

PLANO VIVA PECÚLIO ATIVOS

Informativo Mensal de Rentabilidade

Dezembro - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	1990.0011-65
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 2.088.077.665
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	29/12/2017
Data	30/12/2022

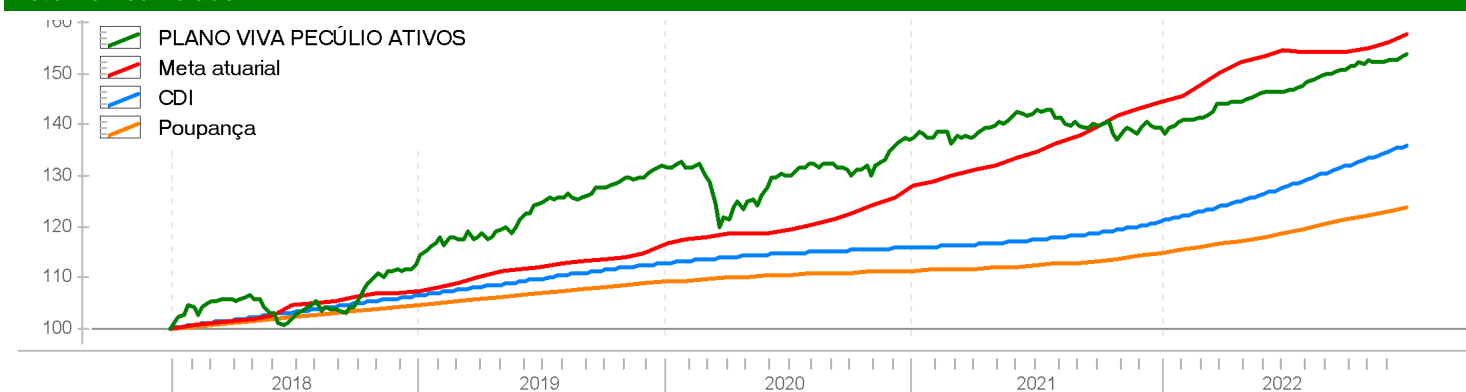
Política de Investimento

O modelo de gestão adota a metodologia de construção de carteira com base em uma macro alocação de recursos e reavaliação de cenário periodicamente. A composição das aplicações utiliza-se de estratégias de investimentos diversificada e de retorno com horizonte de médio e longo prazo.

Rentabilidades (%) (até 31/12/2022)

	dez 2022	nov 2022	out 2022	set 2022	ago 2022	jul 2022	2022	2021	2020	2019	24m	12m
● PLANO VIVA PECÚLIO ATIVOS	0,75	0,31	0,88	1,02	1,17	0,84	10,39	1,30	4,85	16,53	11,82	10,39
● Meta atuarial	0,94	0,63	0,72	-0,07	-0,06	-0,35	9,14	12,81	9,73	8,72	23,12	9,14
● CDI	1,12	1,02	1,02	1,07	1,17	1,03	12,39	4,42	2,76	5,96	17,36	12,39
● Poupança	0,71	0,65	0,65	0,68	0,74	0,66	7,90	2,99	2,11	4,26	11,12	7,90

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 (%)	1,75
Menor Retorno Mensal (%)	0,22
Retorno Acumulado (%)	10,39
Retorno Acumulado (% CDI)	83,82

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	1,76
Sharpe 12 meses	-1,15
VAR 21 dias	0,44
Máximo Drawdown	0,00
Alfa de Jensen	-2,27

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 Pecúlio, modalidade BD (Benefício Definido), fechou o mês de dezembro com ganho de 0,75%. No ano de 2022, o Plano registra valorização de 10,39%, superior à meta atuarial (9,17%), o que representa 113% no período. Os segmentos de renda fixa e estruturados (fundos multimercado) foram os que mais contribuíram para a performance positiva no ano.



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 de 2021 é de INPC + 2,42% a.a.

A meta atuarial de 2022 é de INPC + 3,06% a.a.