

Relatório de Investimentos

REALIZEPREV

RealizePrev maio/2022



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

Rentabilidade do mês de maio

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
0,8208%	1,0310%	79,61%

Rentabilidade dos últimos 12 meses

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
4,625%	7,893%	58,60%

A rentabilidade de 0,8208% foi possível graças a diversificação e otimização dos investimentos do realizeprev, reduzindo o risco do portfólio. O mês de maio foi marcado pela valorização da bolsa após uma forte desvalorização em abril, refletindo no resultado da renda variável. O mercado de títulos públicos de renda fixa também apresentou resultado positivo, impactando positivamente na carteira de renda fixa. A rentabilidade no mês foi positiva, 0,82%, porém inferior ao índice de referência, o CDI.

Em 2022 certamente haverá cenários de maior volatilidade, com maior otimismo ou pessimismo do mercado financeiro impactando 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.

Juros e Inflação

No mês de maio, destacamos a abertura da "curva de juros" (linha composta pela união dos pontos que representam taxas de juros dos títulos públicos em diferentes vencimentos ao longo do tempo) nos vencimentos de 2023 a 2037; A carteira própria de títulos públicos do RealizePrev, composta por NTN-B com vencimentos em 2045 e 2050, apresentou um retorno positivo de 1,29%. A inflação do IGP-M registrou uma variação positiva de 0,52%, e o IPCA registrou uma variação positiva de 0,47%.

Bolsa

Os principais índices de bolsa no Brasil, apresentaram o seguinte movimento no mês: IBOV 3,22%, IBRX 3,23%, IDIV 4,26% e SMLL -1,82%; No exterior, observa-se o seguinte movimento: nos índices de bolsa Americanos: S&P 500 0,01% e Nasdaq -2,05%, Europeus: CAC 40 -0,99%, EURO STOXX 50 -0,36%; FTSE MIB 1,04% e MOEX -3,66%, na Ásia: Nikkei 225: 1,61%, Kospi -0,34% e Hang Seng 1,54%; o índice dos mercados emergentes em geral apresentou uma variação de 0,14%. O Ibovespa valorizou 3,22, no mês, alcançando uma valorização de 6,23, no ano. Em maio, os setores ligados a commodities, em especial o petróleo, foram os que mais contribuíram para essa alta. A retomada da economia chinesa, com o término dos lockdowns devido à covid, e dados da atividade doméstica e revisão do PIB do Brasil também favoreceram os ativos de renda variável.

Selic

Em maio, na reunião do COPOM (Comitê de Política Monetária), do Banco Central do Brasil, decidiu-se pela alta da taxa SELIC em 1,00 p.p. Para a próxima reunião, o Comitê sinalizou como provável uma extensão do ciclo com um ajuste de menor magnitude. Na reunião de março o COPOM havia sinalizado o encerramento do ciclo de alta com a Selic em 12,75%. O Comitê está atuando com bastante cautela devido à incerteza da atual conjuntura e da necessidade de observar os impactos do atual. Os próximos passos da política monetária poderão ser ajustados para assegurar a convergência da inflação para suas metas e dependerão da evolução da atividade econômica, do balanço de riscos e da inflação.



Na Renda Variável, os setores ligados a commodities, em especial o petróleo, foram os que mais contribuíram para a alta do Ibovespa. O Real apresentou uma apreciação de 3,84% frente ao Dólar.

