

Relatório de Investimentos

REALIZEPREV

RealizePrev setembro/2023



O RealizePrev vem continuamente reposicionando suas carteiras, aproveitando o momento de volatilidade para realizar rebalanceamentos dos investimentos, buscando as melhores oportunidades, otimizando a relação risco/retorno do plano.

Rentabilidade do mês de setembro

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
0,6585%	0,9745%	67,58%

Rentabilidade dos últimos 12 meses

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
10,632%	13,444%	79,08%

No mês de setembro/23, as preocupações sobre uma possível futura recessão americana, bem como, diminuições no crescimento da China causadas pelas preocupações em relação ao endividamento e aos dados do mercado imobiliário, principais propulsores da economia chinesa, se intensificaram. Na principal economia mundial, o ciclo de aperto monetário parece ainda não estar tão bem precificado, mesmo após o FED (Banco central americano) manter a taxa de juros em patamares de 5,25% a 5,50% aa. Mesmo com a política monetária mais contracionista, e o FED indicando manter uma postura mais hawkish, observa-se abertura das curvas de juros em prazos mais longos, causando forte sensibilidade dos mercados, que se movem em direção aos ativos livres de risco e desincentivam os investidores a realizarem aplicações em ativos de maior risco em todo o mundo.

O cenário de volatilidade permanece em 2023. Assim o maior otimismo ou pessimismo do mercado financeiro impacta momentaneamente as cotas do plano, seja positiva ou negativamente. Momentos de euforia bem como de incerteza são esperados em investimentos de longo prazo como previdência, e devem ser tratados com naturalidade e atenção para que as melhores decisões sejam tomadas minimizando a influência dos aspectos psicológicos e de vieses comportamentais.

Inflação

Neste mês de setembro, a inflação medida pelo IPCA registrou variação de 0,26%, enquanto que o IGP-M apresentou variação de 0,37%, apresentando um descasamento em prol do IPCA de -0,11p.p.



No Brasil, o principal acontecimento foi o Copom, baixando os juros, com a SELIC indo de 13,25% para 12,75% aa, porém, o otimismo com o corte acabou por ser ofuscado por eventos externos e os títulos públicos brasileiros tiveram desvalorizações no período

Bolsa

Os principais índices de bolsa no Brasil, apresentaram o seguinte movimento no mês: IBOV 0,71%, IBRX 0,84%, IDIV 1,32% e SMLL -2,84%; No exterior, observa-se o seguinte movimento: nos índices de bolsa Americanos: S&P 500 -4,87% e Nasdaq -5,81%, Europeus: CAC 40 -2,48%, EURO STOXX 50 -2,85%; FTSE MIB -2,04% e MOEX -2,93%, na Ásia: Nikkei 225 -2,34%, Kospi -3,57% e Hang Seng -3,11%; o índice dos mercados emergentes em geral apresentou uma variação de -2,81%.

Na renda variável a preocupação com uma possível futura recessão americana trouxe um aumento de volatilidade para o período, com o Ibovespa fechando em leve alta de 0,71%.

Selic

O COPOM no mês, baixou a SELIC de 13,25% para 12,75% ao ano.

Brasil

No Brasil, o principal acontecimento foi o Copom, Comitê de Política Monetária do Banco Central do Brasil, baixando os juros, com a SELIC indo de 13,25% para 12,75% aa, porém, o otimismo com o corte acabou por ser ofuscado por eventos externos e os títulos públicos brasileiros tiveram desvalorizações no período, por exemplo, a cesta do IMAB-5+ desvalorizou 1,92%.

