

Relatório de Investimentos

REALIZEPREV

RealizePrev Junho/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 junho

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
0,2157%	1,0135%	21,28%

Rentabilidade dos últimos 12 meses

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
4,226%	8,655%	48,82%

A rentabilidade de 0,2157% foi possível graças a diversificação e otimização dos investimentos do RealizePrev, reduzindo o risco do portfólio. O mês de junho foi marcado por uma forte desvalorização da bolsa após valorização em maio, impactando no resultado da renda variável. O mercado de títulos públicos de renda fixa apresentou resultado negativo, impactando negativamente na carteira de renda fixa. A rentabilidade no mês foi positiva, porém inferior ao índice de referência, o CDI.

O cenário de volatilidade acentuada ao longo de 2022 deve predominar até o final do ano. 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.

Juros e Inflação

No mês de junho, destacamos a piora de percepção do mercado em relação à redução do processo inflacionário, o que ocasionou 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 negativo de 1,72%. A inflação do IGP-M registrou uma variação positiva de 0,59%, e do IPCA registrou uma variação positiva de 0,67%.

Bolsa

Os principais índices de bolsa no Brasil, apresentaram o seguinte movimento no mês: IBOV -11,50%, IBRX -11,56%, IDIV -8,38% e SMLL -16,33%; No exterior, observa-se o seguinte movimento: nos índices de bolsa Americanos: S&P 500 -8,39% e Nasdaq -8,71%, Europeus: CAC 40 -8,44%, EURO STOXX 50 -8,82%; FTSE MIB -13,10% e MOEX -6,41%, na Ásia: Nikkei 225: -3,25%, Kospi -13,15% e Hang Seng 2,08%; o índice dos mercados emergentes em geral apresentou uma variação de -7,14%. O Ibovespa desvalorizou 11,50%, no mês, acumulando uma desvalorização de 5,99%, no ano. Na renda variável, os mercados globais foram impactados devido às preocupações com a inflação, com o crescimento econômico e com o ajuste monetário no Brasil e nas principais economias do mundo.

Selic

Em junho, na reunião do COPOM (Comitê de Política Monetária), do Banco Central do Brasil, decidiu-se pela alta da taxa SELIC em 0,50 p.p. levando a SELIC para 13,25% ao ano. Para a próxima reunião, o Comitê sinalizou um novo ajuste de igual ou menor magnitude. O Comitê considerou essa como sendo a mais adequada estratégia para garantir a convergência da inflação ao longo do horizonte relevante, assim como a ancoragem das expectativas de prazos mais longos, ao mesmo tempo que reflete o aperto monetário já empreendido, reforça a postura de cautela da política monetária e ressalta a incerteza do cenário.



Na Renda Variável, os mercados globais foram impactados devido às preocupações com a inflação, com o crescimento econômico e com o ajuste monetário no Brasil e nas principais economias do mundo. O Real apresentou uma depreciação de 9,73% frente ao Dólar.

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

Brasil

No Brasil a inflação continua alta e o Congresso aprovou um pacote de aproximadamente R\$ 41,0 bilhões visando atenuar os efeitos da inflação sobre a população, como redução de impostos, elevação de auxílios existentes e criação de auxílios para taxistas e caminhoneiros. Com isso aumentam as preocupações com o equilíbrio fiscal. A atividade econômica continuou a surpreender positivamente, com destaque para a continuidade de forte criação de postos de trabalho, principalmente no setor de serviços. O Real apresentou uma depreciação de 9,73% frente ao Dólar.

