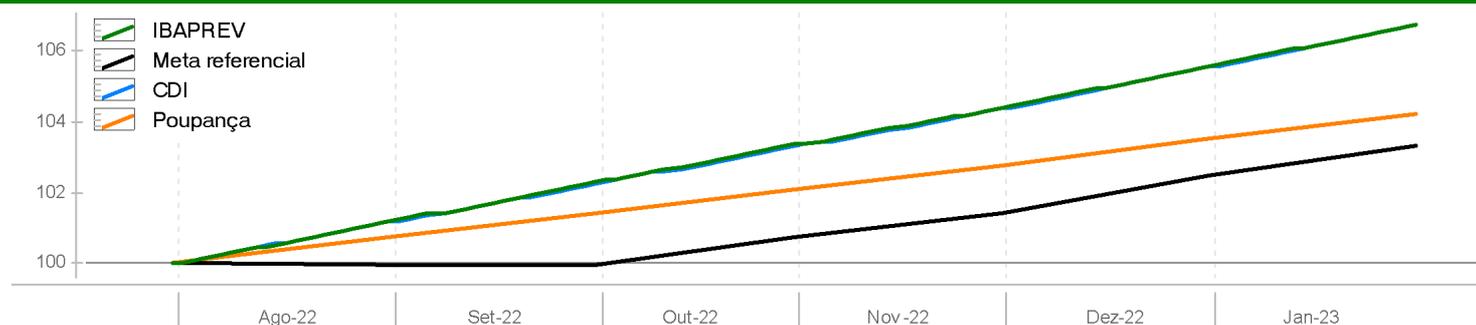
Política de Investimento

Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é a fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo. A composição da carteira utiliza-se de alocação diversificada em renda fixa, renda variável, multimercados, imobiliário e exterior.

Rentabilidades (%) (até 31/01/2023)

	jan 2023	dez 2022	nov 2022	out 2022	set 2022	do início
● IBAPREV	1,11	1,11	1,01	1,03	1,09	6,72
● Meta referencial	0,83	1,00	0,69	0,78	-0,02	3,31
● CDI	1,12	1,12	1,02	1,02	1,07	6,71
● Poupança	0,71	0,71	0,65	0,65	0,68	4,21

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Desde o início)

Meses Positivos	6
Meses Negativos	0
Meses Acima do CDI	3
Meses Abaixo do CDI	3
Maior Retorno Mensal (%)	1,18
Menor Retorno Mensal (%)	1,01
Retorno Acumulado (%)	6,72
Retorno Acumulado (% CDI)	100,17

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	0,04
Sharpe (desde o início)	0,58
VAR 21 dias	0,01
Máximo Drawdown	0,00
Alfa de Jensen	-

Comentários

O ano de 2023 teve seu início marcado pelo movimento de risk on (alocação em ativos de risco) nos mercados globais, que vem sendo impulsionado pela postura mais branda de diversos Bancos Centrais em relação à política monetária contracionista, especialmente, o Federal Reserve (FED - Banco Central dos Estados Unidos), respondendo a uma dinâmica mais benigna da inflação no mundo.

No mês de janeiro, novos dados referentes à inflação apresentando desaceleração permitiu ao FED a redução do aperto monetário. Junto a isso, os mercados emergentes foram favorecidos refletindo a expectativa positiva com a reabertura da economia chinesa com o fim da política de Covid-Zero.

No ambiente doméstico, o grande fluxo de capital para países emergentes, propiciado pela retomada da economia chinesa e a moderação da inflação global fez com que os ativos brasileiros se valorizassem. Contudo, o desempenho dos ativos domésticos ficou aquém dos pares globais, devido, principalmente, à desconfiança do mercado quanto à condução da política fiscal, ao processo contínuo de desancoragem das expectativas de inflação e à volatilidade no mercado de crédito privado.

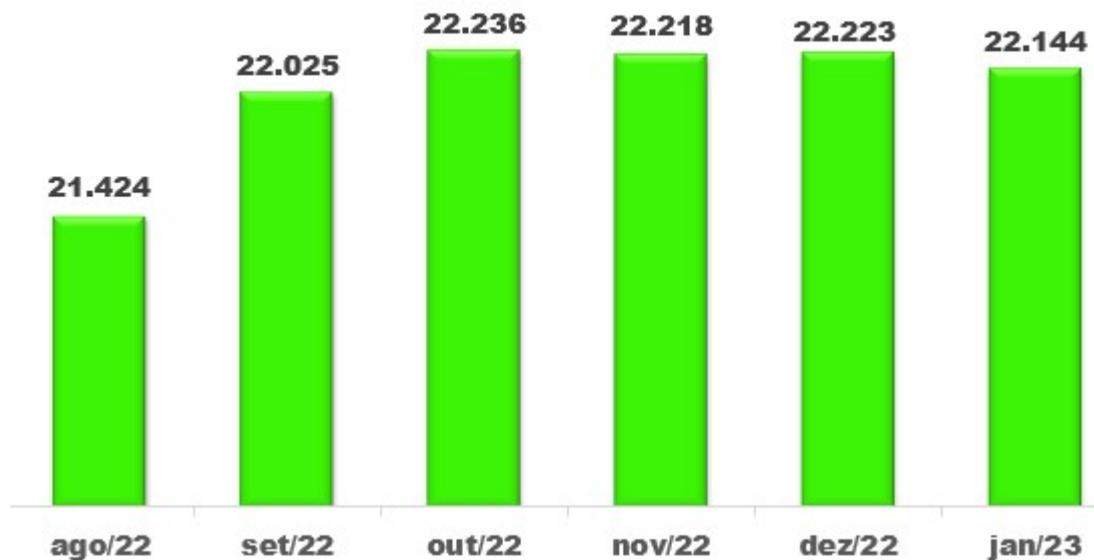
Diante desse cenário, o índice Ibovespa seguiu os mercados externos e encerrou o mês de janeiro com valorização de 3,37%. No mercado de renda fixa, refletindo a perspectiva de aumento de inflação, os títulos públicos atrelados à inflação de curto prazo (NTN-B) apresentaram performance positiva, enquanto os títulos de longo prazo registraram retorno negativo, em decorrência das incertezas da política fiscal. O Real valorizou frente ao Dólar na esteira de menor aversão a risco global no mês.

As cotas do Plano Imaprev registraram desempenho positivo de 1,11% no mês de janeiro, equivalente à 99% CDI e superior ao índice de referência, que foi de 0,83%, representando 134% do índice. No mês, o destaque positivo da carteira foram os ativos de renda fixa vinculados à taxa de juros pós-fixada (títulos públicos remunerados pela Selic - LFT

Distribuição por Segmentos



Evolução Patrimonial - Valores em mil (R\$)



Disclaimer

As informações contidas nesta Lâmina são de caráter exclusivamente informativo.

Os investimentos do Plano tem horizonte de retorno de médio e longo prazo, podendo apresentar flutuações nos valores das cotas no curto prazo.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

A Fundação VIVA de Previdência, administradora do Plano, adota normas e melhores práticas emanadas pela certificação do Selo de Autorregulação em Governança e investimentos (ABRAPP/ICSS/SINDAPP).

Maiores informações sobre o Plano, estarão contidas no RAI - Relatório Anual de Informações.

A meta referencial do Plano é de INPC + 3,72% a.a

Em 2023 a meta referencial do Plano é de IPCA + 3,60%. a.a.