

PLANO VIVA PECÚLIO

Informativo Mensal de Rentabilidade Setembro - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	1990.0011-65
Gestão	Viva Previdência
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Patrimônio	R\$ 2.189.008.282
Data do início da cota	31/12/1997
Data	30/09/2022

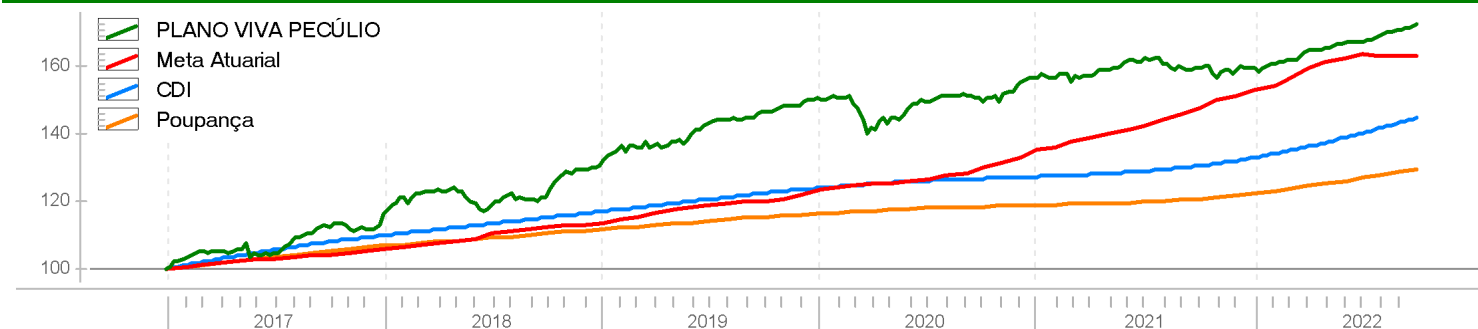
Política de Investimento

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 30/09/2022)

	set 2022	ago 2022	jul 2022	jun 2022	mai 2022	abr 2022	2022	2021	2020	2019	2018	24m	12m
● PLANO VIVA PECÚLIO	1,02	1,16	0,85	0,27	1,02	0,48	8,28	1,57	4,61	14,50	12,49	15,02	8,42
● Meta Atuarial	-0,07	-0,06	-0,35	0,87	0,70	1,29	6,68	12,81	9,73	8,72	7,31	25,60	10,27
● CDI	1,07	1,17	1,03	1,02	1,03	0,83	8,91	4,42	2,76	5,96	6,42	14,26	10,93
● Poupança	0,68	0,74	0,66	0,65	0,67	0,56	5,76	2,99	2,11	4,26	4,62	9,30	7,13

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	11
Meses Negativos	1
Meses Acima do CDI	3
Meses Abaixo do CDI	9
Maior Retorno Mensal (%)	1,69
Menor Retorno Mensal (%)	-1,41
Retorno Acumulado (%)	8,42
Retorno Acumulado (% CDI)	77,06

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	2,40
Sharpe 12 meses	-0,93
VAR 21 dias	0,39
Máximo Draw down	0,00
Alfa de Jensen	-2,47

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.

Com isso, as cotas do Plano Viva Pecúlio registraram, no mês de setembro, ganho de 1,02%, equivalente a 95% CDI. No ano, o resultado acumulado é positivo em 8,28%, que representa 93% CDI e superior à meta atuarial (6,68%) no período, em 123%. Os segmentos de renda fixa e estruturados (multimercados), na carteira terceirizada, voltaram a se destacar como as maiores

Distribuição por segmento



Rentabilidade Acumulada- Valores em (%)

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