

PLANO VIVA PECÚLIO

Informativo Mensal de Rentabilidade

Junho - 2022



Características

| | |
|---|-------------------|
| CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios | 1990.0011-65 |
| Gestão | Viva Previdência |
| Custódia Centralizada | Banco BTG Pactual |
| Patrimônio | R\$ 2.176.037.702 |
| Data do início da cota | 31/12/1997 |
| Data | 30/06/2022 |

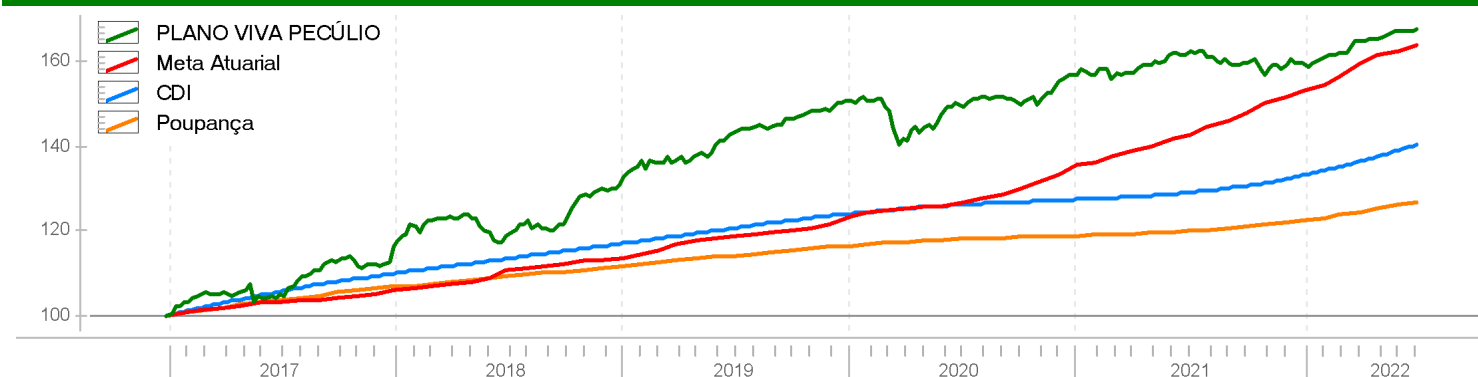
Política de Investimento

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 30/06/2022)

| | jan 2022 | fev 2022 | mar 2022 | abr 2022 | mai 2022 | jun 2022 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | 12m | 24m |
|----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|-------|-------|------|-------|------|-------|-------|
| ● PLANO VIVA PECÚLIO | 0,89 | 0,63 | 1,69 | 0,48 | 1,02 | 0,27 | 12,49 | 14,50 | 4,61 | 1,57 | 5,07 | 3,46 | 12,60 |
| ● Meta Atuarial | 0,92 | 1,25 | 1,96 | 1,29 | 0,70 | 0,87 | 7,31 | 8,72 | 9,73 | 12,81 | 7,19 | 14,95 | 29,61 |
| ● CDI | 0,73 | 0,76 | 0,93 | 0,83 | 1,03 | 1,02 | 6,42 | 5,96 | 2,76 | 4,42 | 5,42 | 8,69 | 11,17 |
| ● Poupança | 0,56 | 0,50 | 0,60 | 0,56 | 0,67 | 0,65 | 4,62 | 4,26 | 2,11 | 2,99 | 3,58 | 5,80 | 7,45 |

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

| | |
|---------------------------|-------|
| Meses Positivos | 8 |
| Meses Negativos | 4 |
| Meses Acima do CDI | 3 |
| Meses Abaixo do CDI | 9 |
| Maior Retorno Mensal (%) | 1,69 |
| Menor Retorno Mensal (%) | -1,41 |
| Retorno Acumulado (%) | 3,46 |
| Retorno Acumulado (% CDI) | 39,86 |

Perfil de Risco

| | |
|--------------------|-------|
| Volatilidade Anual | 3,03 |
| Sharpe 12 meses | -1,58 |
| VAR 21 dias | 0,43 |
| Máximo Draw down | -2,48 |
| Alfa de Jensen | -5,19 |

Comentários

Em junho ocorreu uma deterioração do cenário econômico devido às preocupações relacionadas às pressões inflacionárias, especialmente nos EUA e na Europa. Como resultado, os principais bancos centrais sinalizaram a perspectiva de política monetária ainda mais restritiva, que aliados à política de Covid zero na China, vem fazendo com que sejam revistas para baixo as projeções de crescimento e aumentaram o receio de uma recessão Global.

Diante desse cenário de incertezas para inflação e juros, a maioria dos índices globais de bolsas internacionais fecharam o mês com variação negativa. Além disso, observou-se maior volatilidade, com aumento das taxas de juros de curto prazo. No mercado doméstico, como a inflação continua pressionada e sem sinais de arrefecimento os ativos de risco seguiram dinâmicas similares à observada nos mercados internacionais.

Nesse ambiente adverso, no mês, o Ibovespa registrou perdas de 11,50%, também afetado negativamente pelo recuo nas cotações das commodities. O Real depreciou 9,95%, frente ao Dólar, em linha com o fortalecimento global da moeda americana dentro do ambiente de maiores incertezas. Por fim, no mercado de juros, a persistência de pressões inflacionárias e os subsequentes desdobramentos de política monetária, continua exercendo pressão de alta nas taxas de juros locais. Além disso, o risco fiscal aumentou com a aprovação, pelo Senado Federal, de medidas para mitigar o efeito da alta dos preços dos combustíveis e concessões de novos auxílios sociais, que não estava previsto na lei de responsabilidade fiscal e no limite do teto de gastos.

Neste contexto, as cotas do Plano Viva Pecúlio registraram ganho de 0,27%, abaixo do CDI, que registrou alta de 1,02% e da meta atuarial, 0,87%, no mês. No fechamento do 1º semestre de 2022, o resultado foi positivo em 5,07%, que representou 94% CDI e 71% da meta atuarial. O segmento de renda fixa pós fixados vinculado ao CDI, na carteira terceirizada, e os títulos públicos NTN-C atrelado ao IGP-M, da carteira própria, foram as maiores contribuições positivas no resultado do mês.

Distribuição por segmento



Rentabilidade Acumulada- Valores em (%)

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