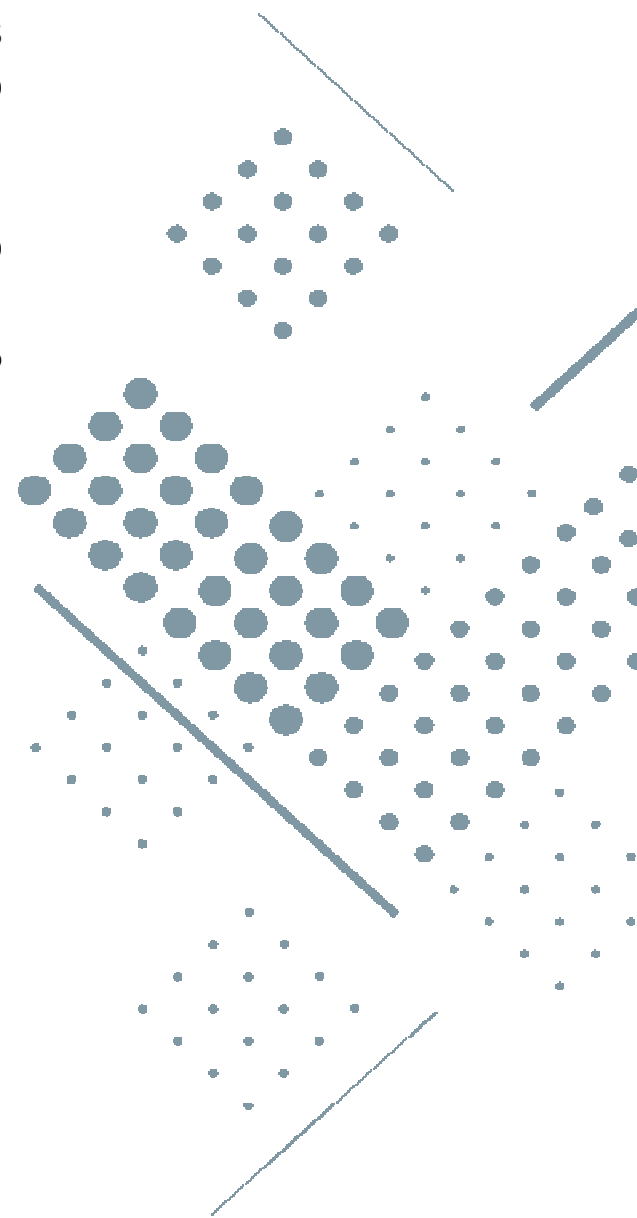
Os títulos públicos federais investidos pelo plano, com vencimentos mais longos, apresentaram retorno positivo no mês.

Brasil

No Brasil a inflação continua alta e o Congresso vem estudando medidas visando seu arrefecimento. Dados apontam para um desempenho positivo da atividade econômica e recuperação do mercado de trabalho. A reabertura da economia e algumas medidas que ajudaram a sustentar a renda disponível, como antecipação do 13º dos aposentados do INSS, redução do IPI, resgates de até R\$ 1 mil do FGTS e resjustes de funcionalismo público, explicam esse bom resultado. O Real apresentou uma apreciação de 3,84% frente ao Dólar.

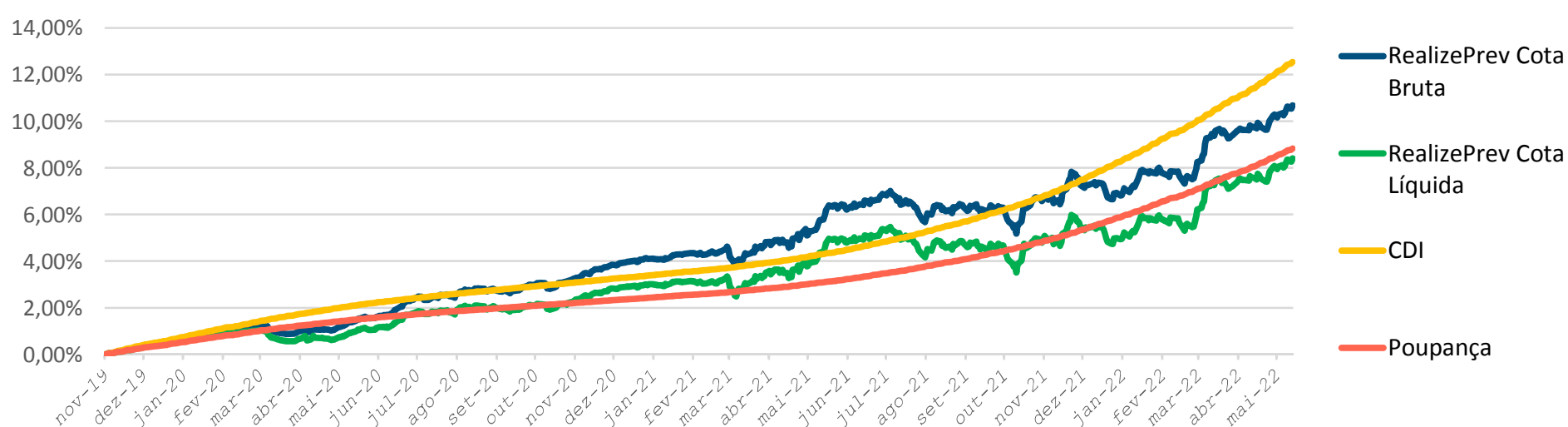
Exterior

No exterior, o mês foi marcado pelos efeitos da guerra entre a Rússia e Ucrânia sobre os preços das commodities impactando na inflação. A China, na segunda metade do mês, com o arrefecimento da disseminação da Covid, começou a reduzir o lockdown, além de adotar medidas para estimular o crescimento. Nos EUA, o FOMC elevou a taxa de juros em 50 bps, a atividade segue aquecida a inflação elevada e com a taxa de juros acima do patamar neutro elevou-se a probabilidade de que a economia enfrente uma recessão no médio prazo.