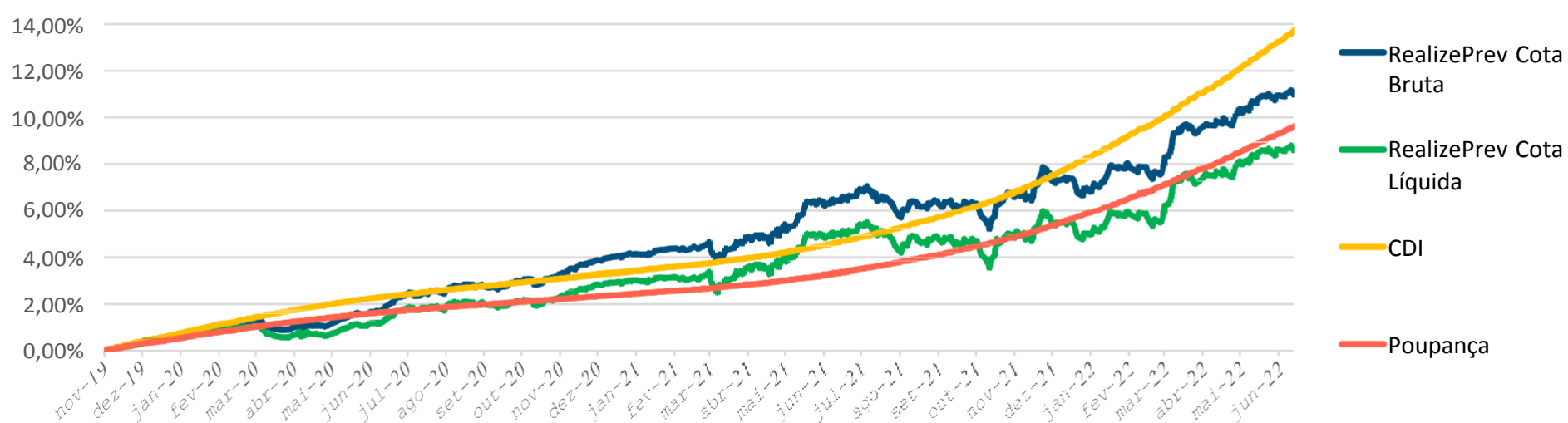
Exterior

No exterior, aumentaram as preocupações com o enfraquecimento da atividade global, tendo em vista os efeitos da guerra entre a Rússia e Ucrânia, à inflação persistente, as dificuldades nas cadeias de produção e os ajustes monetários anunciados por diversos bancos centrais. Nos EUA, o FOMC elevou a taxa de juros em 75 bps e indicou uma postura mais agressiva no combate à inflação, o que reforça as preocupações quanto à atividade global.



RealizePrev em números

Rentabilidade Acumulada (%)



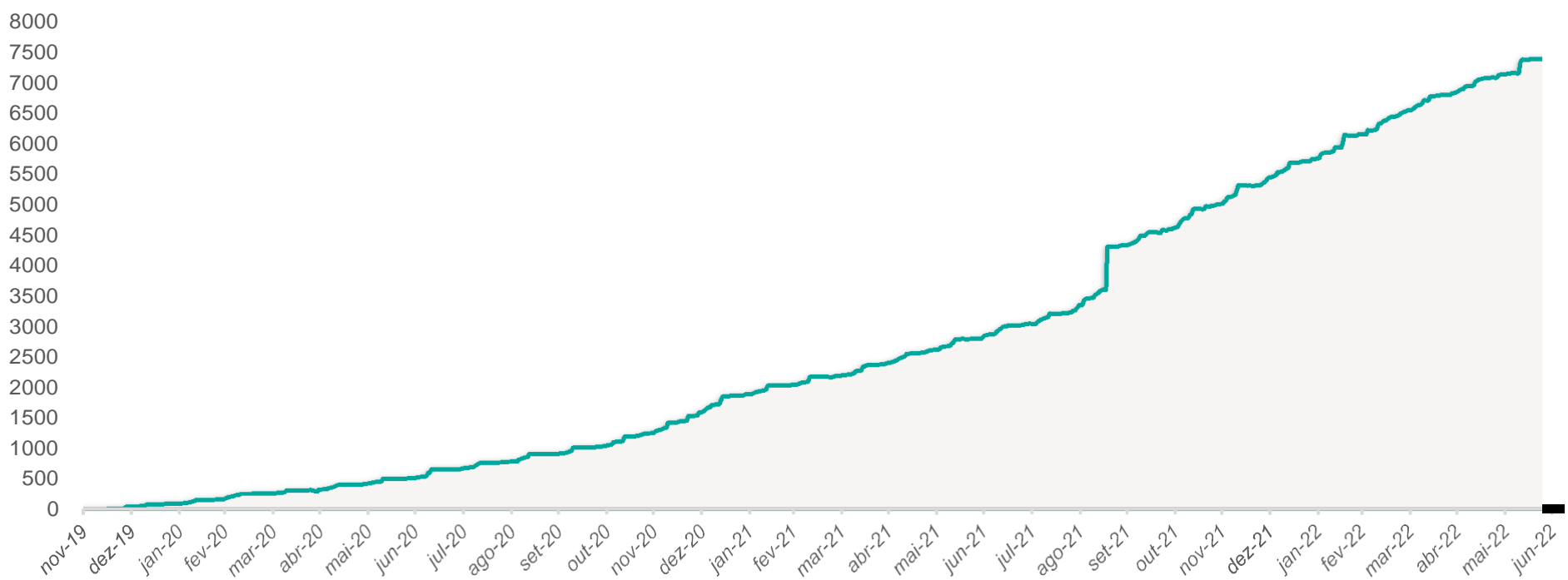
Rentabilidade x CDI | Últimos 12 meses

	Investimentos	Cota	CDI	Poupança	Investimentos (% do CDI)	Cota (% do CDI)	Investimentos (% da Poupança)
jun 2022	0,2157%	0,1439%	1,0135%	0,7149%	21,28%	14,19%	30,17%
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%

