

Relatório de Investimentos

REALIZEPREV

RealizePrev setembro/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 setembro

| RealizePrev | CDI | RealizePrev x CDI |
|-------------|---------|-------------------|
| 1,0285% | 1,0720% | 95,94% |

Rentabilidade dos últimos 12 meses

| RealizePrev | CDI | RealizePrev x CDI |
|-------------|---------|-------------------|
| 8,245% | 10,896% | 75,67% |

A rentabilidade de 1,03%, equivalente a 95,94% do CDI, foi possível graças a diversificação e otimização dos investimentos do RealizePrev, reduzindo o risco do portfólio. O mês de setembro apresentou valorização dos ativos no Brasil, na contramão das economias desenvolvidas com os mercados precificando um cenário desafiador nos próximos meses. 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 setembro, os índices de inflação continuaram apresentando deflação devido ainda aos efeitos da redução de impostos, pela queda dos preços das commodities, mostrando que a persistência do Banco Central no controle da inflação está surtindo efeito. 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 fechamento no mês refletindo em bons retornos apesar da volatilidade dos mercados no exterior; A carteira própria de títulos públicos do RealizePrev, composta por NTN-B com vencimentos em 2045 e 2050, apresentou um retorno positivo de 1,33%. A inflação medida pelo IGP-M registrou variação negativa de 0,95% e expectativa de -0,25% para o IPCA.

Bolsa

Os principais índices de bolsa no Brasil, apresentaram o seguinte movimento no mês: IBOV 0,47%, IBRX -0,05%, IDIV -1,80% e SMLL -1,84%; No exterior, observa-se o seguinte movimento: nos índices de bolsa Americanos: S&P 500 -9,34% e Nasdaq -10,50%, Europeus: CAC 40 -5,92%, EURO STOXX 50 -5,66%; FTSE MIB -4,22% e MOEX -18,45%, na Ásia: Nikkei 225: -7,67%, Kospi -12,81% e Hang Seng -16,69%; o índice dos mercados emergentes em geral apresentou uma variação de -11,90%. O Ibovespa valorizou 0,47%, no mês, acumulando uma valorização de 4,97%, no ano. Na renda variável, os mercados globais foram prejudicados pelo aumento das taxas de juros na Europa e EUA, à inflação persistente e uma atividade ainda resiliente, levando o mercado a precificar nos aumentos de juros, a manutenção dos juros em patamar elevado por mais tempo e maior risco de recessão global.

Selic

Em setembro, na reunião do COPOM (Comitê de Política Monetária), do Banco Central do Brasil, não houve aumento da Taxa SELIC que permaneceu no patamar de 13,75% ao ano. O Comitê deu a entender que não reduzirá a Selic no curto prazo com o mercado projetando queda a partir do segundo semestre de 2023. O Comitê entende que essa decisão reflete a incerteza ao redor de seus cenários e um balanço de riscos com variância ainda maior do que a usual para a inflação prospectiva, e é compatível com a estratégia de convergência da inflação para o redor da meta ao longo do horizonte relevante, que inclui o ano de 2023 e, em grau menor, o de 2024.



Na renda variável, os mercados globais foram prejudicados pelo aumento das taxas de juros na Europa e EUA, à inflação persistente e uma atividade ainda resiliente, levando o mercado a precificar nos aumentos de juros, a manutenção dos juros em patamar elevado por mais tempo e maior risco de recessão global.

O Real apresentou depreciação de 3,02% frente ao Dólar.