RealizePrev em números

Rentabilidade Acumulada (%)



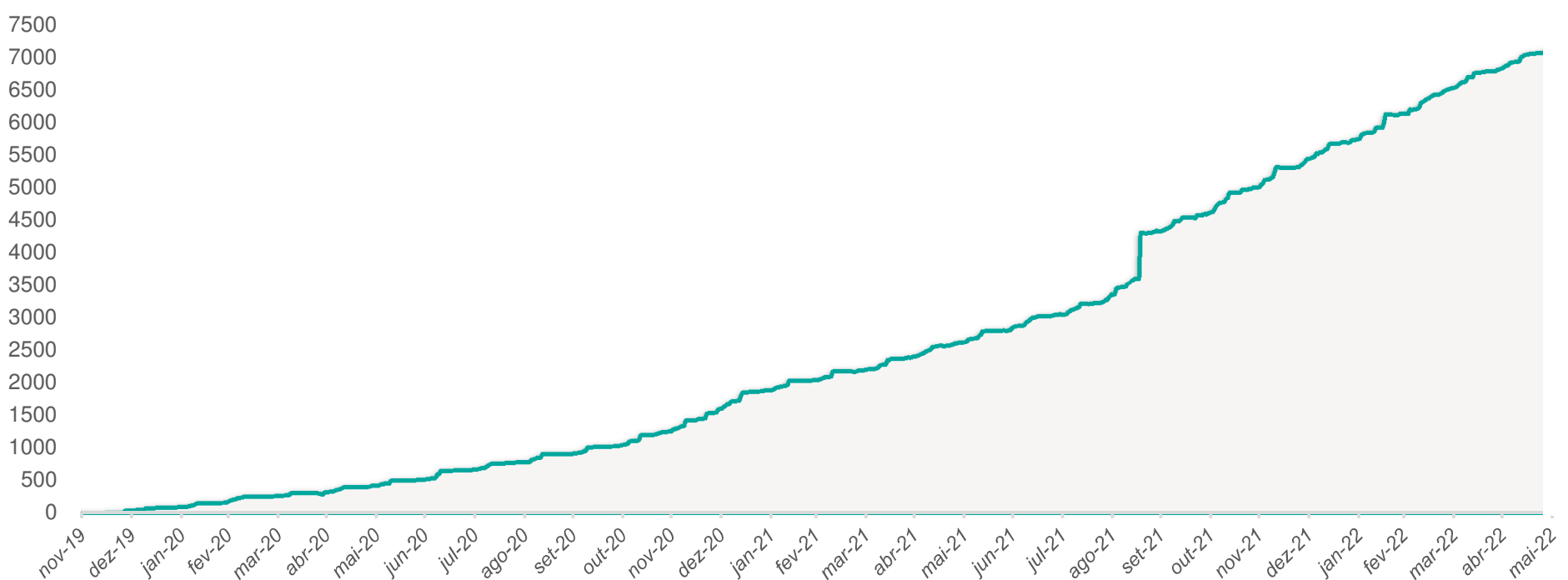
Rentabilidade x CDI | Últimos 12 meses

	Investimentos	Cota	CDI	Poupança	Investimentos (% do CDI)	Cota (% do CDI)	Investimentos (% da Poupança)
mai 2022	0,8208%	0,7418%	1,0310%	0,7286%	79,61%	71,94%	112,65%
abr 2022	0,3753%	0,3233%	0,8344%	0,5881%	44,98%	38,75%	63,82%
mar 2022	1,3991%	1,3151%	0,9235%	0,6536%	151,51%	142,40%	214,06%
fev 2022	0,2921%	0,2602%	0,7496%	0,5328%	38,97%	34,71%	54,83%
jan 2022	0,1727%	0,1066%	0,7323%	0,5174%	23,58%	14,56%	33,37%
dez 2021	0,7094%	0,6165%	0,7635%	0,5437%	92,92%	80,74%	130,49%
nov 2021	1,0075%	0,9335%	0,5867%	0,4156%	171,72%	159,11%	242,45%
out 2021	-0,5401%	-0,6148%	0,4804%	0,3452%	-112,44%	-127,98%	-156,47%
set 2021	-0,0774%	-0,1497%	0,4382%	0,3147%	-17,66%	-34,15%	-24,59%
ago 2021	-0,2094%	-0,2461%	0,4241%	0,3052%	-49,37%	-58,03%	-68,61%
jul 2021	-0,0029%	-0,0193%	0,3556%	0,2547%	-0,82%	-5,42%	-1,15%
jun 2021	0,5996%	0,5218%	0,3049%	0,2210%	196,64%	171,11%	271,35%

