

PLANO VIVA FUTURO

Informativo Mensal de Rentabilidade

Fevereiro - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2019.0007-92
Gestão	Viva Previdência
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Patrimônio	R\$ 5.865.639
Data do início da cota	19/06/2019
Data	25/02/2022

Política de Investimento

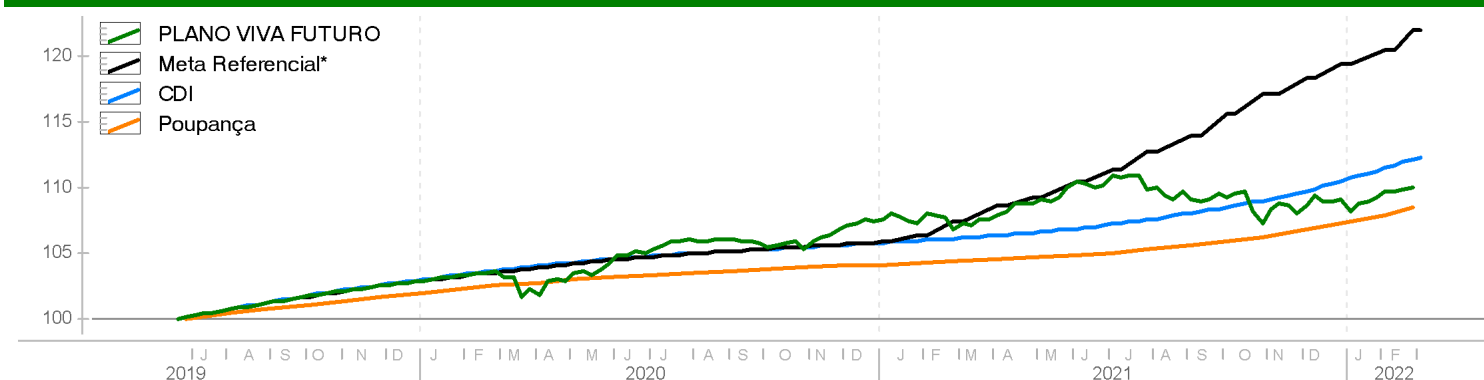
O modelo de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e benchmarks. Para a consecução de seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com objetivo de médio e longo prazo. A composição de investimentos prevê a possibilidade de utilizar-se de estratégias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

Rentabilidades (%) (até 28/02/2022)

	set 2021	out 2021	nov 2021	dez 2021	jan 2022	fev 2022	2021	2022	6m	12m
● PLANO VIVA FUTURO	-0,32	-1,53	0,68	0,93	0,39	0,40	1,33	0,80	0,54	2,95
● Meta Referencial*	1,40	1,36	1,04	0,93	0,87	1,20	12,81	2,08	6,99	13,46
● CDI	0,44	0,49	0,59	0,77	0,73	0,76	4,42	1,49	3,83	5,68
● Poupança	0,30	0,36	0,44	0,49	0,56	0,50	2,99	1,06	2,68	3,84

* 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	8
Meses Negativos	4
Meses Acima do CDI	6
Meses Abaixo do CDI	6
Maior Retorno Mensal (%)	1,12
Menor Retorno Mensal (%)	-1,53
Retorno Acumulado (%)	2,95
Retorno Acumulado (% CDI)	51,86

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	3,29
Sharpe 12 meses	-0,77
VAR 21 dias	0,64
Máximo Draw down	-2,83
Alfa de Jensen	-2,67

