

# Relatório de Investimentos

## REALIZEPREV

RealizePrev agosto/2022



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 agosto

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
1,5374%	1,1676%	131,67%

### Rentabilidade dos últimos 12 meses

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
7,060%	10,201%	69,21%

A rentabilidade de 1,54%, equivalente a 131,67% do CDI, foi possível graças a diversificação e otimização dos investimentos do RealizePrev, reduzindo o risco do portfólio. O mês de agosto apresentou valorização da bolsa brasileira, na contramão das bolsas globais, beneficiada pelos bons dados da economia local, pelos bons resultados corporativos divulgados e uma inflação corrente menos pressionada. No mercado nacional no segmento de títulos públicos de renda fixa apresentaram resultados positivos para todos os vencimentos.

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 agosto, os índices de inflação apresentaram deflação devido aos efeitos da redução de impostos, pela queda dos preços internacionais de commodities, influenciada pela normalização das cadeias produtivas globais. A "curva de juros" (linha composta pela união dos pontos que representam taxas de juros dos títulos públicos em diferentes vencimentos ao longo do tempo) apresentou um expressivo fechamento no mês influenciada pelo possível fim do ciclo de alta dos juros no Brasil, a expectativa de uma desaceleração mais acentuada na atividade global e a normalização das cadeias produtivas que devem continuar contribuindo para a queda da inflação global de bens; A carteira própria de títulos públicos do RealizePrev, composta por NTN-B com vencimentos em 2045 e 2050, apresentou um retorno positivo de 3,25%. A inflação medida pelo IGP-M e do IPCA registrou variação negativa de 0,70% e 0,36%, respectivamente.

## Bolsa

Os principais índices de bolsa no Brasil, apresentaram o seguinte movimento no mês: IBOV 6,16%, IBRX 6,15%, IDIV 4,27% e SMLL 10,90%; No exterior, observa-se o seguinte movimento: nos índices de bolsa Americanos: S&P 500 -4,24% e Nasdaq -4,64%, Europeus: CAC 40 -5,02%, EURO STOXX 50 -5,15%; FTSE MIB -3,78% e MOEX 8,41%, na Ásia: Nikkei 225: 1,04%, Kospi 0,84% e Hang Seng -1,00%; o índice dos mercados emergentes em geral apresentou uma variação de 0,03%. O Ibovespa valorizou 6,16%, no mês, acumulando uma valorização de 4,48%, no ano. Na renda variável, os mercados globais foram prejudicados forte aumento das taxas de juros devido ao firme discurso dos bancos centrais no combate à inflação. No Brasil, os principais índices de bolsa foram beneficiados pelos bons dados da economia, pelos bons resultados corporativos divulgados e uma inflação corrente menos pressionada.

## Selic

Em agosto, na reunião do COPOM (Comitê de Política Monetária), do Banco Central do Brasil decidiu-se pelo aumento da Taxa SELIC em 0,50 p.p. para o patamar de 13,75% ao ano. Para a próxima reunião, o Comitê afirmou que avaliará um novo ajuste de menor magnitude. O Comitê ressaltou que o ambiente global permanece deteriorado e incerto para economias emergentes, com o avanço no nível de juros globais, porém com perspectivas de uma queda na atividade econômica nos próximos trimestres. Em relação à inflação brasileira, entende que a inflação projetada ainda permanece acima da meta para 2023 e em menor grau para 2024.



Na renda variável, os mercados globais foram prejudicados forte aumento das taxas de juros devido ao firme discurso dos bancos centrais no combate à inflação. No Brasil, os principais índices de bolsa foram beneficiados pelos bons dados da economia, pelos bons resultados corporativos divulgados e uma inflação corrente menos pressionada.

O Real apresentou depreciação de 0,46% frente ao Dólar.