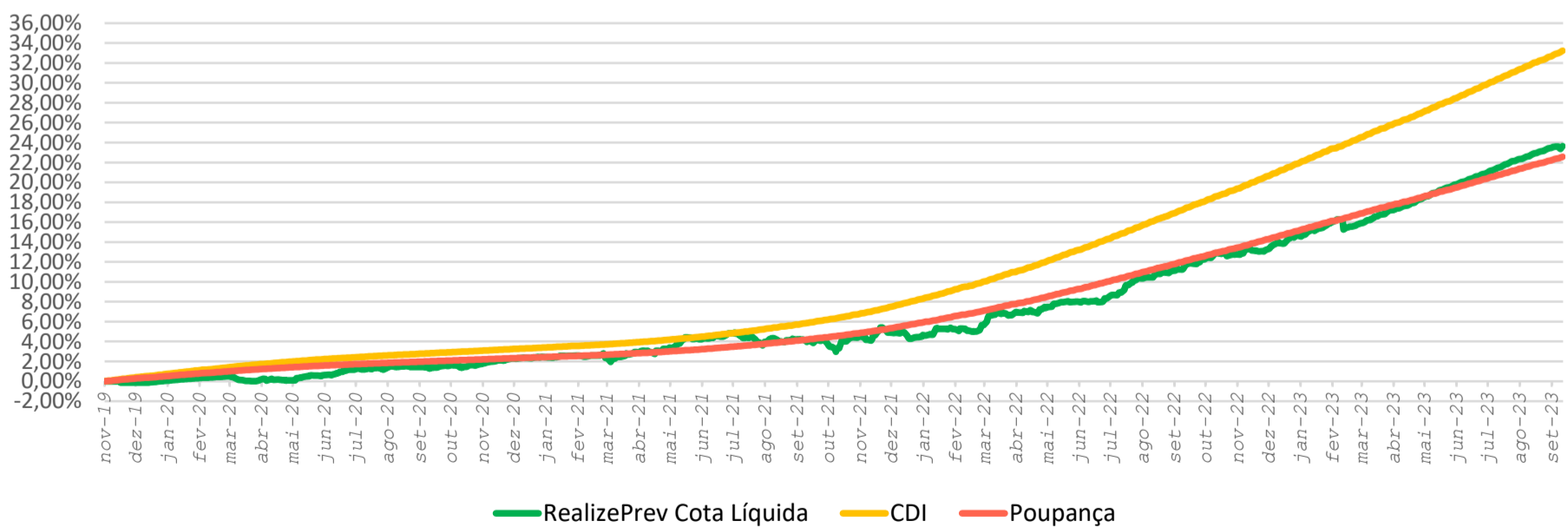


Exterior

O FED manteve os juros americanos em níveis de 5,25% a 5,50%. Continuam a haver entre os investidores preocupações sobre uma possível futura recessão americana. O Real apresentou uma desvalorização de 1,74% frente ao Dólar.

RealizePrev em números

Rentabilidade Acumulada (%)



