

# PLANO IBAPREV

## Informativo Mensal de Rentabilidade

### Fevereiro - 2023



#### Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2004.0023-11
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 22.083.407
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	29/07/2022
Data	28/02/2023

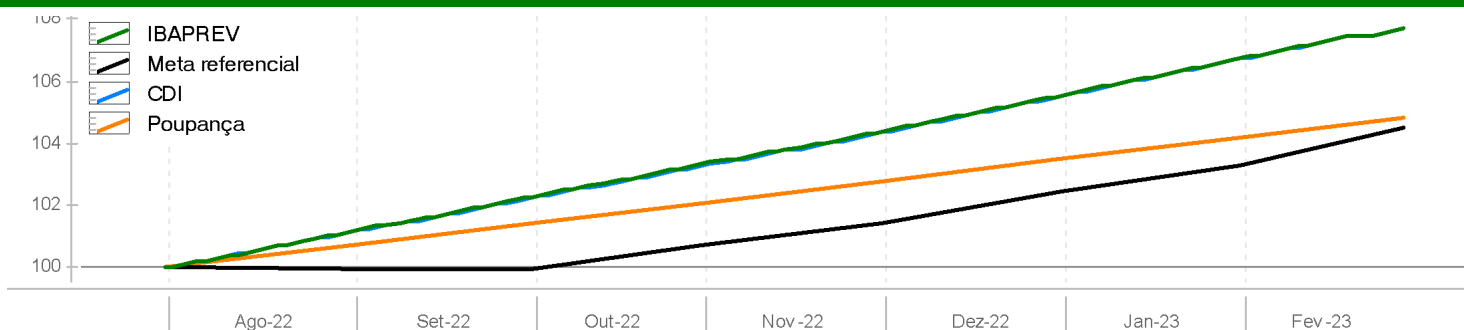
#### Política de Investimento

Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é a fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo. A composição da carteira utiliza-se de alocação diversificada em renda fixa, renda variável, multimercados, imobiliário e exterior.

#### Rentabilidades (%) (até 28/02/2023)

	fev 2023	jan 2023	dez 2022	nov 2022	out 2022	set 2022	2023	do início	6m
● IBAPREV	0,91	1,11	1,11	1,01	1,03	1,09	2,04	7,70	6,44
● Meta referencial	1,14	0,83	1,00	0,69	0,78	-0,02	1,98	4,49	4,50
● CDI	0,92	1,12	1,12	1,02	1,02	1,07	2,05	7,69	6,44
● Poupança	0,61	0,71	0,71	0,65	0,65	0,68	1,33	4,85	4,08

#### Retorno Acumulado



#### Perfil de Retornos (Desde o início)

Meses Positivos	7
Meses Negativos	0
Meses Acima do CDI	3
Meses Abaixo do CDI	4
Maior Retorno Mensal (%)	1,18
Menor Retorno Mensal (%)	0,91
Retorno Acumulado (%)	7,70
Retorno Acumulado (% CDI)	100,10

#### Perfil de Risco

Volatilidade Anual	0,03
Sharpe (desde o início)	0,35
VAR 21 dias	0,01
Máximo Drawdown	0,00
Alfa de Jensen	-

#### Comentários

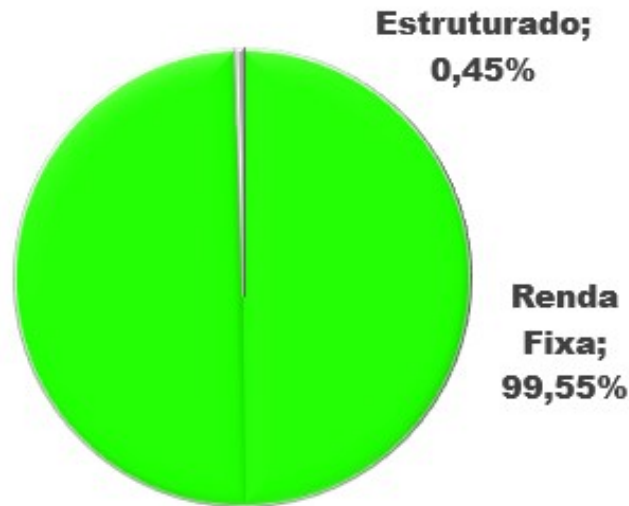
Nos mercados globais, o mês de fevereiro foi marcado pela piora do ambiente macroeconômico e reversão do otimismo do início do ano de 2023. A divulgação de indicadores de inflação acima do esperado e o mercado de trabalho aquecido, sinalizou continuidade do aperto monetário e manutenção dos juros altos 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 Iboprev registraram desempenho positivo de 0,91% no mês de fevereiro, inferior ao índice de referência, que foi de 1,14%, equivalente à 99% CDI. No ano, o resultado acumulado é positivo em 2,04%, acima da meta referencial de 1,97%, equivalente à 99% CDI.

No mês, os destaques positivos da carteira foram os fundos de investimentos que alocaram em 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).



Evolução Patrimonial - Valores em mil (R\$)



Disclaimer

As informações contidas nesta Lâmina são de caráter exclusivamente informativo.

Os investimentos do Plano tem horizonte de retorno de médio e longo prazo, podendo apresentar flutuações nos valores das cotas no curto prazo.

A rentabilidade obtida 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 e investimentos (ABRAPP/ICSS/SINDAPP).

Maiores informações sobre o Plano, estarão contidas no RAI - Relatório Anual de Informações.

A meta referencial do Plano é de INPC + 3,72% a.a

Em 2023 a meta referencial do Plano é de IPCA + 3,60%. a.a.