

PLANO VIVA PECÚLIO

Informativo Mensal de Rentabilidade

Março - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	1990.0011-65
Gestão	Viva Previdência
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Patrimônio	R\$ 2.203.499.580
Data do início da cota	31/12/1997
Data	31/03/2022

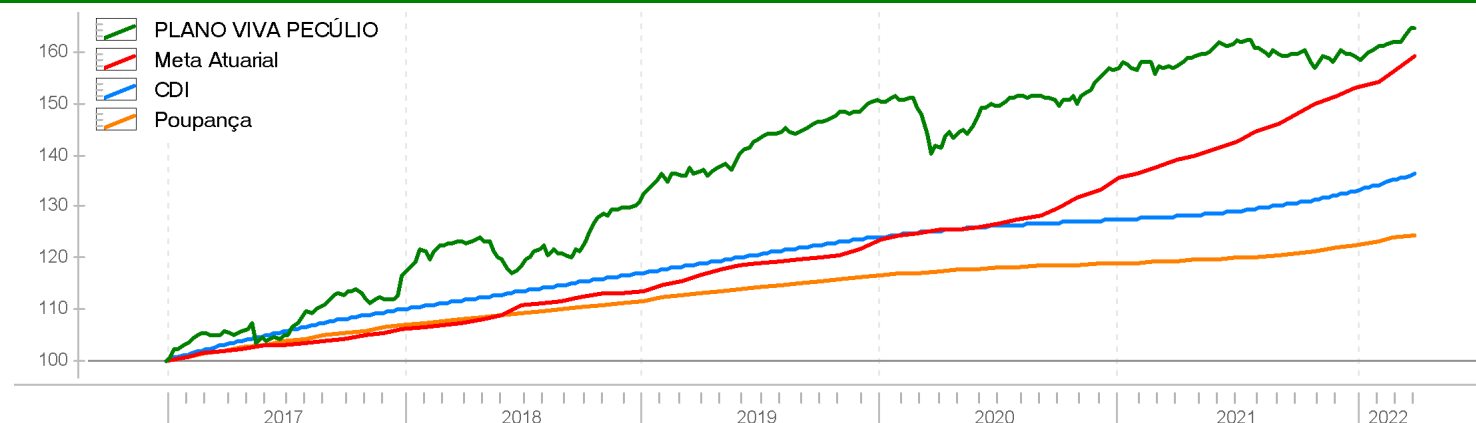
Política de Investimento

O modelo de gestão adota a metodologia de construção de uma macro alocação (casamento entre ativo e passivo) e considera o rebalanceamento das carteiras. Desta forma, poderão ocorrer realocações entre os segmento de investimentos. A composição de carteira utiliza-se de estratégias de investimentos diversificada com objetivo de retorno de médio e longo prazo.

Rentabilidades (%) (até 31/03/2022)

	out 2021	nov 2021	dez 2021	jan 2022	fev 2022	mar 2022	2018	2019	2020	2021	2022	12m	24m
● PLANO VIVA PECÚLIO	-1,41	0,96	0,60	0,89	0,63	1,69	12,49	14,50	4,61	1,57	3,24	4,43	15,67
● Meta Atuarial	1,36	1,04	0,93	0,92	1,25	1,96	7,31	8,72	9,73	12,81	4,18	14,59	27,00
● CDI	0,49	0,59	0,77	0,73	0,76	0,93	6,42	5,96	2,76	4,42	2,43	6,45	8,81
● Poupança	0,36	0,44	0,49	0,56	0,50	0,60	4,62	4,26	2,11	2,99	1,67	4,34	6,10

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	8
Meses Negativos	4
Meses Acima do CDI	5
Meses Abaixo do CDI	7
Maior Retorno Mensal (%)	1,69
Menor Retorno Mensal (%)	-1,41
Retorno Acumulado (%)	4,43
Retorno Acumulado (% CDI)	68,64