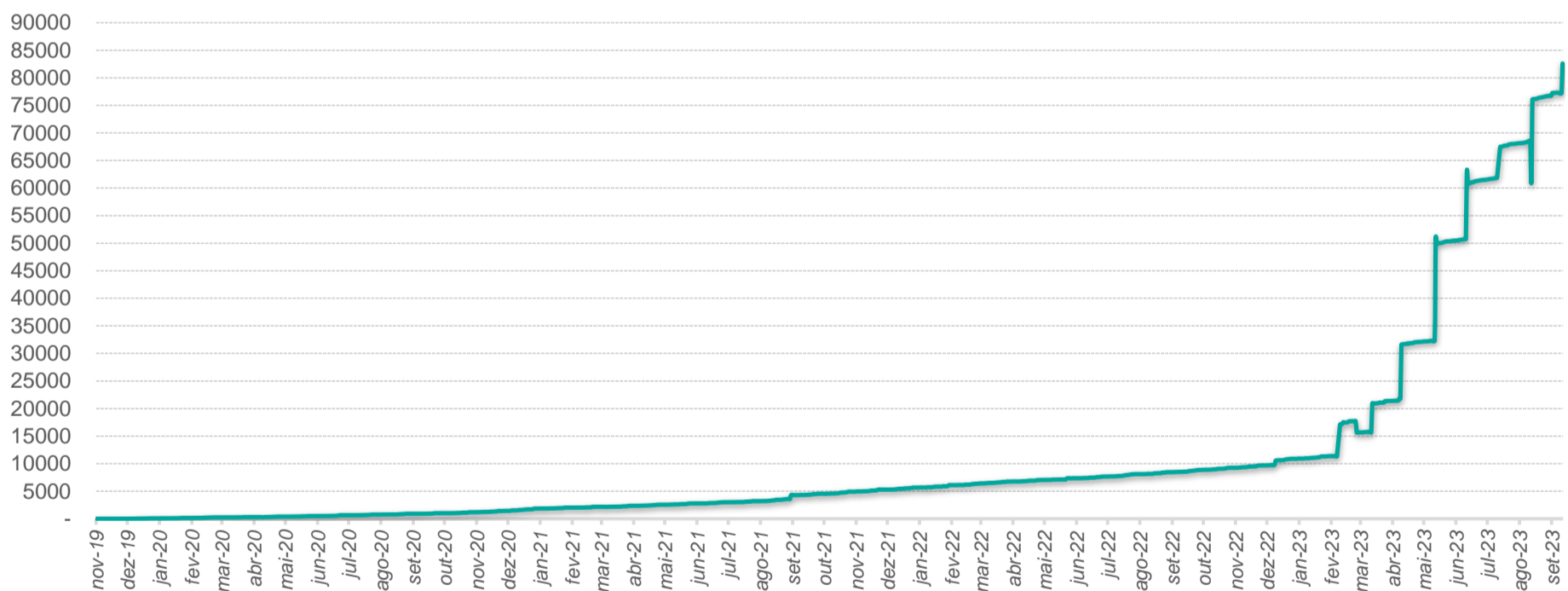
Rentabilidade x CDI | Últimos 12 meses

	Cota	CDI	Poupança	Cota (% do CDI)
set 2023	0,6585%	0,9745%	0,6838%	67,58%
ago 2023	1,0737%	1,1394%	0,7994%	94,24%
jul 2023	1,0100%	1,0720%	0,7544%	94,22%
jun 2023	1,0617%	1,0720%	0,7544%	99,04%
mai 2023	1,2136%	1,1233%	0,7905%	108,04%
abr 2023	0,9267%	0,9183%	0,6463%	100,91%
mar 2023	0,2205%	1,1749%	0,8266%	18,77%
fev 2023	0,9263%	0,9183%	0,6463%	100,86%
jan 2023	1,1705%	1,1234%	0,7905%	104,19%
dez 2022	0,4592%	1,1233%	0,7905%	40,88%
nov 2022	0,4438%	1,0206%	0,7184%	43,48%
out 2022	0,9877%	1,0207%	0,7184%	96,76%