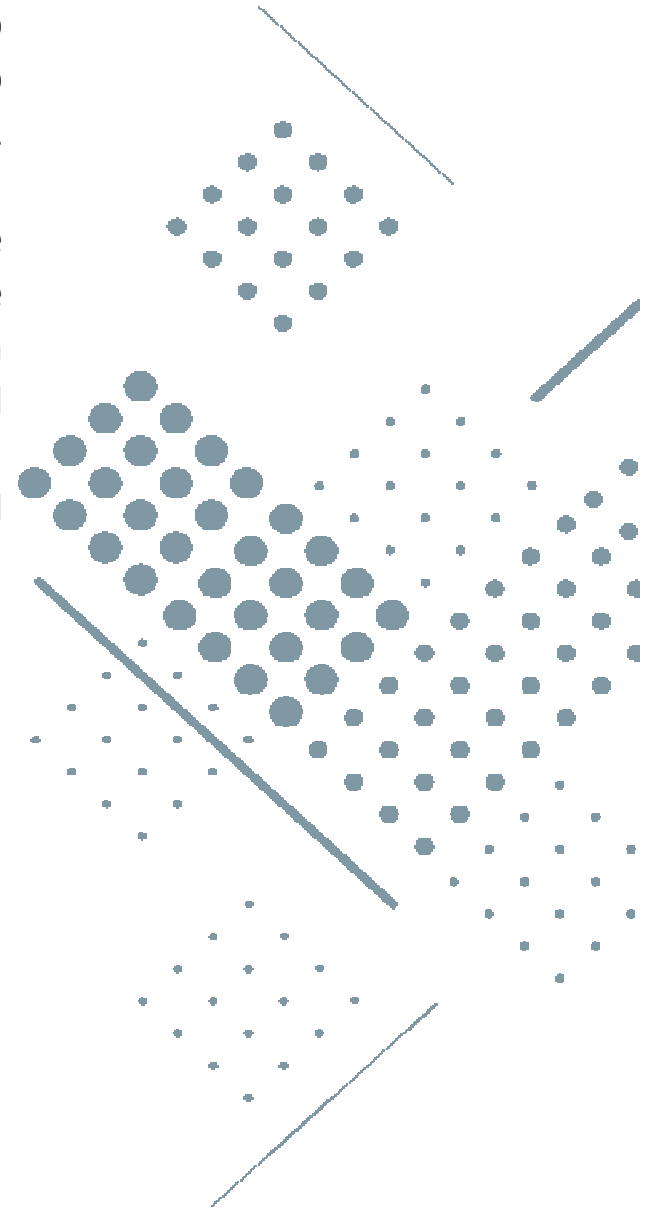
Os títulos públicos federais investidos pelo plano, com vencimentos mais longos, apresentaram retorno positivo.

## Brasil

No Brasil, os ativos apresentaram retorno positivo no mês influenciados pelo desempenho favorável do nível de atividade, corroborado pelos dados do PIB referente ao 2T22. As expectativas de crescimento para 2022 permanecem acima de 2% devido à atividade econômica, que continua aquecida e mostrando resiliência, ao setor de serviços, ao mercado de trabalho, além da normalização gradual das cadeias de produção globais e do ciclo favorável de commodities do 1º semestre. As incertezas giram em torno do debate sobre a nova âncora fiscal que deverá substituir a atual estrutura do teto de gastos, além de como o novo governo irá gerenciar a ampla gama de demandas sociais contratada para o ano que vem. O Real apresentou uma depreciação de 0,46% frente ao Dólar.

