

# PLANO IBAPREV

## Informativo Mensal de Rentabilidade

### Dezembro - 2022



#### Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2004.0023-11
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 22.223.303
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	29/07/2022
Data	30/12/2022

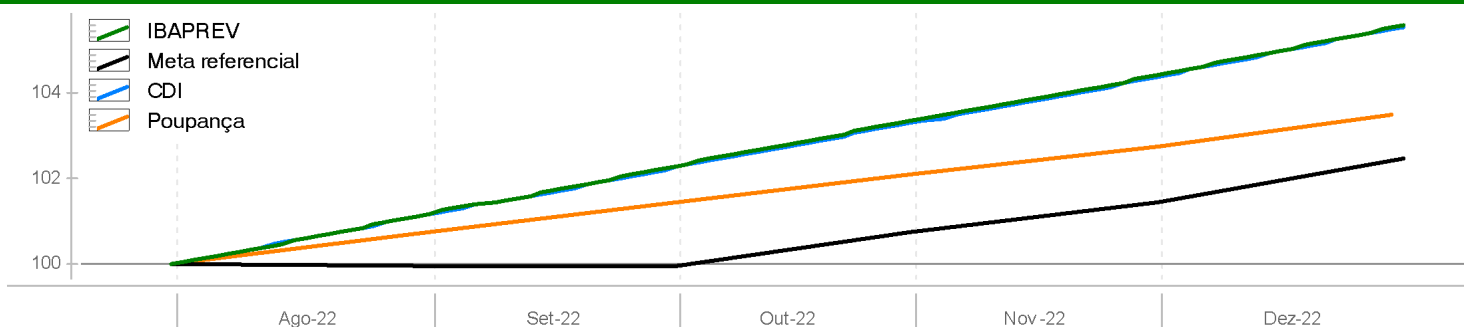
#### Política de Investimento

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 31/12/2022)

	dez 2022	nov 2022	out 2022	set 2022	ago 2022	do início
● IBAPREV	1,11	1,01	1,03	1,09	1,18	5,55
● Meta referencial	1,00	0,69	0,78	-0,02	-0,01	2,46
● CDI	1,12	1,02	1,02	1,07	1,17	5,52
● Poupança	0,71	0,65	0,65	0,68	0,74	3,48

#### Retorno Acumulado



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

Meses Positivos	5
Meses Negativos	0
Meses Acima do CDI	3
Meses Abaixo do CDI	2
Maior Retorno Mensal (%)	1,18
Menor Retorno Mensal (%)	1,01
Retorno Acumulado (%)	5,55
Retorno Acumulado (% CDI)	100,40

#### Perfil de Risco

Volatilidade Anual	0,04
Sharpe (desde o início)	1,28
VAR 21 dias	0,01
Máximo Drawdown	0,00
Alfa de Jensen	-

#### Comentários

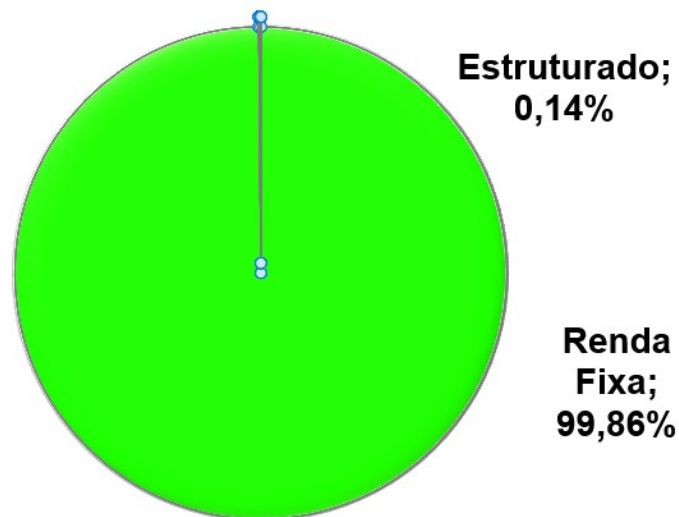
O mês de dezembro foi negativo para os ativos de riscos globais com os principais índices acionários fechando em queda. Esse movimento desfavorável foi impactado pelos comunicados mais hawkish do que o esperado do FED e do BCE, indicando que a taxa de juros pode permanecer em patamares elevados por mais 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.

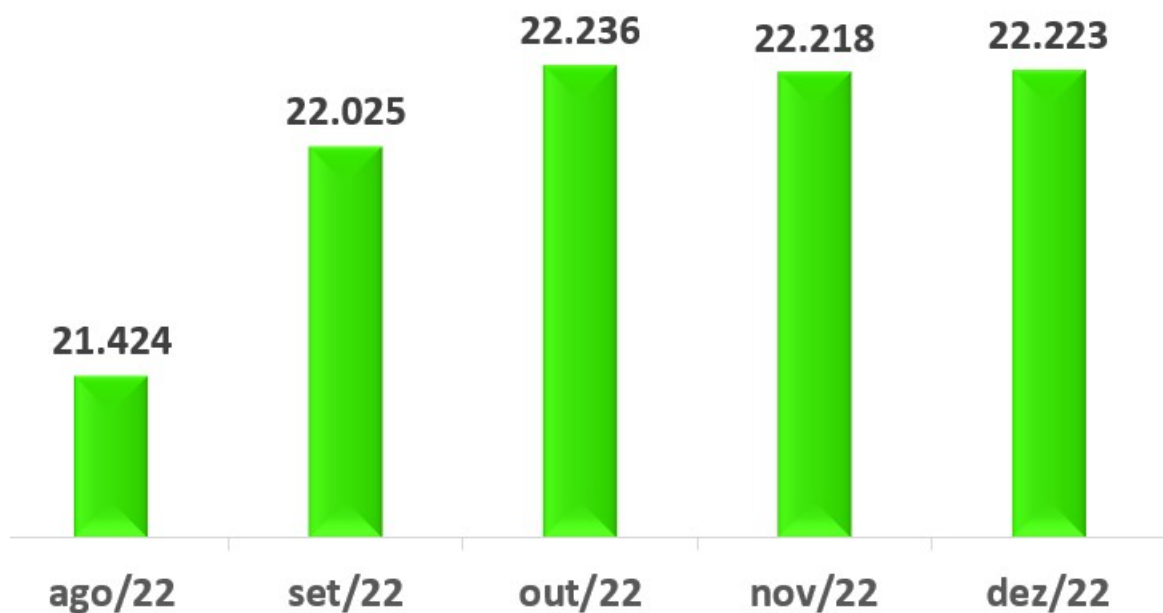
No mês, os destaques positivos ficaram com os ativos de renda fixa vinculados à taxa de juros pós-fixada (títulos públicos remunerados pela Selic - LFT), além dos ativos de crédito privado.

As cotas do Plano Ibaprev registraram desempenho positivo de 1,11% no mês de dezembro, equivalente a 99% CDI e superior ao índice de referência, que foi de 1,00%. Desde o início da gestão do plano pela Viva de Previdência, em agosto de 2022, o Plano registrou ganho de 5,55%, equivalente a 101% CDI e acima do índice de referência, de 2,46%, que representou 226%. O segmento de renda fixa foi o responsável pela performance positiva no período.

## Distribuição por Segmentos



## Evolução Patrimonial - 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..