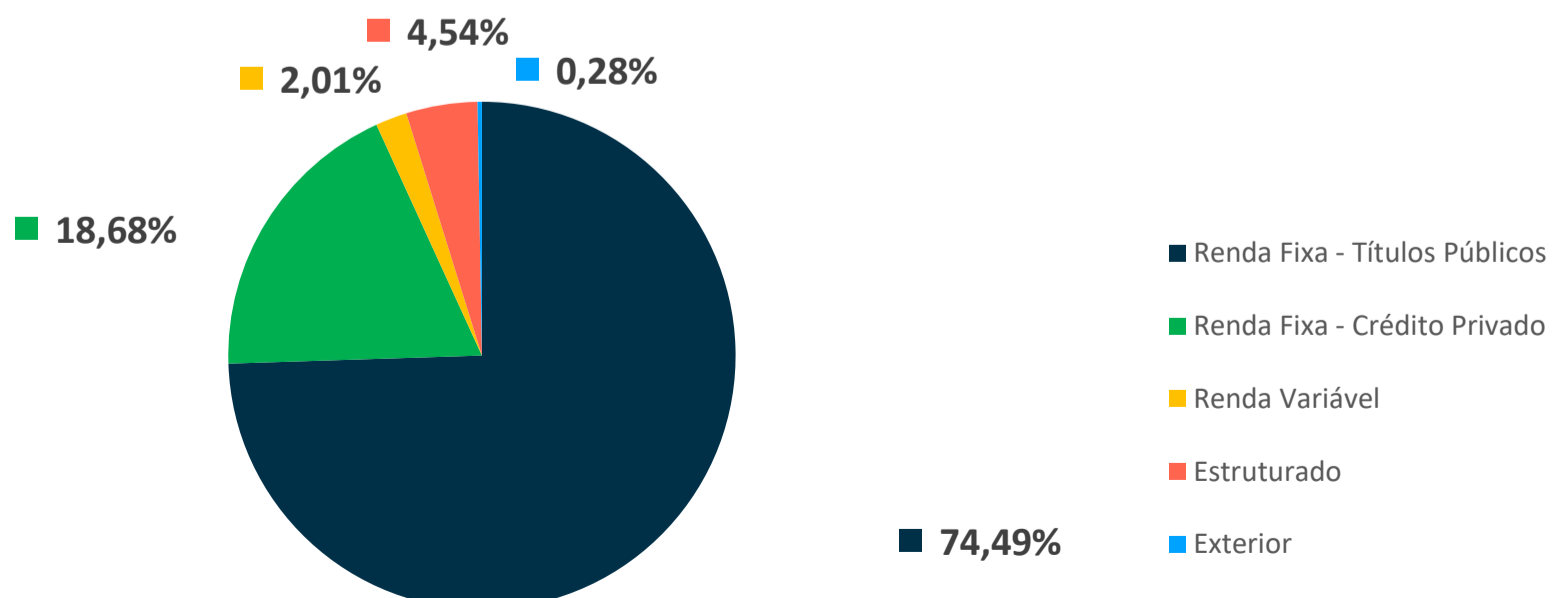
Acumulado	Cota	CDI	Poupança	Cota (% do CDI)
2022	8,5470%	12,3729%	8,5885%	69,08%
2021	2,4963%	4,3950%	3,1453%	56,80%
2020	2,4991%	2,7677%	1,9918%	90,30%
Início *	23,6385%	31,9433%	22,5688%	74,00%

* Início em novembro/2019.

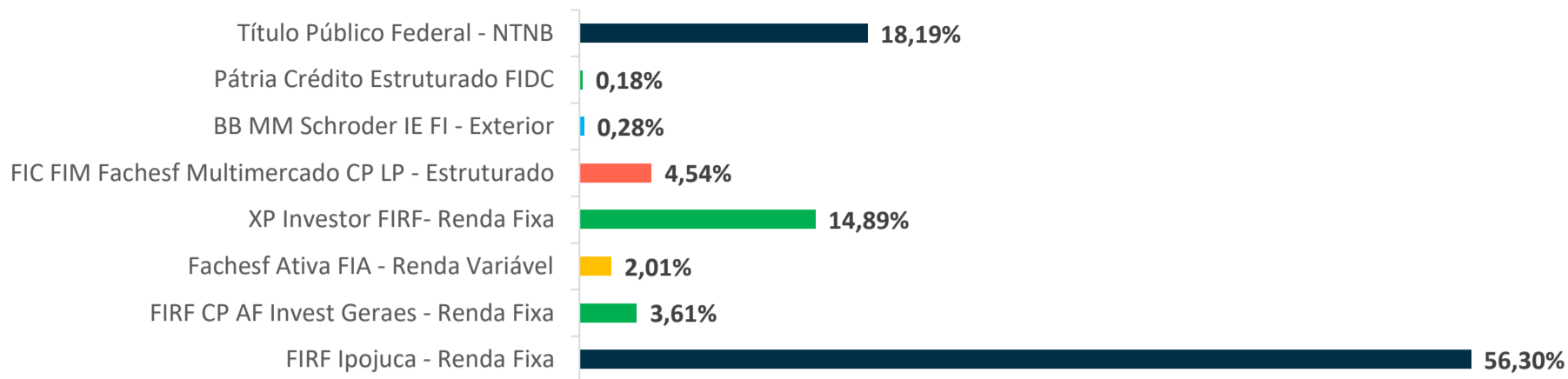
Evolução do Patrimônio (R\$ mil)