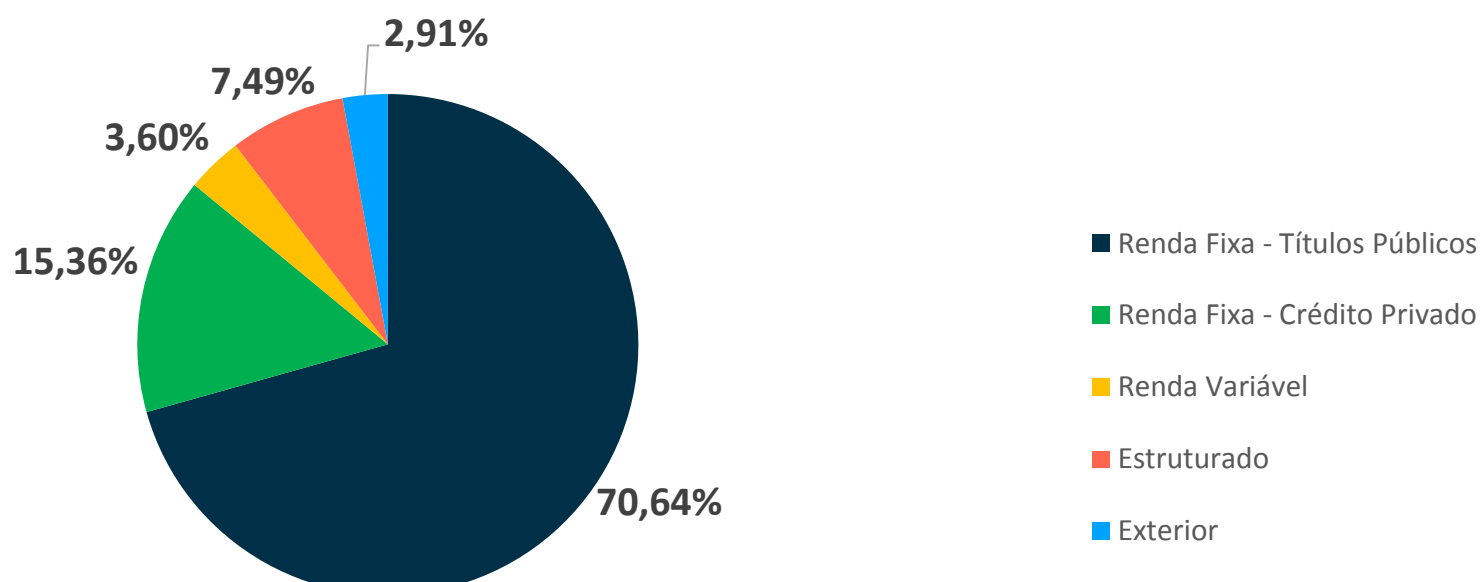
Acumulado	Investimentos	Cota	CDI	Poupança	Investimentos (% do CDI)	Cota (% do CDI)	Investimentos (% da Poupança)
2022	3,0925%	2,7724%	4,3440%	3,0571%	71,19%	63,82%	101,16%
2021	3,2504%	2,4963%	4,3950%	3,1453%	73,96%	56,80%	103,34%
2020	3,4654%	2,4991%	2,7677%	1,9918%	125,21%	90,30%	173,99%
Início *	10,6817%	8,4035%	12,5370%	8,8225%	85,20%	67,03%	121,07%

* Início em novembro/2019.