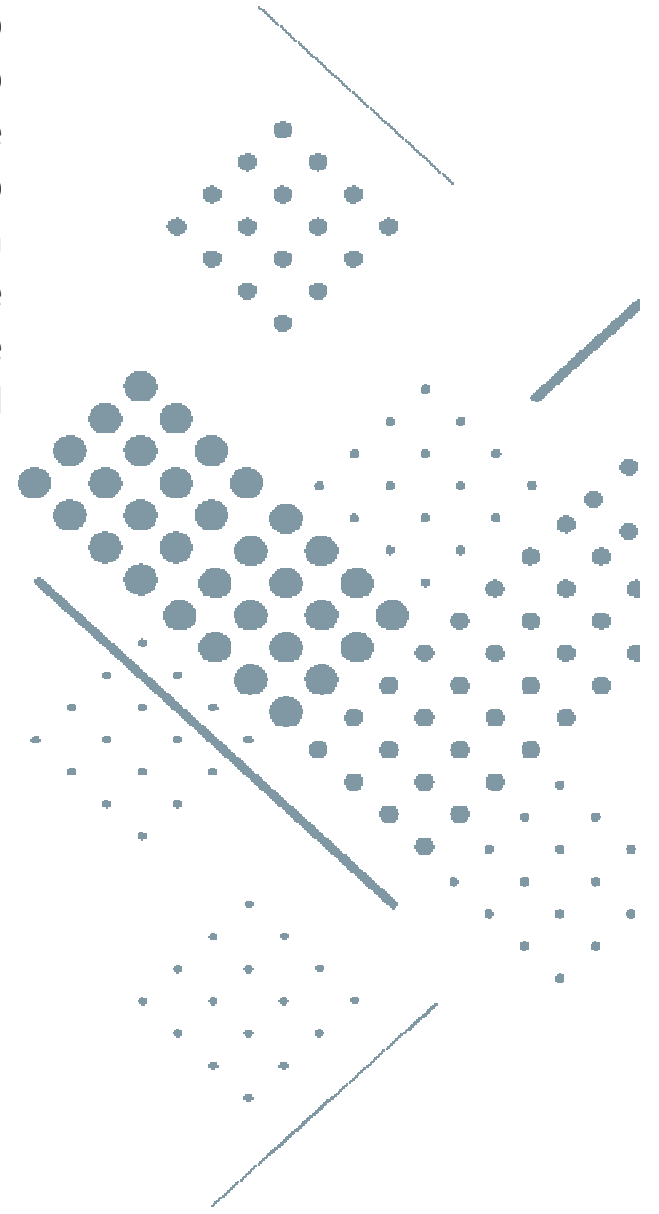
Os títulos públicos federais investidos pelo plano, com vencimentos mais longos, apresentaram retorno positivo.

Brasil

No Brasil, A economia segue apresentando um crescimento sustentado, o PIB continua surpreendendo positivamente frente às projeções, o mercado de trabalho continua firme, com sucessivas quedas na taxa de desemprego e aumento da população ocupada e da massa de rendimento real, por outro lado continuam os desafios para convergência da inflação para a meta. Com o resultado das eleições aumentaram as preocupações com o ambiente fiscal. As incertezas em torno da nova âncora fiscal permanecem e o que deverá substituir a atual estrutura do teto de gastos está em debate. O Real apresentou uma depreciação de 0,46% frente ao Dólar.

