

PLANO VIVA PECÚLIO

Informativo Mensal de Rentabilidade

Maio - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	1990.0011-65
Gestão	Viva Previdência
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Patrimônio	R\$ 2.195.512.239
Data do início da cota	31/12/1997
Data	31/05/2022

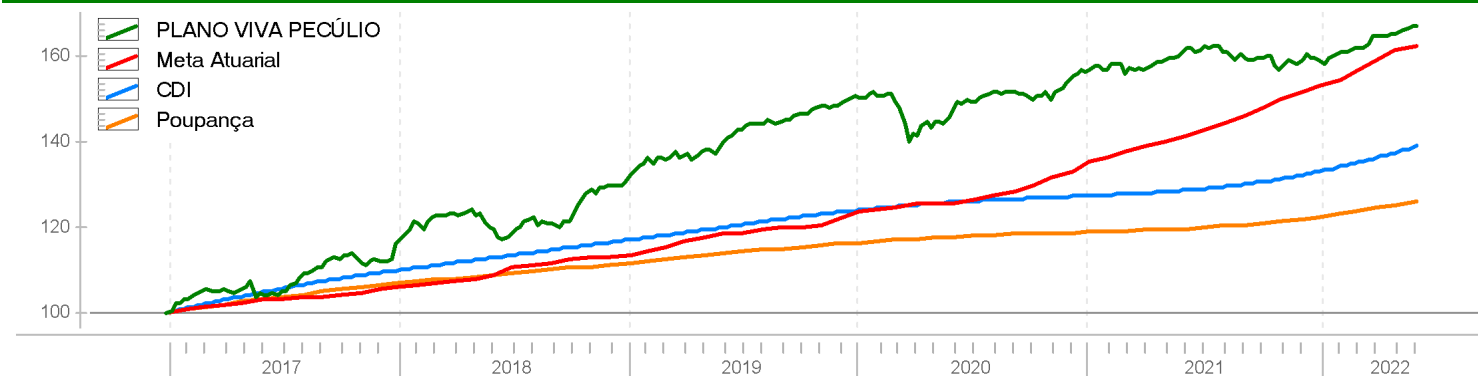
Política de Investimento

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 31/05/2022)

	dez 2021	jan 2022	fev 2022	mar 2022	abr 2022	mai 2022	2018	2019	2020	2021	2022	12m	24m
● PLANO VIVA PECÚLIO	0,60	0,89	0,63	1,69	0,48	1,02	12,49	14,50	4,61	1,57	4,79	3,49	13,31
● Meta Atuarial	0,93	0,92	1,25	1,96	1,29	0,70	7,31	8,72	9,73	12,81	6,27	14,87	29,30
● CDI	0,77	0,73	0,76	0,93	0,83	1,03	6,42	5,96	2,76	4,42	4,36	7,93	10,28
● Poupança	0,49	0,56	0,50	0,60	0,56	0,67	4,62	4,26	2,11	2,99	2,91	5,29	6,94

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	8
Meses Negativos	4
Meses Acima do CDI	3
Meses Abaixo do CDI	9
Maior Retorno Mensal (%)	1,69
Menor Retorno Mensal (%)	-1,41
Retorno Acumulado (%)	3,49
Retorno Acumulado (% CDI)	44,05

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	3,08
Sharpe 12 meses	-1,33
VAR 21 dias	0,66
Máximo Draw down	-3,04
Alfa de Jensen	-4,39

Comentários

No mês de maio, o mercado financeiro aumentou a probabilidade de maior aperto monetário por parte dos bancos centrais mundiais, ou seja, pelo aumento das taxas de juros, para combater os níveis elevados de inflação, aumentando o grau de incertezas e preocupações com a desaceleração do crescimento global. Isso decorre do cenário desafiador enfrentado com o prolongamento do conflito entre Rússia e Ucrânia, que leva a escassez de produtos como trigo, milho, fertilizantes e petróleo, bem como a reabertura econômica na China, após os lockdowns devidos às restrições do Covid-19, aumentando assim as pressões sobre os preços.

No Brasil, os últimos indicadores de atividade econômica e do nível de emprego divulgados têm influenciado nas perspectivas de melhora do crescimento econômico no curto prazo, porém as preocupações com a evolução da economia mundial e a dinâmica da inflação têm apontado para um cenário de indefinição quanto ao fim do ciclo de elevação das taxas de juros.

Neste contexto, as cotas do Plano Viva Pecúlio registraram ganho de 1,02%, equivalente a 99% CDI e 145% da meta atuarial (0,70%), no mês. No acumulado de 2022, o resultado foi positivo em 4,79%, que representou 110% CDI e 76% da meta atuarial. Os segmentos de renda fixa e estruturado (fundos multimercados), na carteira terceirizada, e os títulos públicos NTN-B e NTN-C, da carteira própria, foram as maiores contribuições positivas no resultado do mês.

Distribuição por segmento



Rentabilidade Acumulada- Valores em (%)

Rentabilidade acumulada no período (%) (Jan/98 - Mai/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.