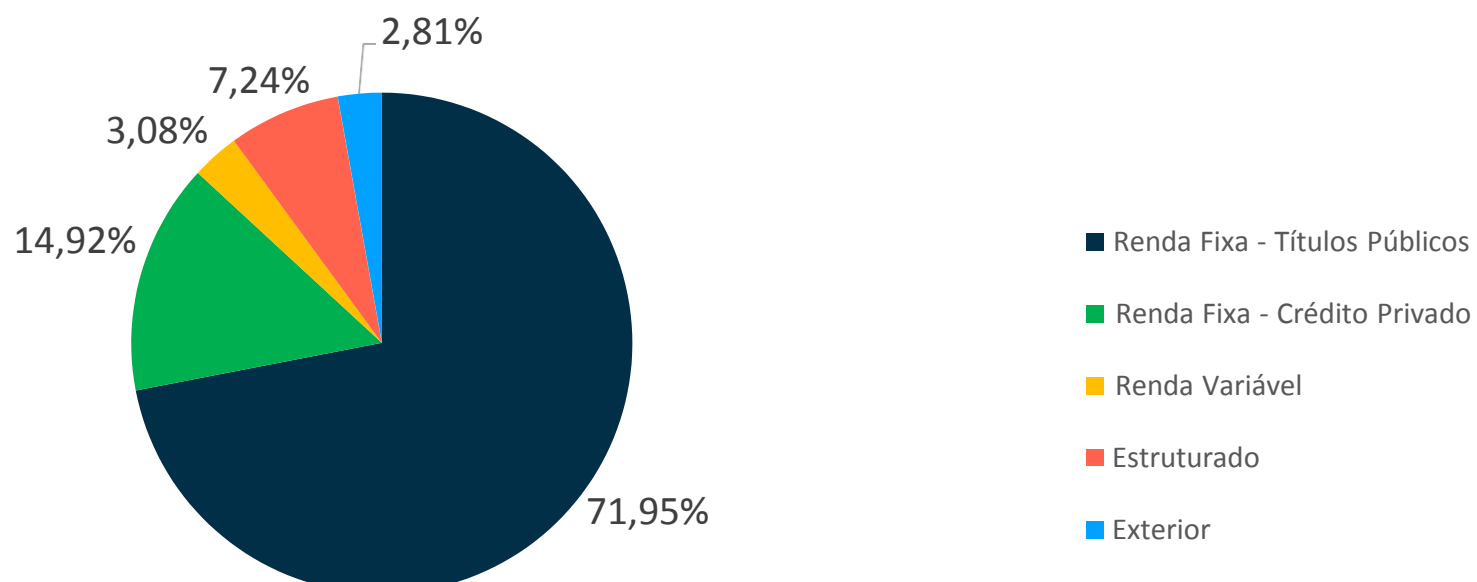
Acumulado	Investimentos	Cota	CDI	Poupança	Investimentos (% do CDI)	Cota (% do CDI)	Investimentos (% da Poupança)
2022	3,3148%	2,9203%	5,4015%	3,7938%	61,37%	54,06%	87,37%
2021	3,2504%	2,4963%	4,3950%	3,1453%	73,96%	56,80%	103,34%
2020	3,4654%	2,4991%	2,7677%	1,9918%	125,21%	90,30%	173,99%
Início *	10,9204%	8,5595%	13,6776%	9,6005%	79,84%	62,58%	113,75%

* Início em novembro/2019.

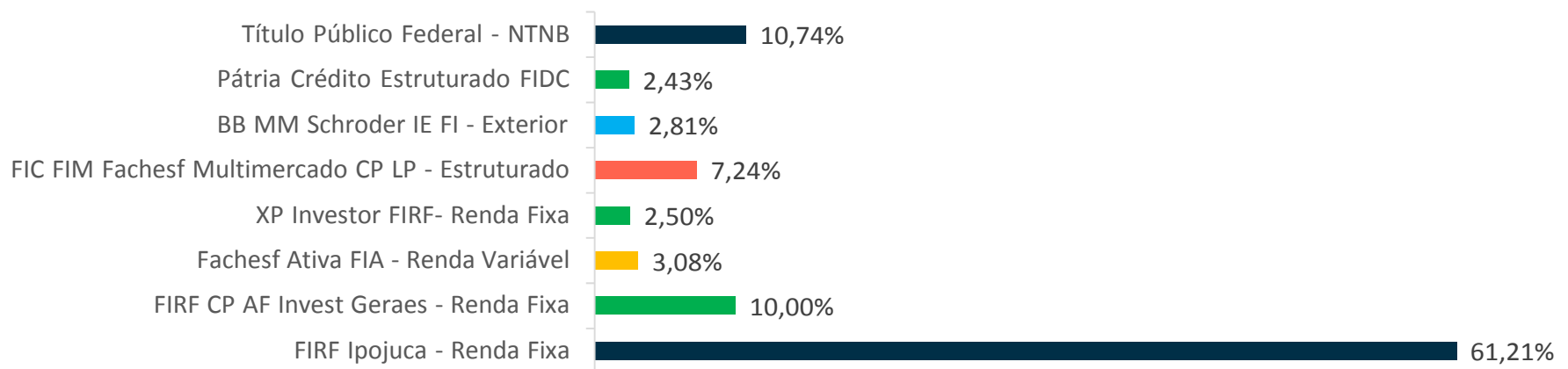
Evolução do Patrimônio (R\$ mil)



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 30/06/2022	R\$ 7.404.603,09
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