

PLANO VIVA PECULIO ATIVOS

Informativo Mensal de Rentabilidade

Fevereiro - 2023



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	1990.0011-65
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 2.091.305.074
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	29/12/2017
Data	28/02/2023

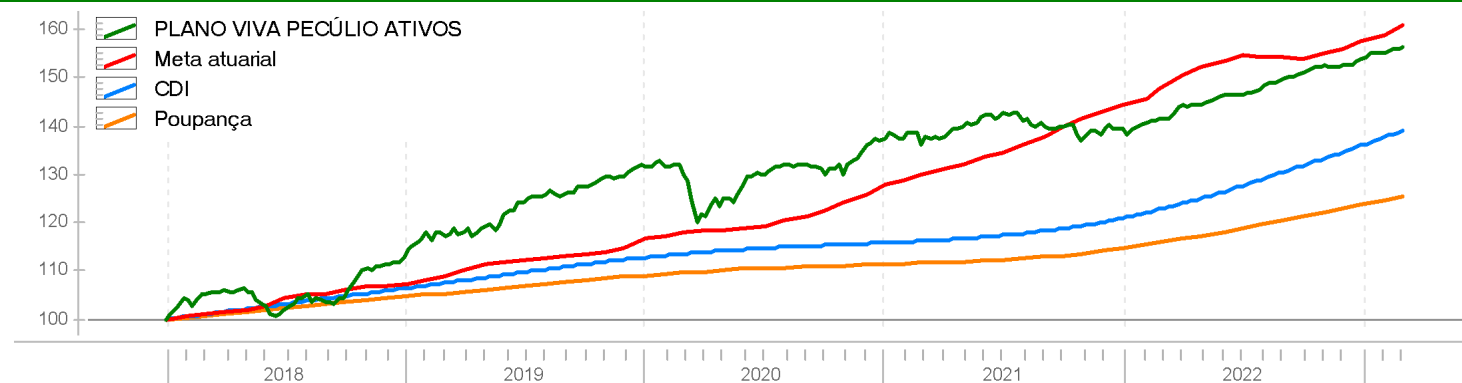
Política de Investimento

O modelo de gestão adota a metodologia de construção de carteira com base em uma macro alocação de recursos e reavaliação de cenário periodicamente. A composição das aplicações utiliza-se de estratégias de investimentos diversificada e de retorno com horizonte de médio e longo prazo.

Rentabilidades (%) (até 28/02/2023)

	fev 2023	jan 2023	dez 2022	nov 2022	out 2022	set 2022	2023	2022	2021	2020	24m	12m
● PLANO VIVA PECÚLIO ATIVOS	0,70	0,97	0,75	0,31	0,88	1,02	1,67	10,39	1,30	4,85	14,72	10,56
● Meta atuarial	1,15	0,84	0,94	0,63	0,72	-0,07	2,00	9,14	12,81	9,73	23,73	8,94
● CDI	0,92	1,12	1,12	1,02	1,02	1,07	2,05	12,39	4,42	2,76	19,43	13,01
● Poupança	0,61	0,71	0,71	0,65	0,65	0,68	1,33	7,90	2,99	2,11	12,33	8,18

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Meses Acima do CDI	2
Meses Abaixo do CDI	10
Maior Retorno Mensal (%)	1,75
Menor Retorno Mensal (%)	0,22
Retorno Acumulado (%)	10,56
Retorno Acumulado (% CDI)	81,20

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	1,50
Sharpe 12 meses	-1,44
VAR 21 dias	0,49
Máximo Drawdown	0,00
Alfa de Jensen	-2,44

Comentários

Nos mercados globais, o mês de fevereiro foi marcado pela piora do ambiente macroeconômico e reversão do otimismo do início do ano de 2023. A divulgação de indicadores de inflação acima do esperado e o mercado de trabalho aquecido, sinalizou continuidade do aperto monetário e manutenção dos juros altos por mais tempo nos Estados Unidos e na Europa. Na China, após o anúncio do fim da política de Covid Zero, os primeiros números de atividade já mostram que a economia está retomando o crescimento.

No ambiente doméstico, além dos fatores externos, os principais vetores que influenciaram a trajetória dos mercados no mês foram a incerteza quanto a nova política fiscal, as discussões a respeito de uma possível revisão da meta de inflação e as revisões para cima das projeções de inflação no boletim Focus do Banco Central, que refletiram em retornos negativos, principalmente, para os ativos de maior risco.

Diante desse cenário desafiador, o Ibovespa seguiu os mercados externos e encerrou o mês de fevereiro com desvalorização de 7,49%, revertendo a alta do mês anterior. No mercado de renda fixa, refletindo a perspectiva de aumento de inflação, os títulos públicos atrelados à inflação de curto prazo (NTN-B) voltaram a apresentar performance positiva, superior ao CDI, enquanto os títulos de longo prazo registraram retorno positivo, porém abaixo do CDI, em decorrência das incertezas com a proposta a ser apresentada da nova política fiscal. Os ativos atrelados ao CDI renderam 0,92% no mês. O Real desvalorizou frente ao Dólar na esteira de menor aversão a risco global no mês.

O Plano Viva Pecúlio, modalidade BD (Benefício Definido), fechou o mês de fevereiro com ganho de 0,70%, equivalente à 76% CDI, e abaixo da meta atuarial do mês, 1,15%. No acumulado de 2023, o Plano obteve valorização das cotas em 1,67%, equivalente a 84% da meta referencial no período.

No mês, os destaques positivos da carteira foram os títulos públicos atrelados à inflação de curto prazo (NTN-B) e os ativos de renda fixa vinculados à taxa de juros pós-fixada (títulos públicos remunerados pela Selic – LFT).



Disclaimer

As informações contidas nesta Lâmina são de caráter exclusivamente informativo.

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

A rentabilidade obtida pelo Plano 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 de Investimentos (ABRAPP/ICSS/SINDAPP).

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

A meta atuarial de 2021 é de INPC + 2,42% a.a.

A meta atuarial de 2022 é de INPC + 3,06% a.a.

A meta atuarial de 2023 é de IPCA + 3,72% a.a.