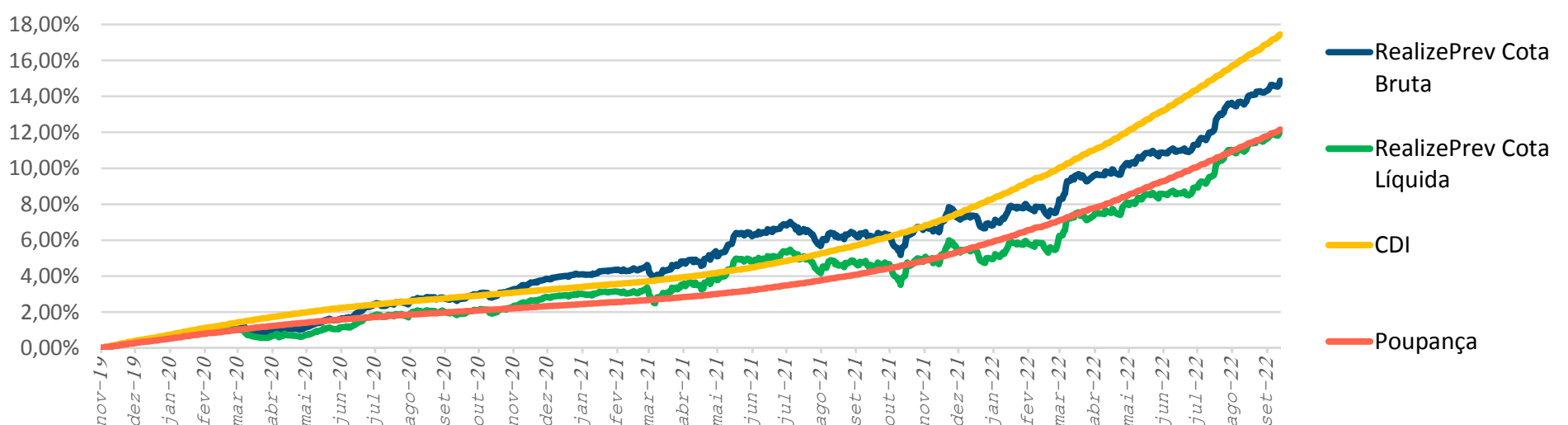
Exterior

Na Europa, os mercados apresentaram forte volatilidade com o mercado precificando mais alta de juros e maior probabilidade de recessão global. Nos EUA, o FED elevou a taxa de juros em 0,75 p.p., atingindo o patamar de 3,25%. Na Europa o BCE, também aumentou em 0,75% p.p., para 1,25%, e o banco central do Reino Unido em 0,50 p.p., para 2,25%. A guerra entre Rússia e Ucrânia e as tensões entre China, Taiwan e os EUA têm gerado apreensão nos mercados globais. O governo inglês anunciou agressivo pacto de redução de impostos e aumento de gastos a fim de proteger a economia da forte elevação nos preços da energia gerando temores sobre as finanças públicas do país, levando a forte desvalorização na libra e ampla abertura nas taxas de juros.



RealizePrev em números

Rentabilidade Acumulada (%)