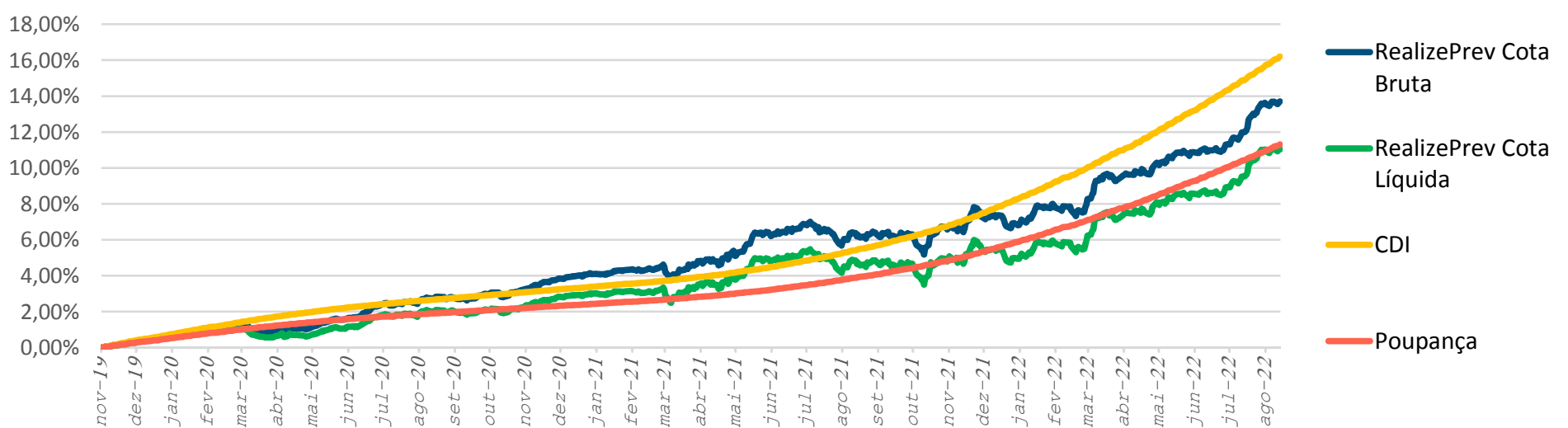
## Exterior

Na Europa, as pressões inflacionárias decorrentes da crise energética, provocada pela diminuição da oferta do gás russo e das condições climáticas adversas, permanecem sendo o problema focal da região, acarretando revisões negativas de crescimento, contaminação das expectativas de inflação, depreciação da moeda e em uma postura mais dura do banco central europeu. O FED indicou a necessidade de um aperto monetário mais prolongado com foco na estabilidade dos preços. A China intensificou medidas estimulativas nos campos monetário e fiscal, tendo em vista o fraco desempenho de sua economia por causa das restrições de mobilidade social devido à política de tolerância zero à Covid.



# RealizePrev em números

## Rentabilidade Acumulada (%)



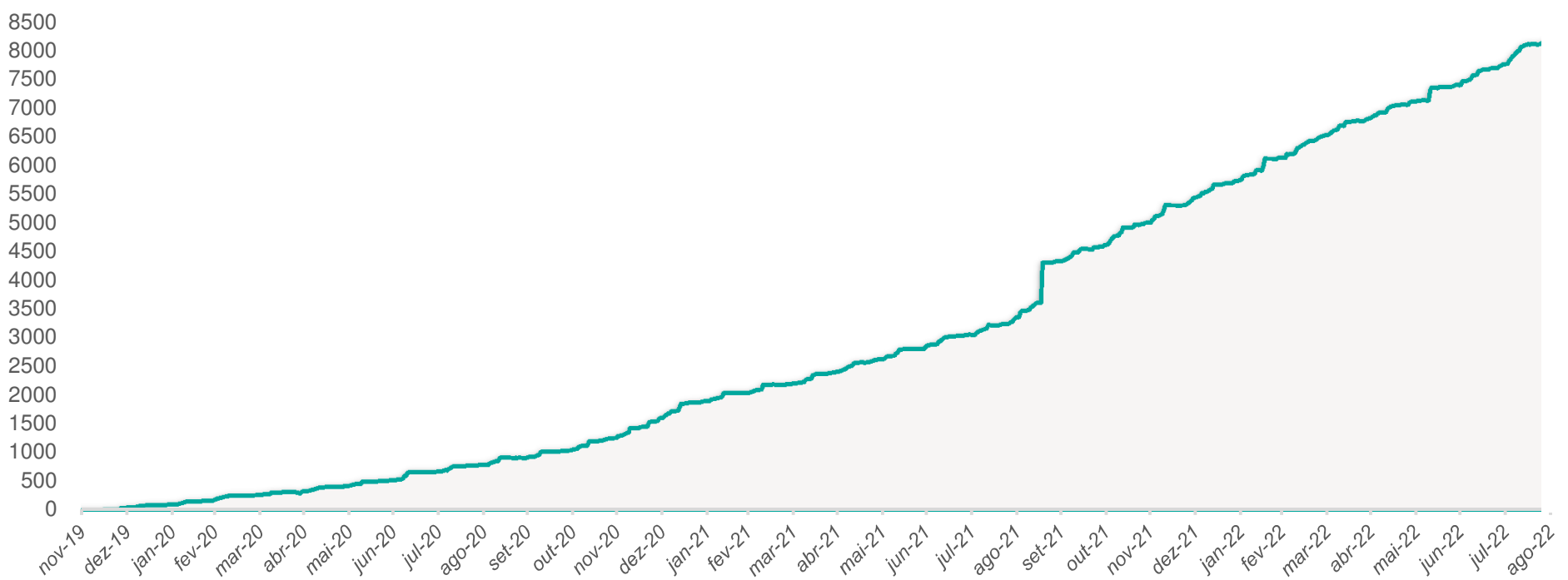
# Rentabilidade x CDI | Últimos 12 meses