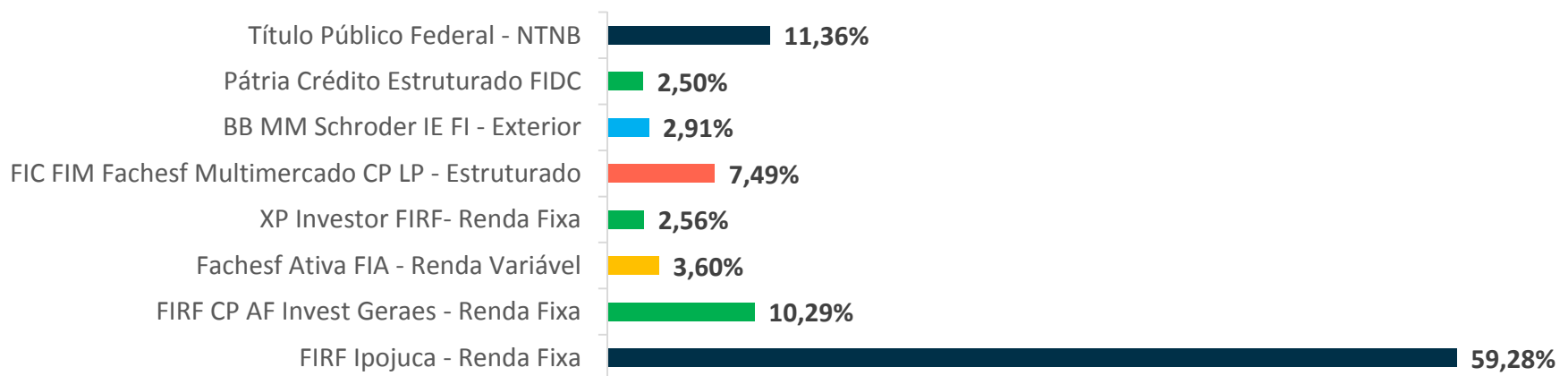
Evolução do Patrimônio (R\$ mil)



Alocação por segmento

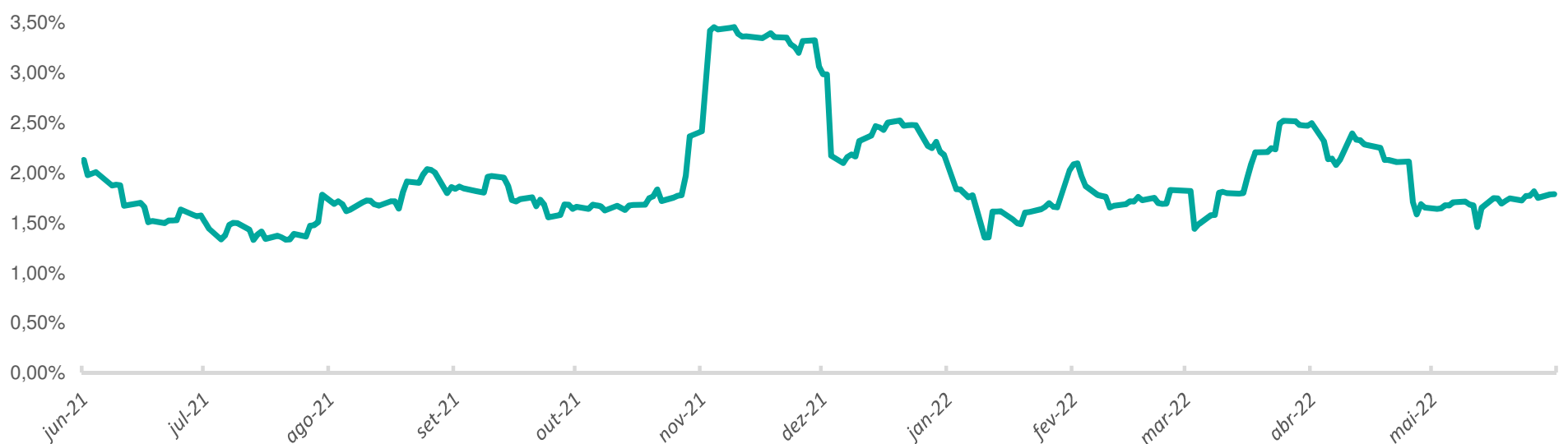


Ativos investidos



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\$ 59,13
Administração e Controladoria	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM
Custódia	BNY Mellon Banco S.A
Gestão	Fachesf
Patrimônio em 31/05/2022	R\$ 7.118.304,48
Conta para aplicação	Banco do Brasil AG. 3433-9 C/C. 6739-3 com identificador
Taxa de Administração do Plano	0,85% a.a

Histórico

Desempenho	RealizePrev	CDI
Meses positivos	21	26
Meses negativos	5	0
% Meses Positivos	81%	100%
Meses acima do CDI	11	-
Meses abaixo do CDI	15	-
% Meses acima do CDI	42%	-
Melhor mês	1,0075%	0,7285%
Pior mês	-0,5401%	0,1346%

Até o próximo mês!

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