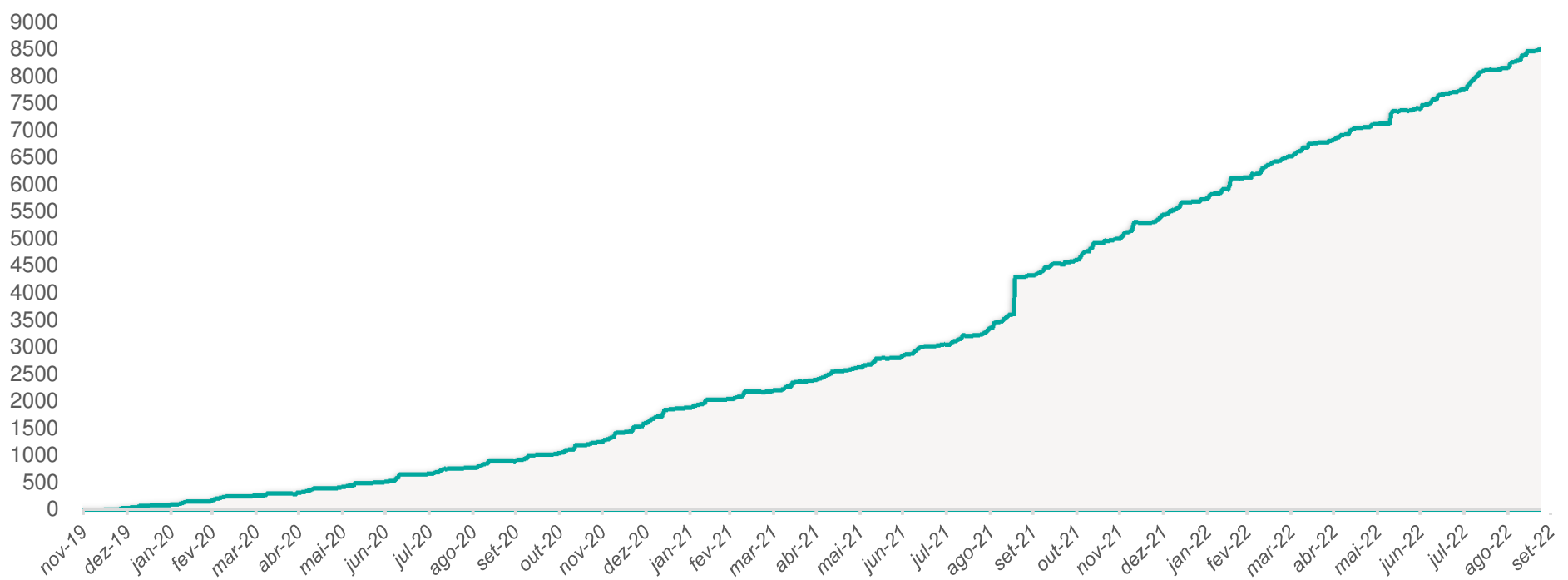
Rentabilidade x CDI | Últimos 12 meses

| | Investimentos | Cota | CDI | Poupança | Investimentos (% do CDI) | Cota (% do CDI) | Investimentos (% da Poupança) |
|----------|---------------|----------|---------|----------|--------------------------|-----------------|-------------------------------|
| set 2022 | 1,0285% | 0,9596% | 1,0720% | 0,7544% | 95,94% | 89,51% | 136,33% |
| 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% |

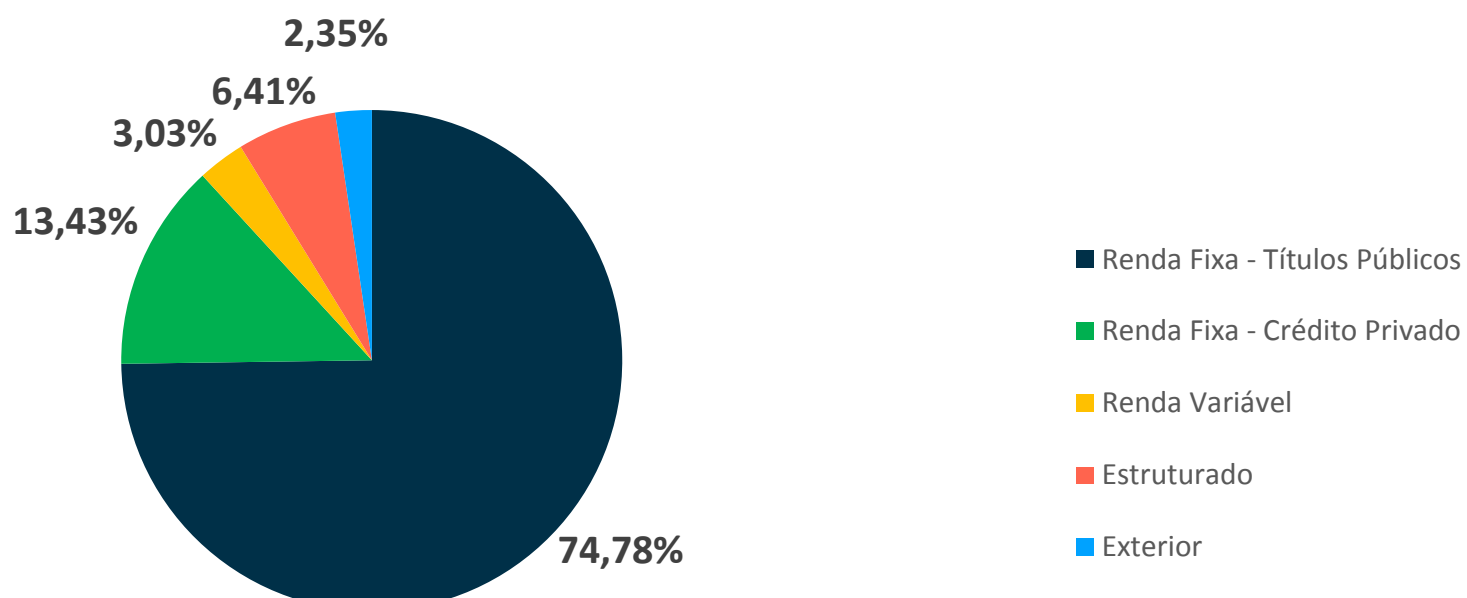
| Acumulado | Investimentos | Cota | CDI | Poupança | Investimentos (% do CDI) | Cota (% do CDI) | Investimentos (% da Poupança) |
|-----------|---------------|----------|----------|----------|--------------------------|-----------------|-------------------------------|
| 2022 | 6,9881% | 6,2848% | 8,8906% | 6,2055% | 78,60% | 70,69% | 112,61% |
| 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 * | 14,8641% | 12,1083% | 17,4407% | 12,1471% | 85,23% | 69,43% | 122,37% |

* Início em novembro/2019.