	Investimentos	Cota	CDI	Poupança	Investimentos (% do CDI)	Cota (% do CDI)	Investimentos (% da Poupança)
ago 2022	1,5374%	1,3986%	1,1676%	0,8229%	131,67%	119,78%	186,83%
jul 2022	0,9492%	0,8767%	1,0348%	0,7285%	91,73%	84,72%	130,30%
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%

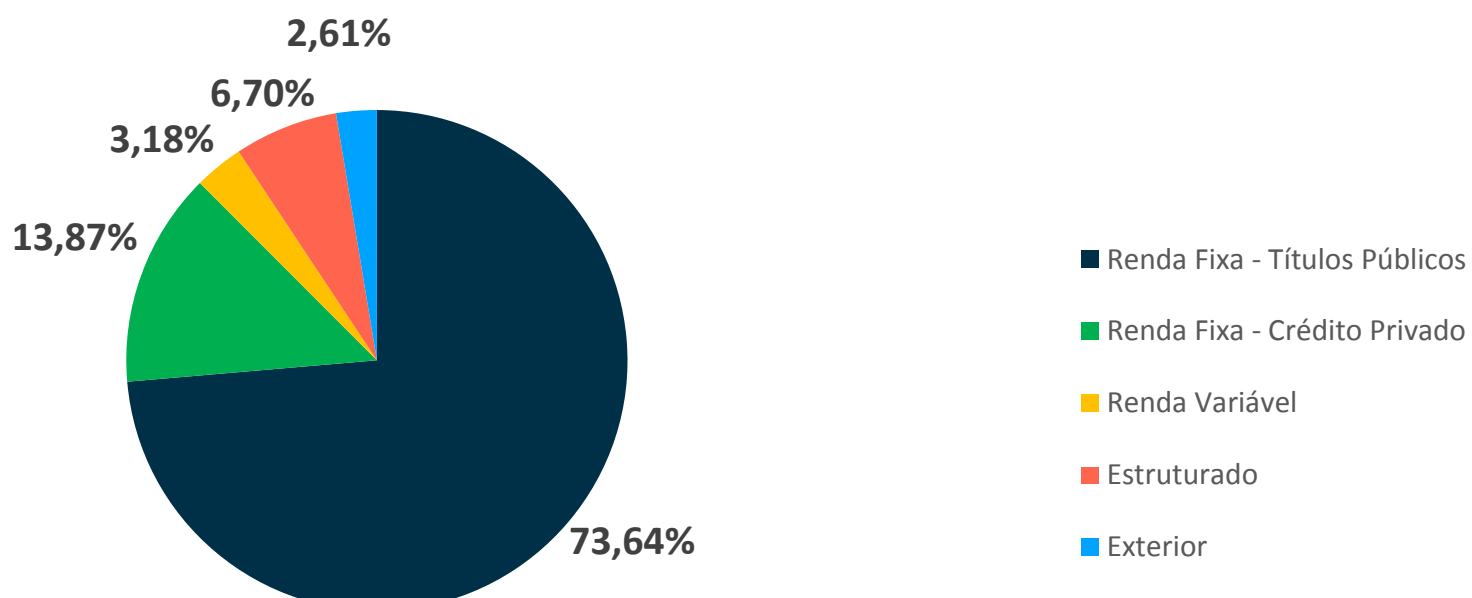
Acumulado	Investimentos	Cota	CDI	Poupança	Investimentos (% do CDI)	Cota (% do CDI)	Investimentos (% da Poupança)
2022	5,8989%	5,2746%	7,7356%	5,4103%	76,26%	68,19%	109,03%
2021	3,2504%	2,4963%	4,3950%	3,1453%	73,96%	56,80%	103,34%
2020	3,4654%	2,4991%	2,7677%	1,9918%	125,21%	90,30%	173,99%
Início *	13,6947%	11,0428%	16,1950%	11,3073%	84,56%	68,19%	121,11%

\* Início em novembro/2019.

