

# Relatório de Investimentos

## REALIZEPREV

### RealizePrev outubro/2021



- Os investimentos do Plano foram impactados negativamente pelo aumento da aversão a risco doméstico, incerteza em relação ao rumo das políticas fiscais e fatores externos relacionados a riscos inflacionários, ficando abaixo do objetivo de rentabilidade no mês.

#### Rentabilidade do mês de outubro

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
-0,5401%	0,4804%	-112,44%

#### Rentabilidade dos últimos 12 meses

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
2,666%	3,323%	80,21%

O movimento de diversificação realizado na carteira do RealizePrev foi importante para atenuar esse resultado. No decorrer da atual crise, haverá meses de maior estresse e incertezas nos mercados, eventuais oportunidades de compra de ativos e rebalanceamentos em virtude de oscilações pontuais devem ser aproveitadas.

## Juros e Inflação

No mês de outubro, 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) em todos os vencimentos; A inflação do IGP-M registrou uma variação positiva de 0,64%, em outubro/2021, e 16,73%, no acumulado do ano. O IPCA apresentou uma variação de 1,25%, no mês, e 8,24%, no acumulado do ano.

## Bolsa

Os principais índices de bolsa no Brasil, apresentaram o seguinte movimento no mês: IBOV -6,74%, IBRX -6,81%, IDIV -4,23% e SMLL -12,53%; No exterior, observa-se o seguinte movimento: nos índices de bolsa Americanos: S&P 500 6,91% e Nasdaq 7,27%, Europeus: CAC 40 4,76%, EURO STOXX 50 5,00%; FTSE MIB 4,64% e MOEX: 1,13%, na Ásia: Nikkei 225: +1,90%, Kospi -3,20% e Hang Seng 3,26% e -2,05% no índice dos mercados emergentes em geral.

## Selic

Internamente, na reunião do COPOM (Comitê de Política Monetária), do Banco Central, decidiu-se pela alta da taxa SELIC em 1,50 p.p., para 7,75%. Segundo o COPOM sua decisão reflete sua preocupação com a inflação ao consumidor que segue elevada e tem se mostrado mais persistente que o antecipado. O cenário básico do COPOM prevê uma pressão inflacionária acima do esperado, entretanto considera a convergência da inflação para a meta no ano-calendário de 2022 e 2023. O Comitê indicou um aumento da mesma magnitude para a próxima reunião.

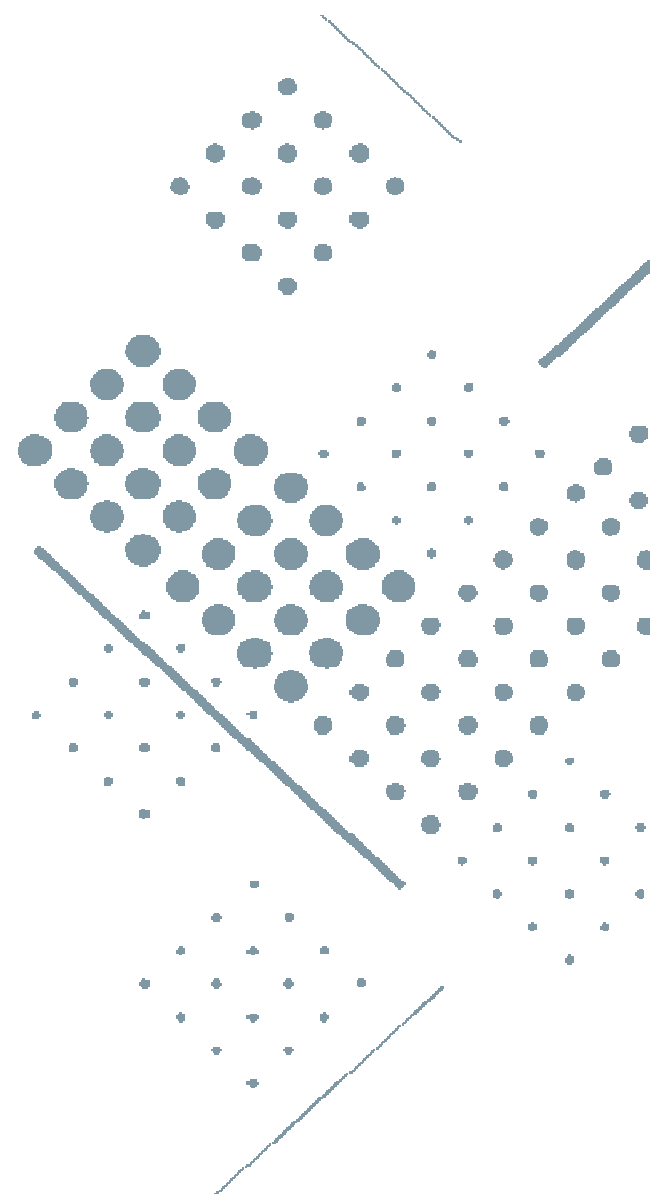


Os principais índices de bolsa no Brasil apresentaram movimento de baixa, movimento contrário ao verificado na maioria das bolsas no mundo.

