

PLANO VIVA PECÚLIO

Informativo Mensal de Rentabilidade Outubro - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	1990.0011-65
Gestão	Viva Previdência
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Patrimônio	R\$ 2.189.046.301
Data do início da cota	31/12/1997
Data	31/10/2022

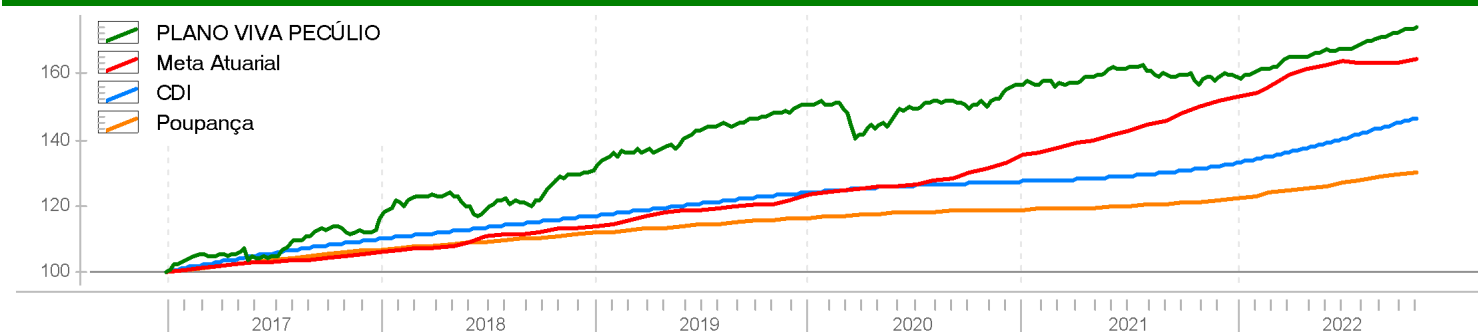
Política de Investimento

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 31/10/2022)

	out 2022	set 2022	ago 2022	jul 2022	jun 2022	mai 2022	2022	2021	2020	2019	2018	24m	12m
● PLANO VIVA PECÚLIO	0,88	1,02	1,16	0,85	0,27	1,02	9,24	1,57	4,61	14,50	12,49	16,24	10,94
● Meta Atuarial	0,72	-0,07	-0,06	-0,35	0,87	0,70	7,45	12,81	9,73	8,72	7,31	24,98	9,57
● CDI	1,02	1,07	1,17	1,03	1,02	1,03	10,02	4,42	2,76	5,96	6,42	15,25	11,52
● Poupança	0,65	0,68	0,74	0,66	0,65	0,67	6,45	2,99	2,11	4,26	4,62	9,88	7,44

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Meses Acima do CDI	3
Meses Abaixo do CDI	9
Maior Retorno Mensal (%)	1,69
Menor Retorno Mensal (%)	0,27
Retorno Acumulado (%)	10,94
Retorno Acumulado (% CDI)	95,02

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	2,09
Sharpe 12 meses	-0,24
VAR 21 dias	0,42
Máximo Draw down	0,00
Alfa de Jensen	-0,55

Comentários

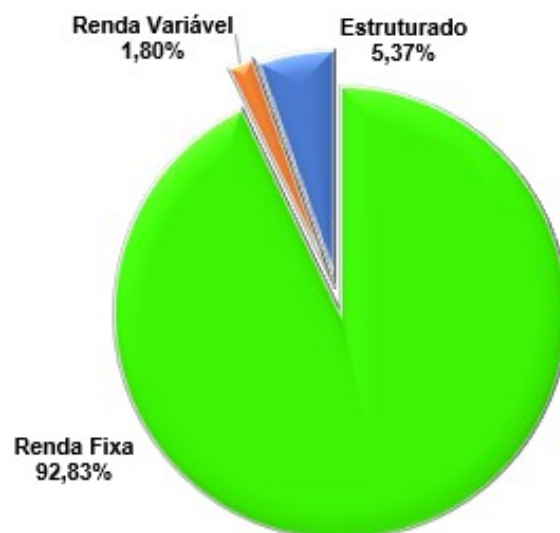
Outubro foi um mês de recuperação para ativos de risco nos mercados internacionais. A expectativa de uma trajetória mais suave de altas de juros para os principais bancos centrais globais e o arrefecimento da turbulência política no Reino Unido foram os principais fatores responsáveis pela melhora dos mercados. Por outro, a continuação de políticas de Zero Covid na China impactou negativamente os mercados.

No Brasil, os ativos de risco acompanharam o avanço dos mercados mundiais, com valorização da bolsa de valores e boa performance do Real frente ao Dólar, diante de um ambiente doméstico de elevada volatilidade em função das eleições.

No mês, os destaques positivos das aplicações em renda fixa foram os ativos atrelados a taxa de juros e vinculados à inflação de curto prazo (NTN -B). O destaque dos ativos de risco no mercado local foi o Ibovespa (principal índice da bolsa brasileira) que fechou em alta de 5,45%. O IHFA (Índice de Fundos Multimercados da Anbima) subiu 1,34% no mês. Por fim, o Dólar americano fechou outubro com desvalorização de 2,77% frente ao Real.

Com isso, o Plano Viva Pecúlio registrou, no mês de outubro, ganho de 0,88%, superior à meta atuarial de 0,72%. No ano, o resultado acumulado é positivo em 9,24%, que representa 93% CDI e superior à meta atuarial (7,45%) no período, em 124%. Os maiores ganhos da carteira vieram das posições de títulos públicos (NTN-B) da carteira própria, e dos segmentos de estruturados (multimercados) e da renda fixa (fundos ativos), na carteira terceirizada.

Distribuição por segmento



Rentabilidade Acumulada- Valores em (%)

Rentabilidade acumulada - (%) (Jan/98 - Out/22)



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.