

PLANO VIVA EMPRESARIAL

Informativo Mensal de Rentabilidade

Dezembro - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2005.0006-47
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 103.283.520
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	24/05/2005
Data	30/12/2022

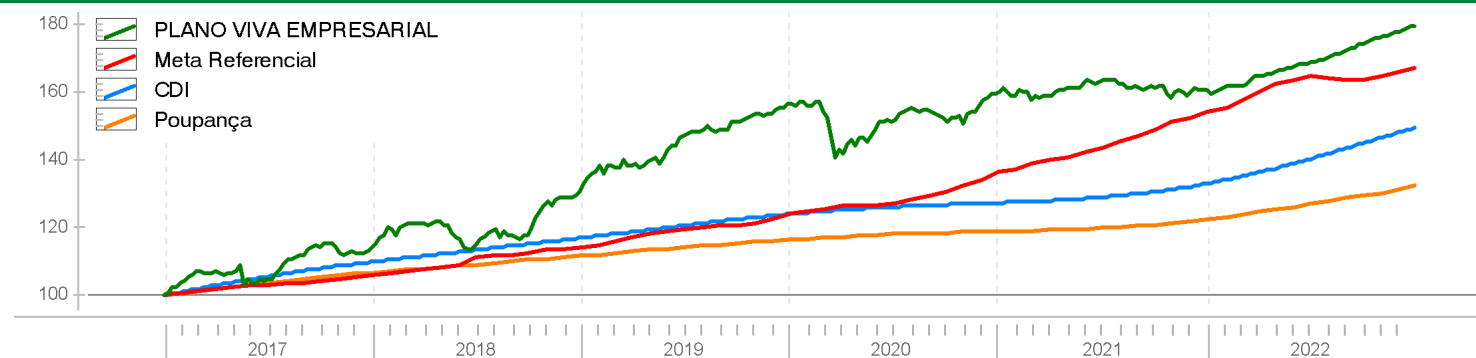
Política de Investimento

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 31/12/2022)

	dez 2022	nov 2022	out 2022	set 2022	ago 2022	jul 2022	2022	2021	2020	2019	2018	24m	12m
● PLANO VIVA EMPRESARIAL	1,04	0,90	1,07	1,16	1,22	0,85	11,79	0,37	2,68	19,34	14,46	12,20	11,79
● Meta Referencial	0,89	0,58	0,67	-0,12	-0,11	-0,40	8,49	12,81	9,86	8,86	7,57	22,39	8,49
● CDI	1,12	1,02	1,02	1,07	1,17	1,03	12,39	4,42	2,76	5,96	6,42	17,36	12,39
● Poupança	0,71	0,65	0,65	0,68	0,74	0,66	7,90	2,99	2,11	4,26	4,62	11,12	7,90

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Meses Acima do CDI	5
Meses Abaixo do CDI	7
Maior Retorno Mensal (%)	1,47
Menor Retorno Mensal (%)	0,40
Retorno Acumulado (%)	11,79
Retorno Acumulado (% CDI)	95,13

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	1,15
Sharpe 12 meses	-0,58
VAR 21 dias	0,07
Máximo Drawdown	0,00
Alfa de Jansen	-0,74

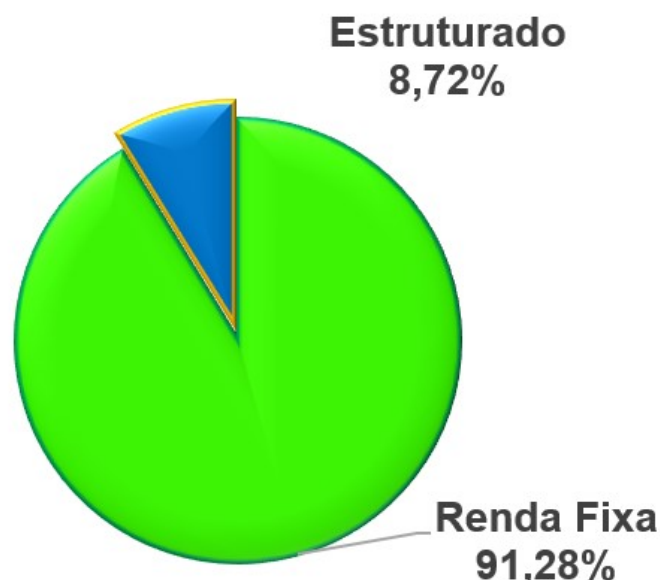
Comentários

O mês de dezembro foi negativo para os ativos de riscos globais com os principais índices acionários fechando em queda. Esse movimento desfavorável foi impactado pelos comunicados mais hawkish do que o esperado do FED e do BCE, indicando que a taxa de juros pode permanecer em patamares elevados por mais tempo, apesar da melhora observada no ambiente inflacionário. Na China, na contramão dos mercados externos, os ativos locais e as commodities performaram positivamente impulsionados pela abertura da economia relacionadas as novas medidas de alívio às restrições da Covid-19.

No Brasil, além do sentimento de maior aversão ao risco vindo dos mercados desenvolvidos, os ativos apresentaram alta volatilidade devido às incertezas fiscais com a aprovação da PEC da transição. Diante desse cenário, o índice IBOVESPA apresentou queda, o Real desvalorizou frente ao Dólar e as taxas de juros nominais e reais de curto prazo recuaram, mas as taxas de juros reais de longo prazo subiram.

No mês, os destaques positivos ficaram com os ativos de renda fixa vinculados à taxa de juros pós-fixada (títulos públicos remunerados pela Selic - LFT), além dos ativos de crédito privado.

O Plano Viva Empresarial alcançou resultado positivo no mês de dezembro de 1,04%, equivalente a 93% CDI, e superior à meta referencial, que foi de 0,89%. No ano de 2022, o Plano rentabilizou 11,79%, equivalente a 95% CDI, superando o índice referencial em 138%. Os segmentos de renda fixa e estruturados (fundos multimercado) foram os que mais contribuíram para a performance positiva no ano.



Rentabilidade Acumulada - Valores em (%)

Rentabilidade acumulada % - (Jun/05 a dez/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.