Os mercados foram impactados devido às questões fiscais e políticas, alta da inflação e abertura das curvas de juros. O Real apresentou uma depreciação de 3,21% frente ao Dólar.

## Brasil

No Brasil, o mês de outubro foi marcado pela alteração do teto dos gastos, que levou ao pedido de demissão de membros da equipe econômica, pelo anúncio do novo programa social sem corte de gastos ou reformas que justifiquem o novo valor, pelo auxílio gás e o auxílio aos caminhoneiros, pela indefinição sobre a PEC dos precatórios e pelo cenário de alta da inflação, com isso verificou-se forte queda da bolsa, alta do dólar e abertura das taxas de juros. As questões políticas continuam trazendo bastante volatilidade aos mercados. Por outro lado a vacinação contra a Covid e reabertura da economia seguem avançando. O Real apresentou uma depreciação de 3,21% frente ao Dólar.

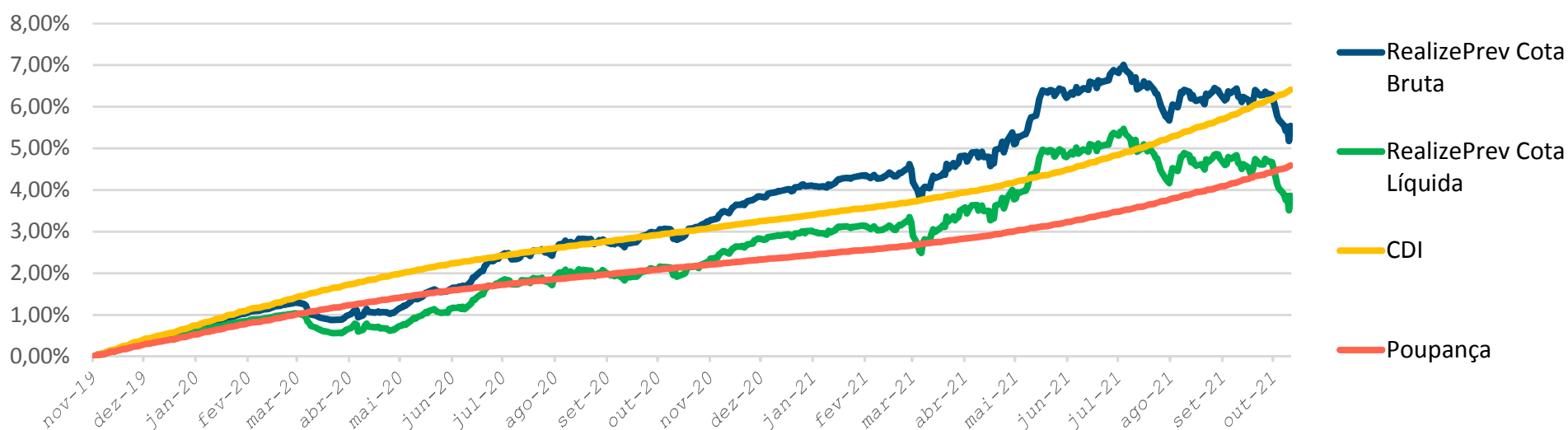


## Exterior

A inflação global segue pressionada pela demora da normalização da cadeia de suprimentos e pela forte alta dos preços do petróleo aumentando o risco dessa alta não ser transitória, como vinha sendo o discurso, e levando alguns bancos centrais a iniciar ou sinalizar a o início de algum tipo de aperto monetário. A desaceleração do crescimento Chinês pode pressionar para baixo os preços ainda altos das commodities. Todo esse cenário levou a uma abertura das taxas de juros na parte curta da curva. Em relação à pandemia da Covid observa-se aumento dos casos na Europa e na China, que implementou a estratégia de covid zero.

