

# PLANO VIVA FUTURO

## Informativo Mensal de Rentabilidade

### Setembro - 2022



#### Características

|                                                 |                   |
|-------------------------------------------------|-------------------|
| CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios | 2019.0007-92      |
| Gestão                                          | Viva Previdência  |
| Custódia Centralizada                           | Banco BTG Pactual |
| Patrimônio                                      | R\$ 9.889.645     |
| Data do início da cota                          | 19/06/2019        |
| Data                                            | 30/09/2022        |

#### Política de Investimento

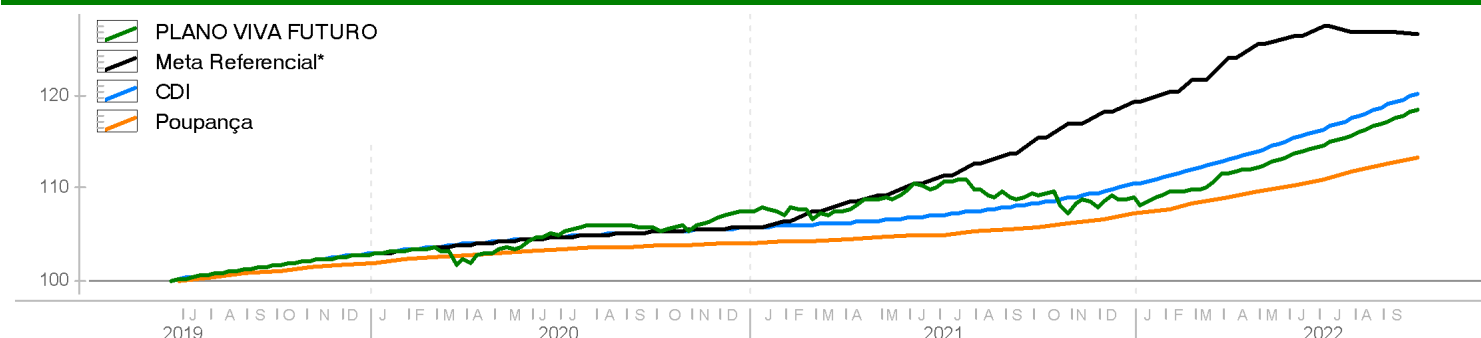
O modelo de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e benchmarks. Para a consecução de seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com objetivo de médio e longo prazo. A composição de investimentos prevê a possibilidade de utilizar-se de estratégias de investimentos diversificada, analisando sempre a relação risco e retorno.

#### Rentabilidades (%) (até 30/09/2022)

|                     | set 2022 | ago 2022 | jul 2022 | jun 2022 | mai 2022 | abr 2022 | 2022 | 2021  | 12m   | 6m   |
|---------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|------|-------|-------|------|
| ● PLANO VIVA FUTURO | 1,11     | 1,22     | 1,01     | 1,01     | 1,04     | 0,73     | 8,73 | 1,33  | 8,81  | 6,28 |
| ● Meta Referencial* | -0,12    | -0,11    | -0,40    | 0,82     | 0,65     | 1,24     | 6,20 | 12,81 | 9,78  | 2,09 |
| ● CDI               | 1,07     | 1,17     | 1,03     | 1,02     | 1,03     | 0,83     | 8,91 | 4,42  | 10,93 | 6,32 |
| ● Poupança          | 0,68     | 0,74     | 0,66     | 0,65     | 0,67     | 0,56     | 5,76 | 2,99  | 7,13  | 4,03 |

\* Até 03/20 a meta referencial estava em 97% do CDI. A partir de 04/20 passou para 110% do CDI. Em 2021 e 2022 a meta referencial é INPC+2.42% aa.

