

PLANO VIVA PECÚLIO

Informativo Mensal de Rentabilidade Fevereiro - 2023



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	1990.0011-65
Gestão	Viva Previdência
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Patrimônio	R\$ 2.165.003.502
Data do início da cota	31/12/1997
Data	28/02/2023

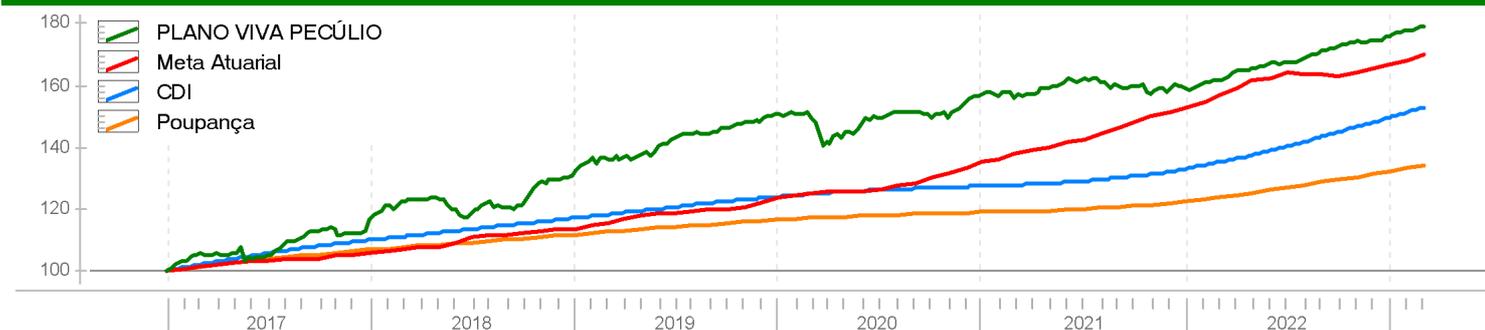
Política de Investimento

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 28/02/2023)

	fev 2023	jan 2023	dez 2022	nov 2022	out 2022	set 2022	2023	2022	2021	2020	2019	24m	12m
● PLANO VIVA PECÚLIO	0,70	0,97	0,76	0,34	0,88	1,02	1,69	10,44	1,57	4,61	14,50	14,90	10,62
● Meta Atuarial	1,15	0,84	0,94	0,63	0,72	-0,07	2,00	9,14	12,81	9,73	8,72	23,73	8,94
● CDI	0,92	1,12	1,12	1,02	1,02	1,07	2,05	12,39	4,42	2,76	5,96	19,43	13,01
● Poupança	0,61	0,71	0,71	0,65	0,65	0,68	1,33	7,90	2,99	2,11	4,26	12,33	8,18

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Meses Acima do CDI	1
Meses Abaixo do CDI	11
Maior Retorno Mensal (%)	1,69
Menor Retorno Mensal (%)	0,27
Retorno Acumulado (%)	10,62
Retorno Acumulado (% CDI)	81,62

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	1,27
Sharpe 12 meses	-1,66
VAR 21 dias	0,30
Máximo Draw down	0,00
Alfa de Jensen	-2,39

Comentários

Nos mercados globais, o mês de fevereiro foi marcado pela piora do ambiente macroeconômico e reversão do otimismo do início do ano de 2023. A divulgação de indicadores de inflação acima do esperado e o mercado de trabalho aquecido, sinalizou continuidade do aperto monetário e manutenção dos juros altos por mais tempo nos Estados Unidos e na Europa. Na China, após o anúncio do fim da política de Covid Zero, os primeiros números de atividade já mostram que a economia está retomando o crescimento.

No ambiente doméstico, além dos fatores externos, os principais vetores que influenciaram a trajetória dos mercados no mês foram a incerteza quanto a nova política fiscal, as discussões a respeito de uma possível revisão da meta de inflação e as revisões para cima das projeções de inflação no boletim Focus do Banco Central, que refletiram em retornos negativos, principalmente, para os ativos de maior risco.

Diante desse cenário desafiador, o Ibovespa seguiu os mercados externos e encerrou o mês de fevereiro com desvalorização de 7,49%, revertendo a alta do mês anterior. No mercado de renda fixa, refletindo a perspectiva de aumento de inflação, os títulos públicos atrelados à inflação de curto prazo (NTN-B) voltaram a apresentar performance positiva, superior ao CDI, enquanto os títulos de longo prazo registraram retorno positivo, porém abaixo do CDI, em decorrência das incertezas com a proposta a ser apresentada da nova política fiscal. Os ativos atrelados ao CDI renderam 0,92% no mês. O Real desvalorizou frente ao Dólar na esteira de menor aversão a risco global no mês.

As cotas do Plano Viva Pecúlio apresentaram, no mês de fevereiro, retorno positivo de 0,70%, abaixo da meta atuarial do mês, que foi 1,15%. No ano, o resultado acumulado é positivo em 1,69%, que representou 85% da meta no período.

No mês, os destaques positivos da carteira foram os títulos públicos atrelados à inflação de curto prazo (NTN-B) e os ativos de renda fixa vinculados à taxa de juros pós-fixada (títulos públicos remunerados pela Selic – LFT).

Distribuição por segmento



Rentabilidade Acumulada- Valores em (%)

Período: Jan/98 - Fev/23



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.

A meta atuarial do Plano em 2023 é de IPCA + 3,72% a.a.