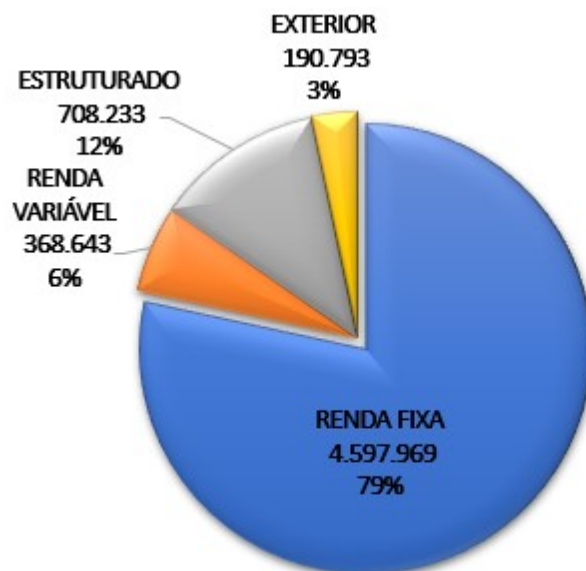
Comentários

O mês de fevereiro foi marcado nos mercados internacionais pela forte aversão a risco, devido aos seguintes fatores: (i) início do conflito bélico entre Rússia e Ucrânia; (ii) o aumento significativo nos preços das commodities, principalmente energia e alimentos, e (iii) a deterioração dos dados de inflação nos EUA e na Europa, que exigiram dos BCs dos países desenvolvidos um tom mais duro, sinalizando política monetária mais conservadora para o ano de 2022, com aumento nas taxas de juros. Os efeitos sobre os mercados financeiros foram a queda acentuada nas principais bolsas de valores mundiais e maior volatilidade dos juros globais.

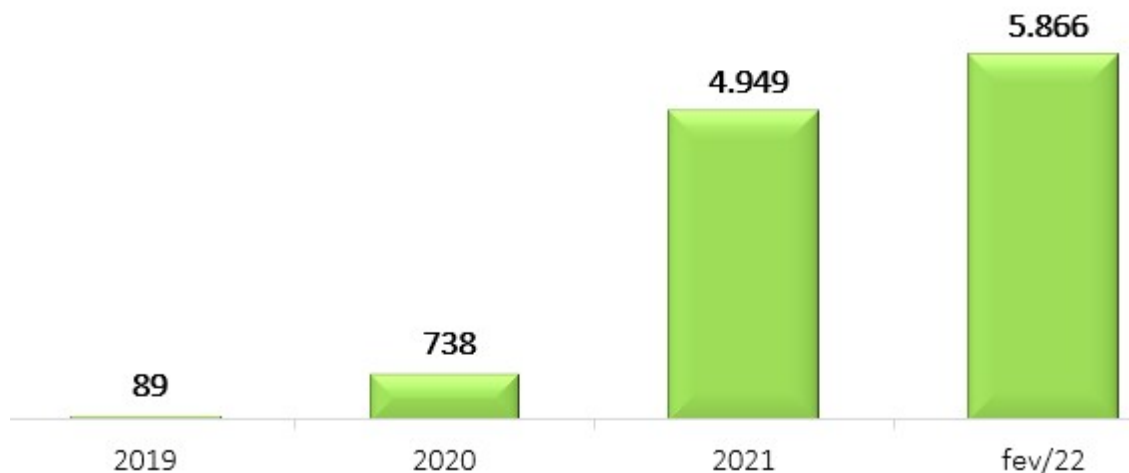
O mercado acompanhou os desdobramentos do conflito bélico entre Rússia e Ucrânia e seus possíveis impactos sobre a inflação global e a redução do ritmo da atividade econômica mundial. No Brasil, apesar dos impactos negativos da crise geopolítica, na contramão do mercado financeiro externo, o índice Ibovespa fechou em alta, beneficiado principalmente pela entrada de fluxo financeiro de investidor estrangeiro, e pelo momento positivo no preço das commodities, que beneficiou as empresas como Petrobras. O Comitê de Política Monetária, no mês de fevereiro, apesar da política monetária contracionista, sinalizou, para a próxima reunião, expectativa de redução do ritmo da alta de juros.

Diante desse contexto, o Ibovespa encerrou o mês de fevereiro com valorização de 0,89%, e no acumulado do ano registra ganho de 7,94%. No mercado de renda fixa, a curva de juros voltou a subir em todos os vértices (vencimentos) devido à expectativa de aumento nos índices de inflação. O Plano Viva Futuro registrou, no mês de fevereiro, desempenho positivo de 0,40%, que representou 53% CDI. No acumulado do ano, o Plano obteve ganho de 0,80%, equivalente a 54% CDI. Os segmentos de renda fixa e multimercado foram os que mais contribuíram para a performance positiva no mês.

Distribuição por Segmento



Evolução Patrimonia - 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..