#### Retorno Acumulado



#### Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

|                           |       |
|---------------------------|-------|
| Meses Positivos           | 11    |
| Meses Negativos           | 1     |
| Meses Acima do CDI        | 6     |
| Meses Abaixo do CDI       | 6     |
| Maior Retorno Mensal (%)  | 1,50  |
| Menor Retorno Mensal (%)  | -1,53 |
| Retorno Acumulado (%)     | 8,81  |
| Retorno Acumulado (% CDI) | 80,62 |

#### Perfil de Risco

|                    |       |
|--------------------|-------|
| Volatilidade Anual | 2,24  |
| Sharpe 12 meses    | -0,85 |
| VAR 21 dias        | 0,03  |
| Máximo Drawdown    | 0,00  |
| Alfa de Jensen     | -2,09 |

#### Comentários

O mês de setembro foi marcado pela forte aversão a risco nos mercados internacionais devido aos seguintes fatores: (I) continuidade do movimento de desaceleração da economia global, (II) novos dados negativos de inflação vindos dos EUA e Europa, e (III) anúncio de novo plano econômico no Reino Unido. Os efeitos sobre os mercados financeiros foram a queda acentuada nas principais bolsas de valores mundiais, maior volatilidade no preço dos ativos e aumento das taxas de juros globais.

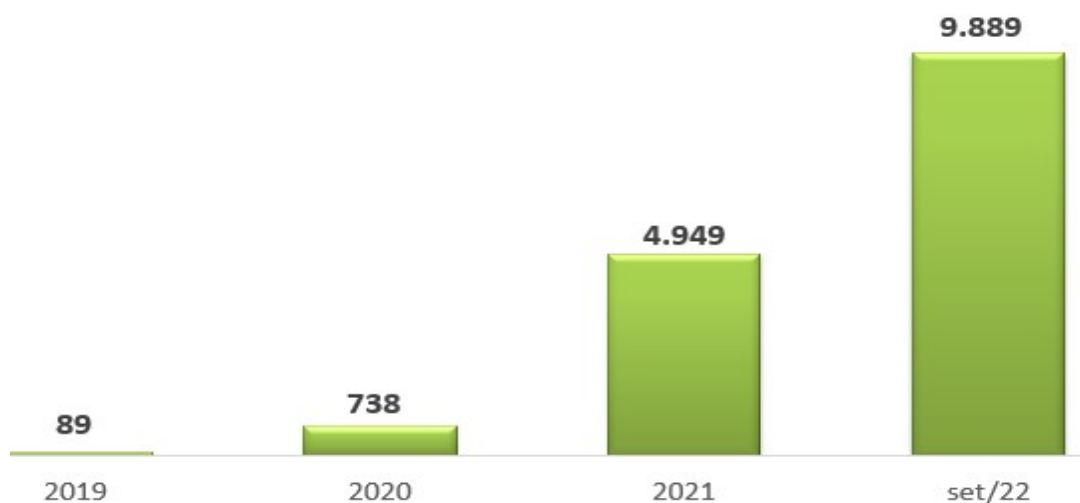
O mercado doméstico, na contramão dos mercados externos, pelo segundo mês consecutivo performou positivamente. Os vetores determinantes foram: (I) a queda nas projeções de inflação, (II) as revisões altistas do crescimento econômico, (III) a melhora da taxa de desemprego e (III) o encerramento do ciclo de alta da taxa de juros pelo BACEN.

No mês, os destaques positivos das aplicações em renda fixa foram os ativos vinculados à taxa de juros nominal (LTN) e real de médio e longo prazo (NTN-B). Os ativos atrelados ao CDI/Selic apresentaram ganhos de 1,07%. Em linha com o ambiente interno favorável, o Ibovespa (principal índice da bolsa brasileira) fechou em alta de 0,47%, enquanto o IHFA (índice de fundos multimercados) subiu 1,49%, no mês. Por fim, o Dólar americano fechou setembro com valorização de 4,39% frente ao Real, no mês em que a moeda americana voltou a se fortalecer globalmente com o aumento de taxas de juros americanas.

O Plano Viva Futuro registrou, no mês de setembro, desempenho positivo de 1,11%, que representa 104% CDI e superior ao índice de referência, que foi de -0,12%. No acumulado do ano até setembro, o Plano obteve ganho de 8,73%, equivalente a 98% CDI e superior ao índice de referência em 141%. Os segmentos de renda fixa e multimercado foram os que mais contribuíram para a performance positiva no mês.



Evolução Patrimonial - Valores em mil (R\$)



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 referencial do Plano em 2021 e 2022 é de INPC+2,42% a.a..