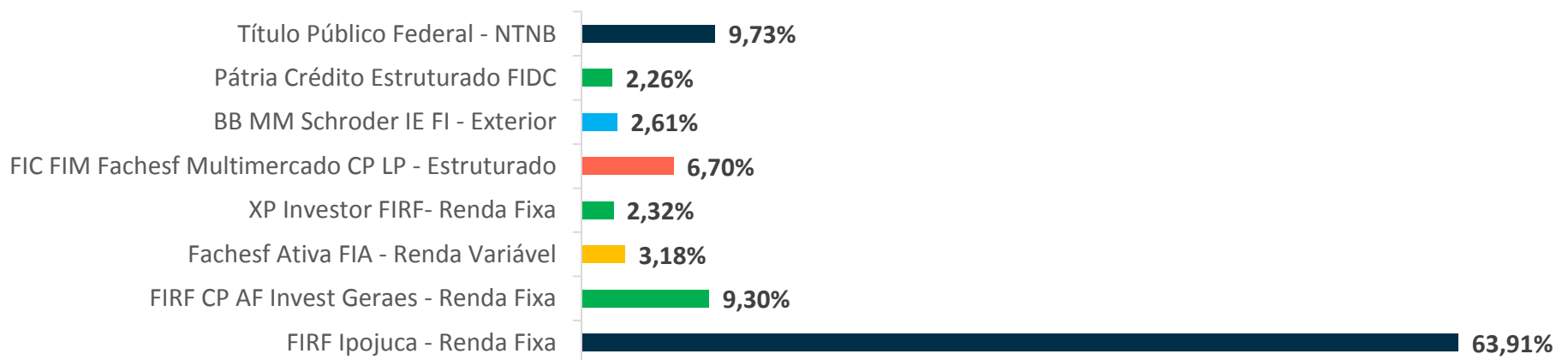
# Evolução do Patrimônio (R\$ mil)



# Alocação por segmento

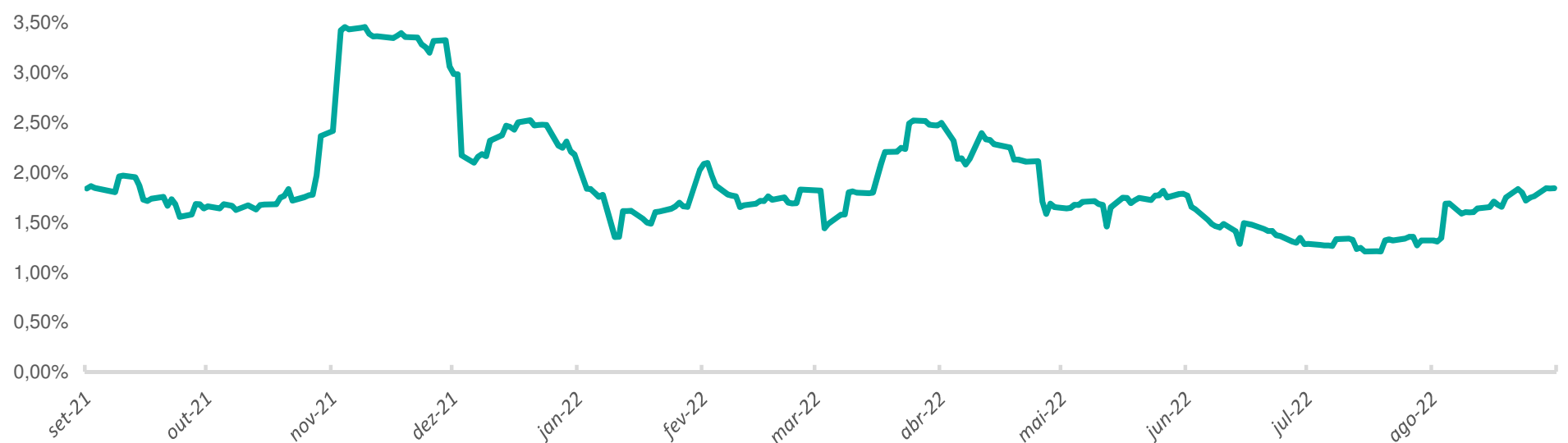


## Ativos investidos



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 31/08/2022	R\$ 8.161.407,00
Conta para aplicação	Banco do Brasil AG. 3433-9 C/C. 6739-3 com identificador
Taxa de Administração do Plano	0,85% a.a

## 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