

PLANO VIVA PECÚLIO

Informativo Mensal de Rentabilidade

Agosto - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	1990.0011-65
Gestão	Viva Previdência
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Patrimônio	R\$ 2.179.695.733
Data do início da cota	31/12/1997
Data	31/08/2022

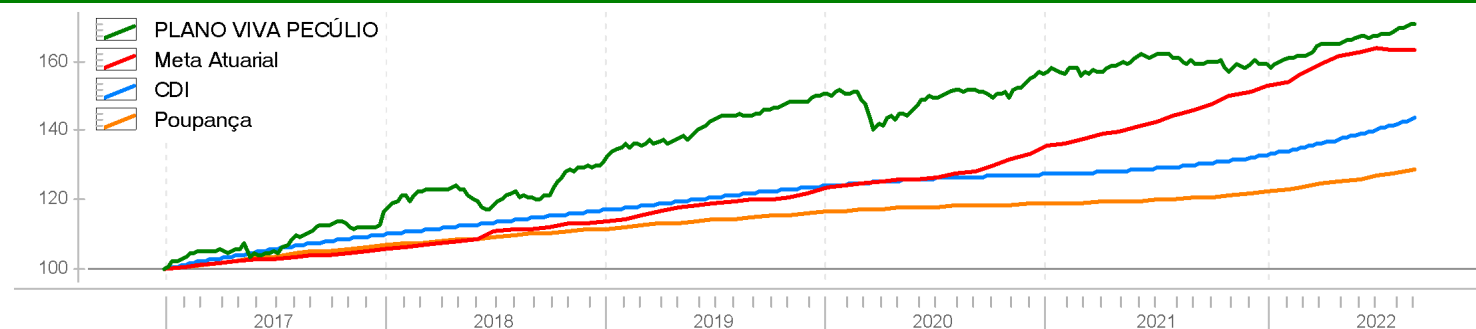
Política de Investimento

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 31/08/2022)

	ago 2022	jul 2022	jun 2022	mai 2022	abr 2022	mar 2022	2022	2021	2020	2019	2018	24m	12m
● PLANO VIVA PECÚLIO	1,16	0,85	0,27	1,02	0,48	1,69	7,19	1,57	4,61	14,50	12,49	13,05	6,90
● Meta Atuarial	-0,06	-0,35	0,87	0,70	1,29	1,96	6,75	12,81	9,73	8,72	7,31	27,20	11,89
● CDI	1,17	1,03	1,02	1,03	0,83	0,93	7,75	4,42	2,76	5,96	6,42	13,23	10,23
● Poupança	0,74	0,66	0,65	0,67	0,56	0,60	5,04	2,99	2,11	4,26	4,62	8,68	6,72

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	10
Meses Negativos	2
Meses Acima do CDI	3
Meses Abaixo do CDI	9
Maior Retorno Mensal (%)	1,69
Menor Retorno Mensal (%)	-1,41
Retorno Acumulado (%)	6,90
Retorno Acumulado (% CDI)	67,38

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	2,67
Sharpe 12 meses	-1,12
VAR 21 dias	0,39
Máximo Draw down	-1,41
Alfa de Jensen	-3,32

Comentários

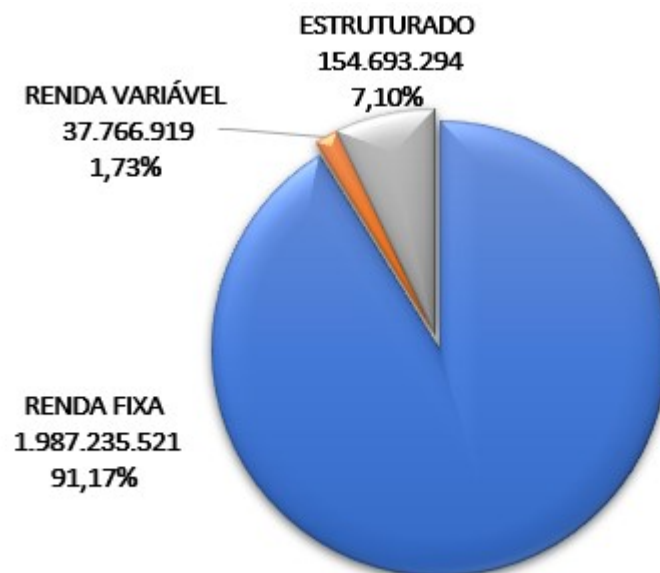
O mês foi marcado por um movimento de aversão a risco no mercado internacional, após a percepção da necessidade de uma postura mais agressiva dos bancos centrais dos países desenvolvidos, na condução da política monetária, após dados mais forte do que o esperado de inflação, especialmente nos Estados Unidos. No Brasil, o mercado descolou dos ativos globais e performou positivamente com a dinâmica favorável na expectativa de encerramento do ciclo de alta na taxa de juros pelo Banco Central, nas revisões da trajetória de inflação para baixo e na recuperação da atividade econômica e, conseqüentemente, no crescimento do PIB.

Na contramão dos mercados externos, o Ibovespa (principal índice do mercado de ações brasileiro) fechou o mês de agosto com alta de 6,16%, impulsionado com a entrada de recursos de investidores estrangeiros no valor aproximado de R\$ 14 bilhões, apesar da queda das cotações dos preços das commodities. Na renda fixa, com a expectativa do mercado de que o Banco Central poderia encerrar o ciclo de alta da taxa de juros, as aplicações vinculadas aos índices ligados a taxa de juros nominal IRF-M (índice da carteira de títulos públicos prefixados) e os títulos públicos federais atrelados à inflação longa (IMA-B 5+) tiveram bons resultados no mês de agosto, 2,05% e 2,49%, respectivamente. Os ativos vinculados ao CDI registraram ganhos de 1,17% no mês.

Em linha com o restante do mercado, o IHFA (índice de fundos multimercado) registrou ganhos de 2,44% no mês de agosto. Por fim, o Dólar americano fechou o mês cotado a R\$ 5,17, estável frente ao Real, mas na posição contrária dos mercados globais, onde o Dólar obteve valorização frente às outras moedas.

Nesse contexto, as cotas do Plano Viva Pecúlio registraram ganho de 1,16%, equivalente a 99% CDI, e acima da meta atuarial, que foi -0,06%, no mês de agosto. No acumulado do ano, a rentabilidade do Plano é de 7,19%, que representou 93% CDI e superou a meta atuarial em 106%. O segmento de renda variável e de multimercados foram as maiores contribuições positivas do resultado no mês.

Distribuição por segmento



Rentabilidade Acumulada- Valores em (%)

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