

Plano VIVA EMPRESARIAL

Informativo Mensal de Rentabilidade

Setembro - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2005.0006-47
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 96.352.081
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	24/05/2005
Data	30/09/2022

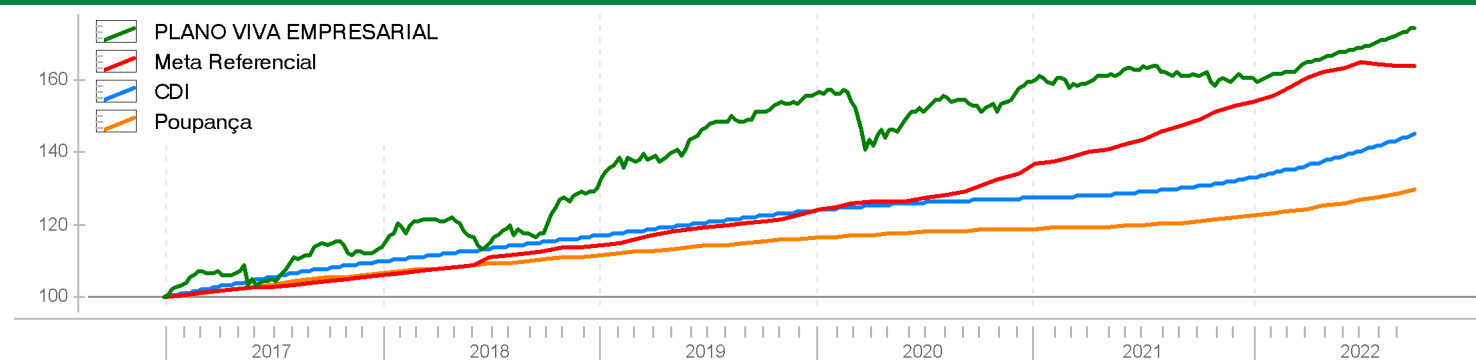
Política de Investimento

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

Rentabilidades (%) (até 30/09/2022)

	set 2022	ago 2022	jul 2022	jun 2022	mai 2022	abr 2022	2022	2021	2020	2019	2018	24m	12m
● PLANO VIVA EMPRESARIAL	1,16	1,22	0,85	0,75	1,00	0,87	8,50	0,37	2,68	19,34	14,46	14,99	8,38
● Meta Referencial	-0,12	-0,11	-0,40	0,82	0,65	1,24	6,20	12,81	9,86	8,86	7,57	25,08	9,78
● CDI	1,07	1,17	1,03	1,02	1,03	0,83	8,91	4,42	2,76	5,96	6,42	14,26	10,93
● Poupança	0,68	0,74	0,66	0,65	0,67	0,56	5,76	2,99	2,11	4,26	4,62	9,30	7,13

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	11
Meses Negativos	1
Meses Acima do CDI	6
Meses Abaixo do CDI	6
Maior Retorno Mensal (%)	1,47
Menor Retorno Mensal (%)	-1,59
Retorno Acumulado (%)	8,38
Retorno Acumulado (% CDI)	76,74

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	2,30
Sharpe 12 meses	-0,99
VAR 21 dias	0,17
Máximo Drawdown	0,00
Alfa de Jansen	-2,51

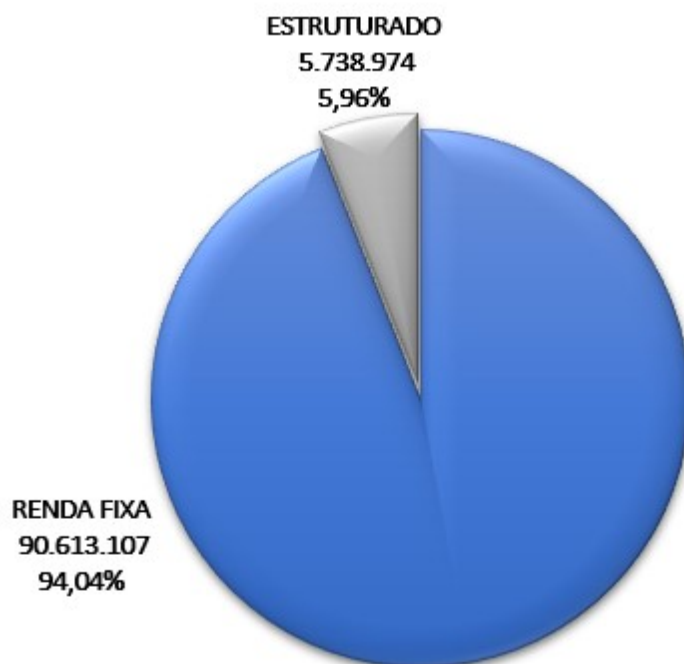
Comentários

O mês de setembro foi marcado pela forte aversão a risco nos mercados internacionais devido aos seguintes fatores: (I) continuidade do movimento de desaceleração da economia global, (II) novos dados negativos de inflação vindos dos EUA e Europa, e (III) anúncio de novo plano econômico no Reino Unido. Os efeitos sobre os mercados financeiros foram a queda acentuada nas principais bolsas de valores mundiais, maior volatilidade no preço dos ativos e aumento das taxas de juros globais.

O mercado doméstico, na contramão dos mercados externos, pelo segundo mês consecutivo performou positivamente. Os vetores determinantes foram: (I) a queda nas projeções de inflação, (II) as revisões altistas do crescimento econômico, (III) a melhora da taxa de desemprego e (IV) o encerramento do ciclo de alta da taxa de juros pelo BACEN.

No mês, os destaques positivos das aplicações em renda fixa foram os ativos vinculados à taxa de juros nominal (LTN) e real de médio e longo prazo (NTN-B). Os ativos atrelados ao CDI/Selic apresentaram ganhos de 1,07%. Em linha com o ambiente interno favorável, o Ibovespa (principal índice da bolsa brasileira) fechou em alta de 0,47%, enquanto o IHFA (índice de fundos multimercados) subiu 1,49%, no mês. Por fim, o Dólar americano fechou setembro com valorização de 4,39% frente ao Real, no mês em que a moeda americana voltou a se fortalecer globalmente com o aumento de taxas de juros americanas.

O Plano Viva Empresarial obteve resultado positivo no mês de setembro, de 1,16%, equivalente a 108% CDI e superior à meta referencial, que foi de -0,12%. No acumulado de 2022, até o mês de setembro, o Plano obteve valorização das cotas em 8,50%, equivalente a 95% CDI, superando o índice referencial em 136%. Os segmentos de renda fixa e multimercado foram os que mais contribuíram para a performance positiva no mês.



Rentabilidade Acumulada - Valores em (%)

Rentabilidade acumulada no período (Jun/05 a Set/22)- VIVA Empresarial



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.