

PLANO VIVA FUTURO

Informativo Mensal de Rentabilidade

Dezembro - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2019.0007-92
Gestão	Viva Previdência
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Patrimônio	R\$ 10.085.828
Data do início da cota	19/06/2019
Data	30/12/2022

Política de Investimento

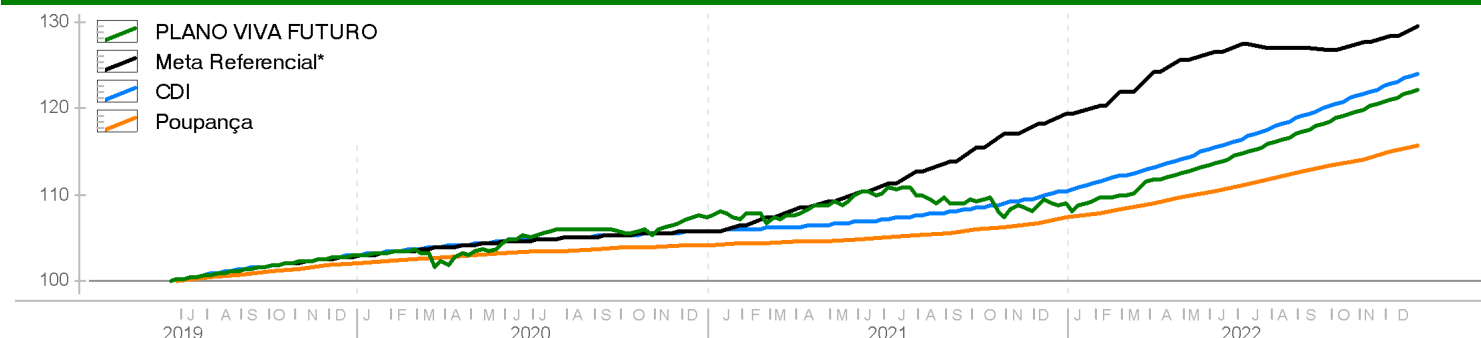
O modelo de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e benchmarks. Para a consecução de seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com objetivo de médio e longo prazo. A composição de investimentos prevê a possibilidade de utilizar-se de estratégias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

Rentabilidades (%) (até 31/12/2022)

	dez 2022	nov 2022	out 2022	set 2022	ago 2022	jul 2022	2022	2021	12m	6m
● PLANO VIVA FUTURO	1,11	0,98	1,04	1,11	1,22	1,01	12,17	1,33	12,17	6,65
● Meta Referencial*	0,89	0,58	0,67	-0,12	-0,11	-0,40	8,49	12,81	8,49	1,51
● CDI	1,12	1,02	1,02	1,07	1,17	1,03	12,39	4,42	12,39	6,62
● Poupança	0,71	0,65	0,65	0,68	0,74	0,66	7,90	2,99	7,90	4,17

* 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	12
Meses Negativos	0
Meses Acima do CDI	5
Meses Abaixo do CDI	7
Maior Retorno Mensal (%)	1,50
Menor Retorno Mensal (%)	0,39
Retorno Acumulado (%)	12,17
Retorno Acumulado (% CDI)	98,26

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	1,08
Sharpe 12 meses	-0,19
VAR 21 dias	0,01
Máximo Drawdown	0,00
Alfa de Jensen	-0,23

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.

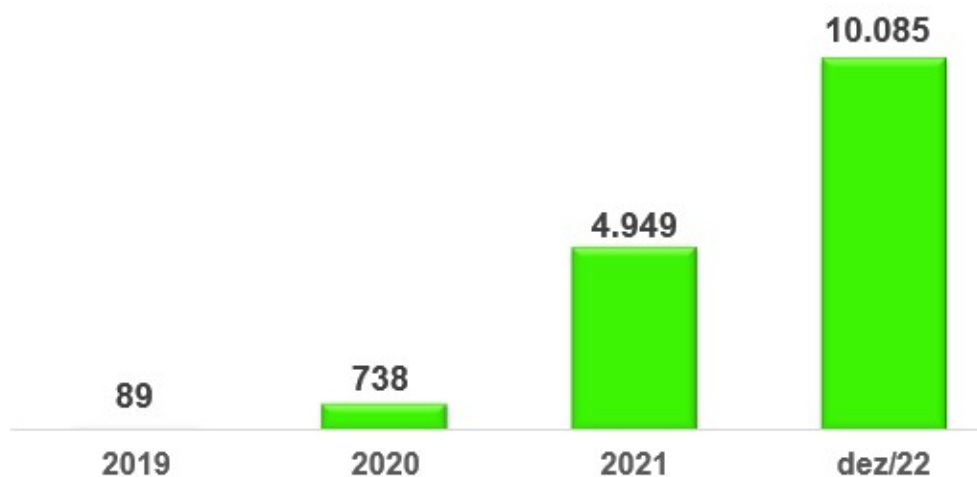
No Brasil, além do sentimento de maior aversão ao risco vindo dos mercados desenvolvidos, os ativos apresentaram alta volatilidade devido às incertezas fiscais com a aprovação da PEC da transição. Diante desse cenário, o índice IBOVESPA apresentou queda, o Real desvalorizou frente ao Dólar e as taxas 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 Futuro registrou, no mês de dezembro, desempenho positivo de 1,11%, que representa 99% CDI e superior ao índice de referência, que foi de 0,89%. No ano de 2022, a valorização das cotas foi de 12,17%, equivalente a 98% CDI e superior ao índice de referência em 143%. Os segmentos de renda fixa e estruturados (fundos multimercado) foram os que mais contribuíram para a performance positiva no ano.



Evolução Patrimonial - 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..