Perfil de Risco

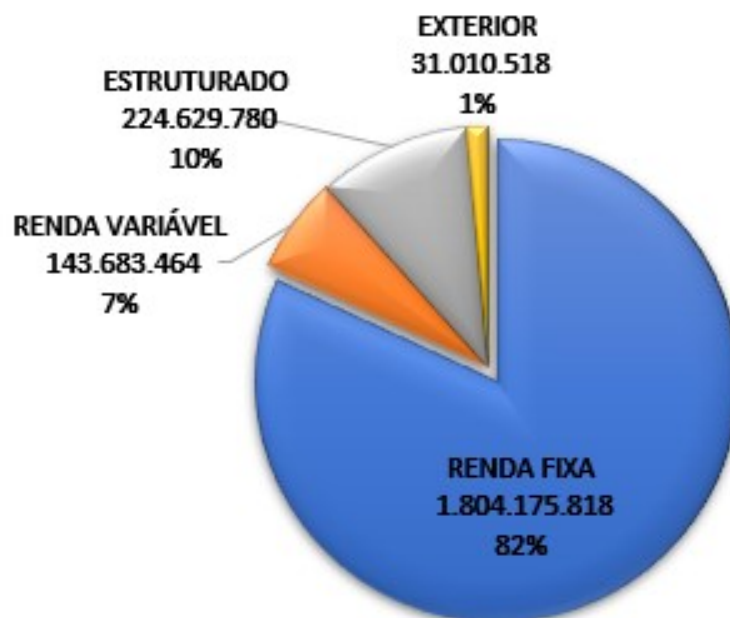
Volatilidade Anual	3,19
Sharpe 12 meses	-0,58
VAR 21 dias	1,34
Máximo Draw down	-3,04
Alfa de Jensen	-1,97

Comentários

Os temas que dominaram as discussões no mercado financeiro no mês de março foram a evolução do conflito bélico entre Rússia e Ucrânia e a mudança da postura do Fed (Banco Central dos EUA). O Fed indicou, na reunião de março, a necessidade de um aperto monetário maior e mais longo, devido (i) inflação elevada, decorrente das ondas de choque dos preços de commodities originadas no conflito entre Rússia e Ucrânia e (ii) mercado de trabalho próximo ao pleno emprego, com alta dos salários e taxa de desemprego baixa, iniciando assim o ciclo de altas de juros em março e indicando altas em todas as reuniões a partir de agora, incluindo alta de 0,50% na reunião de maio. A atividade global foi forte no 1º trimestre do ano, mas deve desacelerar nos próximos meses pelos efeitos (i) do conflito bélico entre Rússia e Ucrânia e (ii) política chinesa de "zeroCovid", com o surgimento de novos casos, levou a nova onda de lockdowns, colocando mais pressão nas cadeias globais de suprimentos, o que está levando a um choque prolongado de oferta. No Brasil, o aumento da taxa SELIC, de 10,75% a.a. para 11,75% a.a. e a valorização dos preços das commodities, continuaram atraindo maior fluxo de capital estrangeiro para os mercados de renda fixa e bolsa de valores, especificamente para as empresas produtoras de commodities.

Diante desse contexto, o Ibovespa encerrou o mês de março em alta de 6,06%, e no acumulado do ano registra valorização de 14,4%. Na renda fixa, todos os segmentos da curva de juros no médio e longo prazo tiveram fechamento das taxas (rentabilidade positiva).

As cotas do Plano Viva Pecúlio registraram, no mês de março, valorização de 1,69%, equivalente a 182% CDI. No ano, o resultado acumulado é positivo em 3,24%, que representou 133% CDI e 78% da meta atuarial. Os segmentos de renda fixa, na carteira terceirizada, e os títulos públicos NTN-B e NTN-C, da carteira própria, foram as maiores contribuições positivas no resultado do mês.



Rentabilidade Acumulada- Valores em (%)

Rentabilidade acumulada no período (%) (Jan/98 - Mar/22) - VIVA PECÚLIO



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 do Plano em 2021 é de INPC + 2,42% a.a.
A meta atuarial do Plano em 2022 é de INPC + 3,06% a.a.