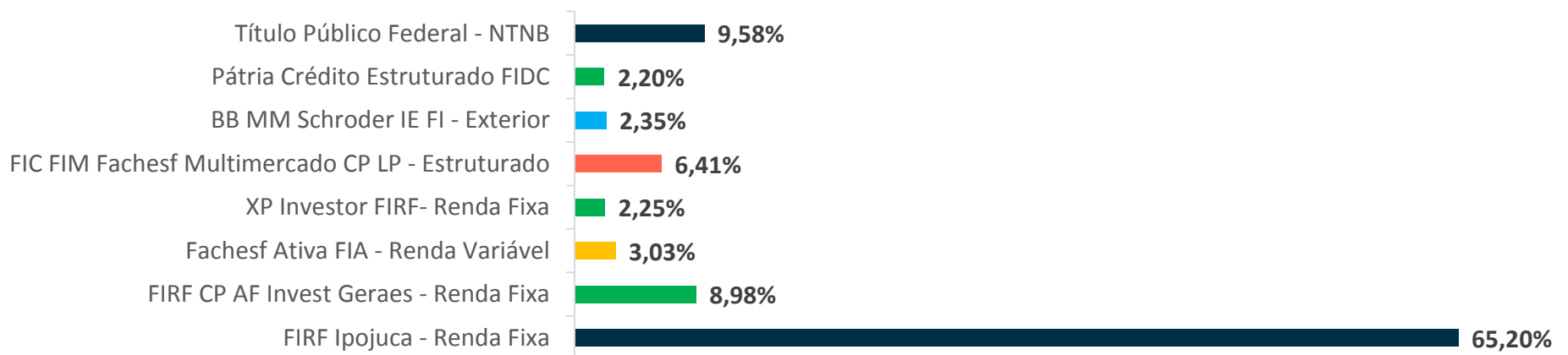
Evolução do Patrimônio (R\$ mil)



Alocação por segmento

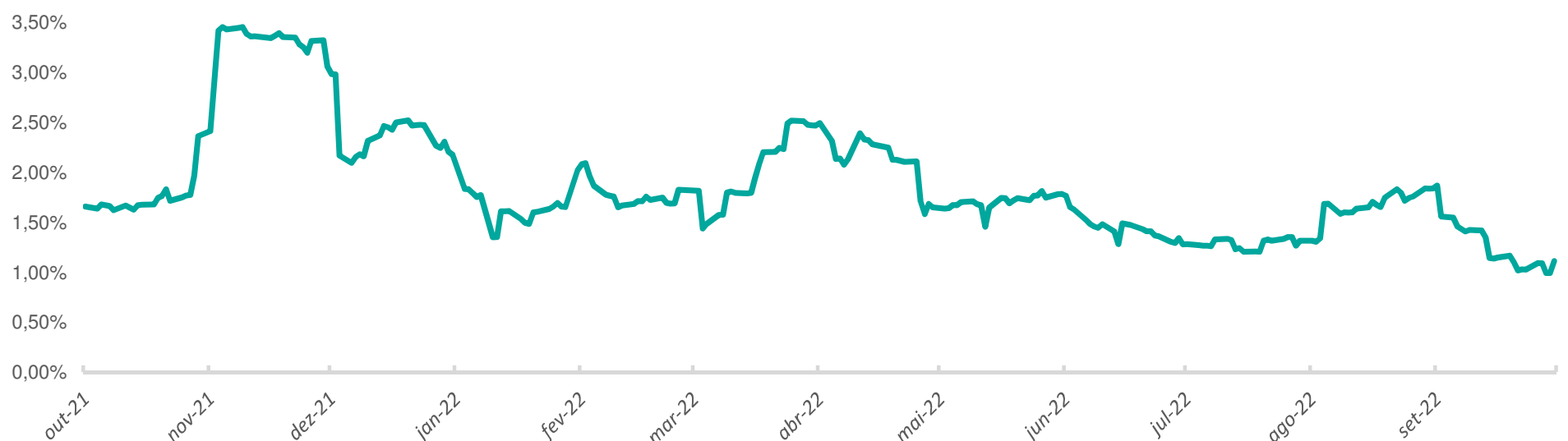


Ativos investidos



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 30/09/2022 | R\$ 8.546.797,75 |
| 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