Alocação por segmento

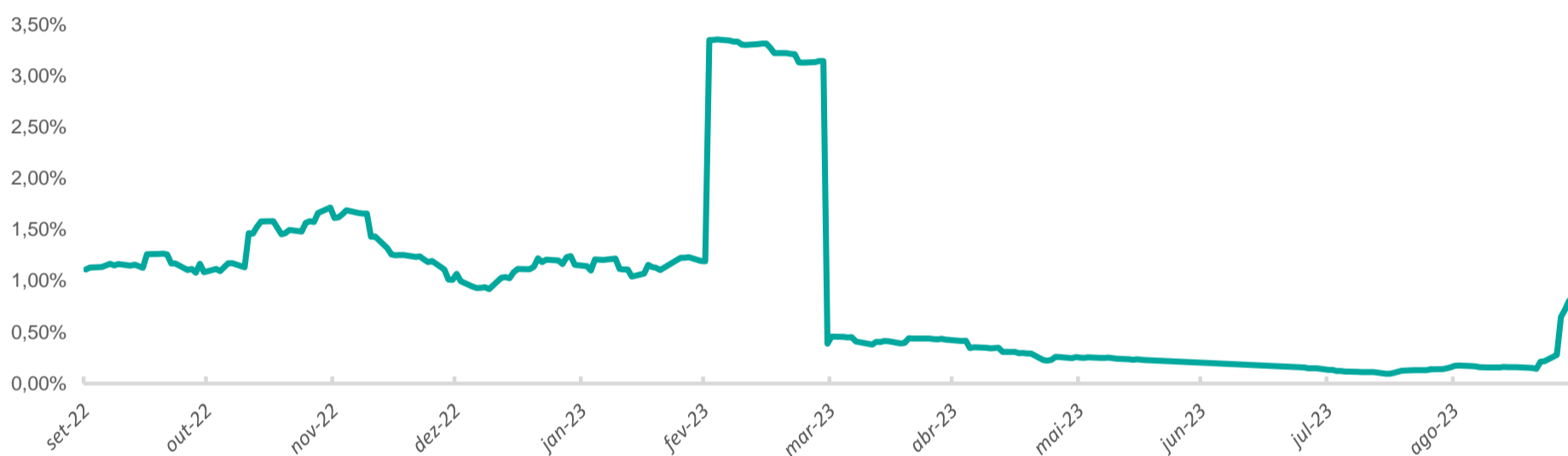


Ativos investidos



Alocação em fundo de investimentos não conta com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade passada não representa garantia de rentabilidade futura. Para a avaliação de performance (desempenho) de fundos de investimentos e/ou carteiras administradas, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses de séries históricas. Os cálculos a serem apresentados serão baseados em observações de retornos diários. Esse relatório tem caráter meramente informativo, não podendo ser distribuído, reproduzido ou copiado sem a expressa concordância da Fachesf.

Volatilidade 21 dias úteis (D.U.) anualizada (%)



A volatilidade representa uma medida de risco de mercado (ou risco de variação de preço). Ela mensura a mudança na precificação de todos os ativos da carteira do plano em relação ao seu objetivo de rentabilidade (CDI), num intervalo de 21 dias úteis e é representada de forma anual (anualizada). Em outras palavras, ela mede o nível de oscilação dos preços dos investimentos do RealizePrev em relação ao CDI.

Perfil do RealizePrev

Características

Data de início	19/11/2019
Contribuição mensal mínima	R\$ 62,64
Administração e Controladoria	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM
Custódia	BNY Mellon Banco S.A
Gestão	Fachesf
Patrimônio em 29/09/2023	R\$ 82.595.414,00
Conta para aplicação	Banco do Brasil AG. 3433-9 C/C. 6739-3 com identificador
Taxa de Administração do Plano	0,85% a.a

Até o próximo mês!

Fachesf | Rua do Paissandu, 58 - Boa Vista - Recife - PE
CEP 50070-205 - CNPJ: 42.160.192/0001-43