

Plano VIVA EMPRESARIAL

Informativo Mensal de Rentabilidade

Março - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2005.0006-47
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 90.156.803
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	24/05/2005
Data	31/03/2022

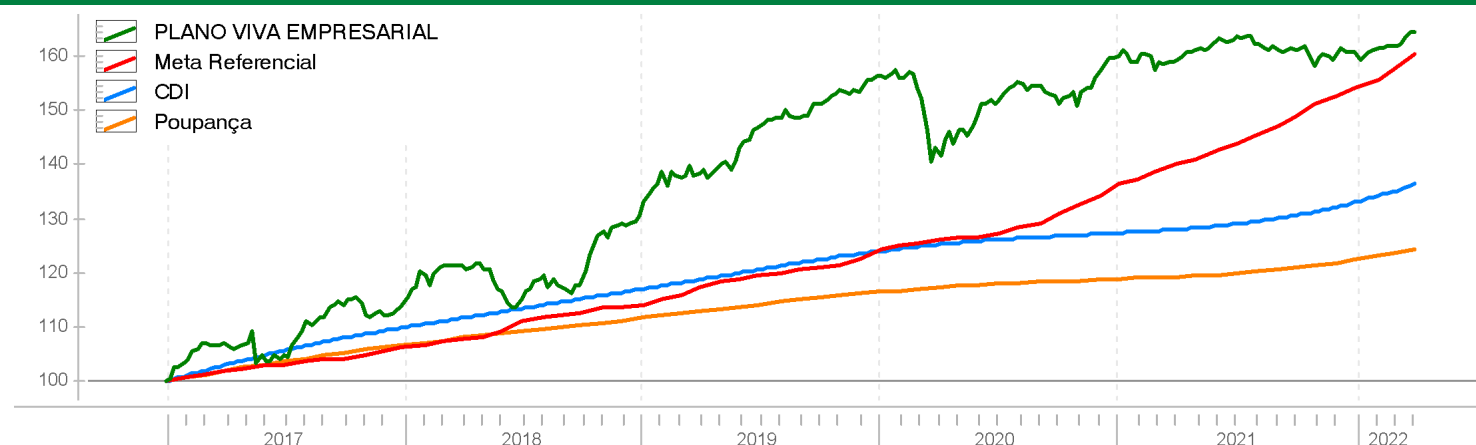
Política de Investimento

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

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 EMPRESARIAL	-1,59	0,68	0,83	0,40	0,48	1,47	14,46	19,34	2,68	0,37	2,36	3,09	14,73
● Meta Referencial	1,36	1,04	0,93	0,87	1,20	1,91	7,57	8,86	9,86	12,81	4,03	14,42	26,93
● 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 (%)	1,47
Menor Retorno Mensal (%)	-1,59
Retorno Acumulado (%)	3,09
Retorno Acumulado (% CDI)	47,86

Perfil de Risco

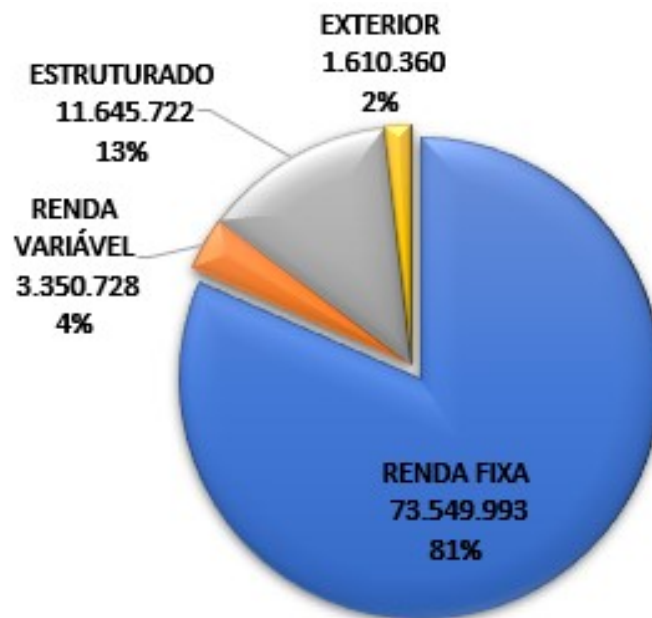
Volatilidade Anual	2,05
Sharpe 12 meses	-0,49
VAR 21 dias	0,90
Máximo Draw down	-3,01
Alfa de Jansen	-3,18

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).

O Plano Viva Empresarial obteve resultado positivo no mês de março de 1,47%, equivalente a 159% CDI. No acumulado do 1º trimestre de 2022, o Plano obteve valorização das cotas em 2,36% equivalente a 97% CDI, que representou 60% da meta referencial. Os segmentos de renda fixa, renda variável e multimercado foram os que mais contribuíram para a performance positiva no mês.



Rentabilidade Acumulada - Valores em (%)

Rentabilidade acumulada no período (Jun/05 a Mar/22)- VIVA Empresarial



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.