# RealizePrev em números

## Rentabilidade Acumulada (%)



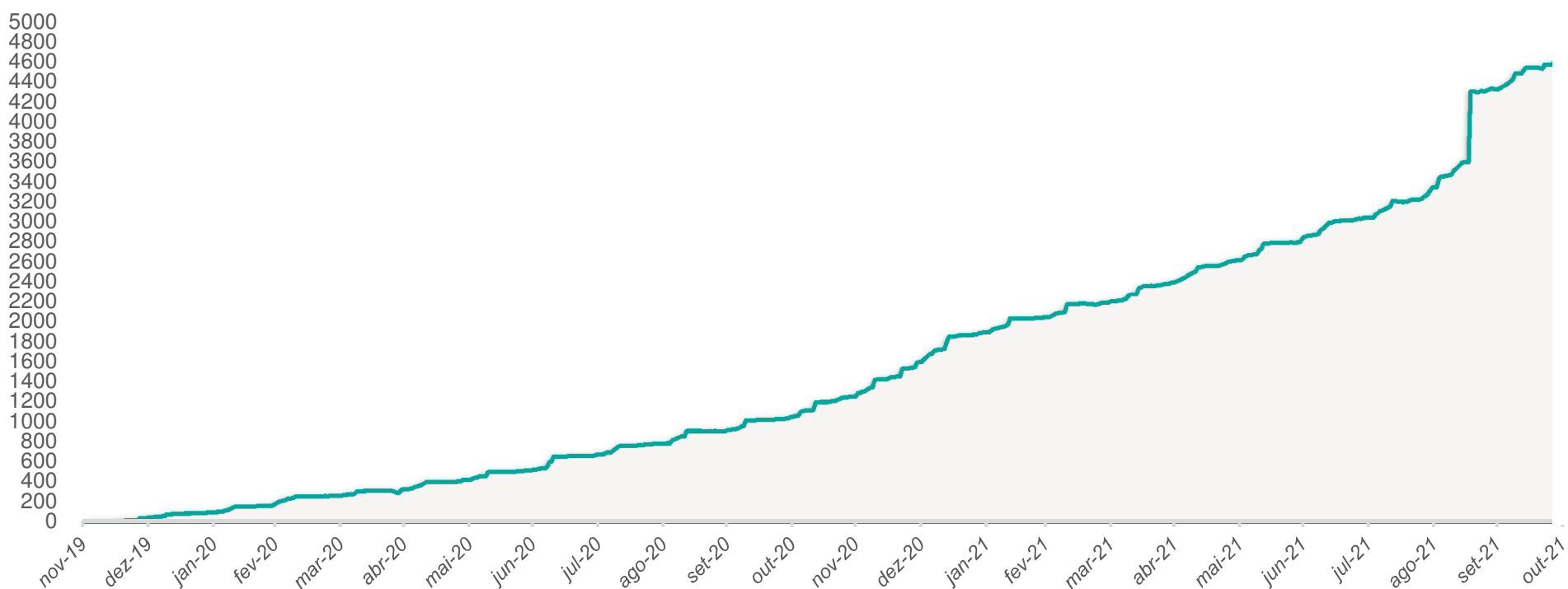
## Rentabilidade x CDI | Últimos 12 meses

	Investimentos	Cota	CDI	Poupança	Investimentos (% do CDI)	Cota (% do CDI)	Investimentos (% da Poupança)
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%
mai 2021	0,9526%	0,8712%	0,2674%	0,1948%	356,27%	325,84%	488,99%
abr 2021	0,4301%	0,4223%	0,2078%	0,1508%	206,99%	203,22%	285,18%
mar 2021	0,0663%	0,0260%	0,1982%	0,1470%	33,46%	13,11%	45,11%
fev 2021	0,1637%	0,0499%	0,1346%	0,0991%	121,61%	37,04%	165,27%
jan 2021	0,1159%	0,0688%	0,1493%	0,1101%	77,59%	46,08%	105,26%
dez 2020	0,5210%	0,4279%	0,1645%	0,1211%	316,66%	260,08%	430,28%
nov 2020	0,6238%	0,5472%	0,1495%	0,1101%	417,29%	366,05%	566,70%

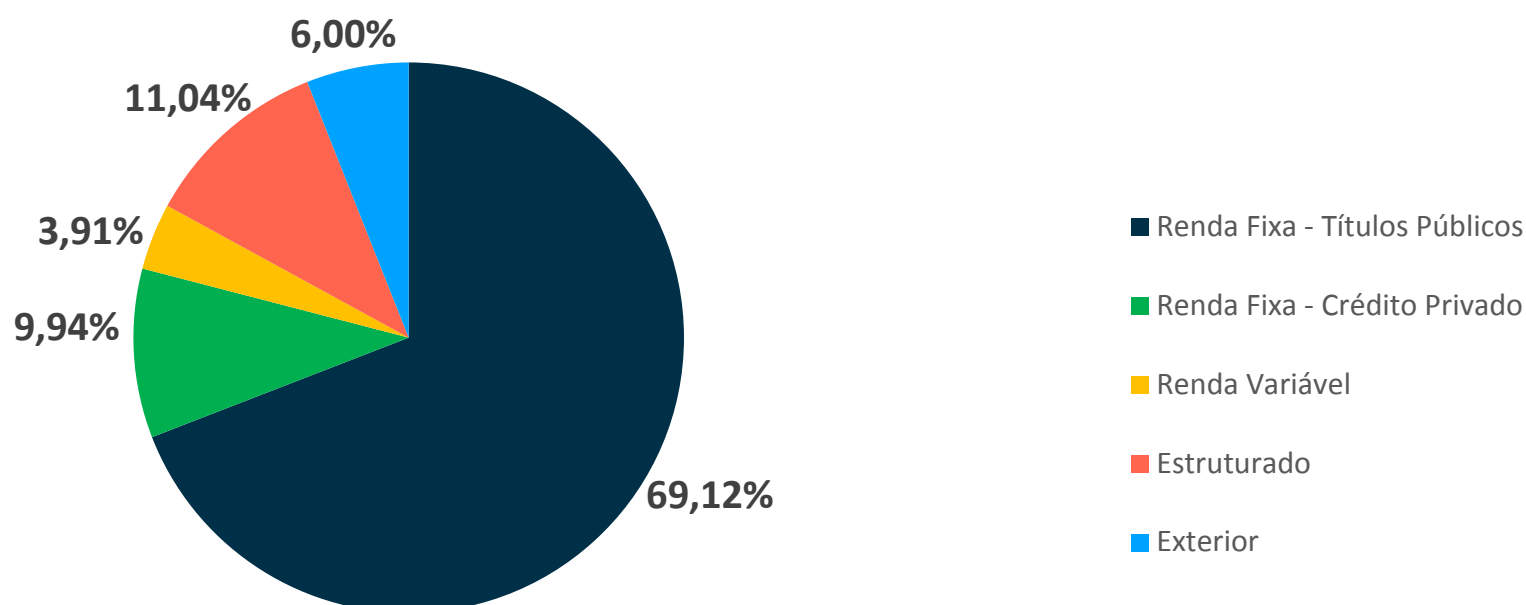
Acumulado	Investimentos	Cota	CDI	Poupança	Investimentos (% do CDI)	Cota (% do CDI)	Investimentos (% da Poupança)
2021	1,5004%	0,9261%	2,9996%	2,1630%	50,02%	30,87%	69,37%
2020	3,4654%	2,4991%	2,7677%	1,9918%	125,21%	90,30%	173,99%
Início *	5,5418%	3,8633%	6,4104%	4,5888%	86,45%	60,27%	120,77%

\* Início em novembro/2019.

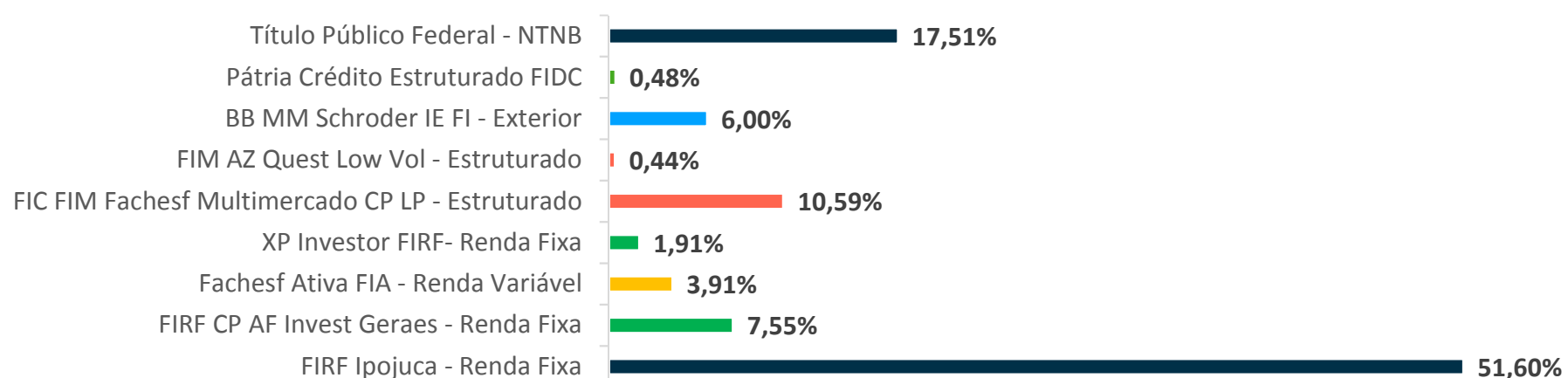
## Evolução do Patrimônio (R\$ mil)



## Alocação por segmento

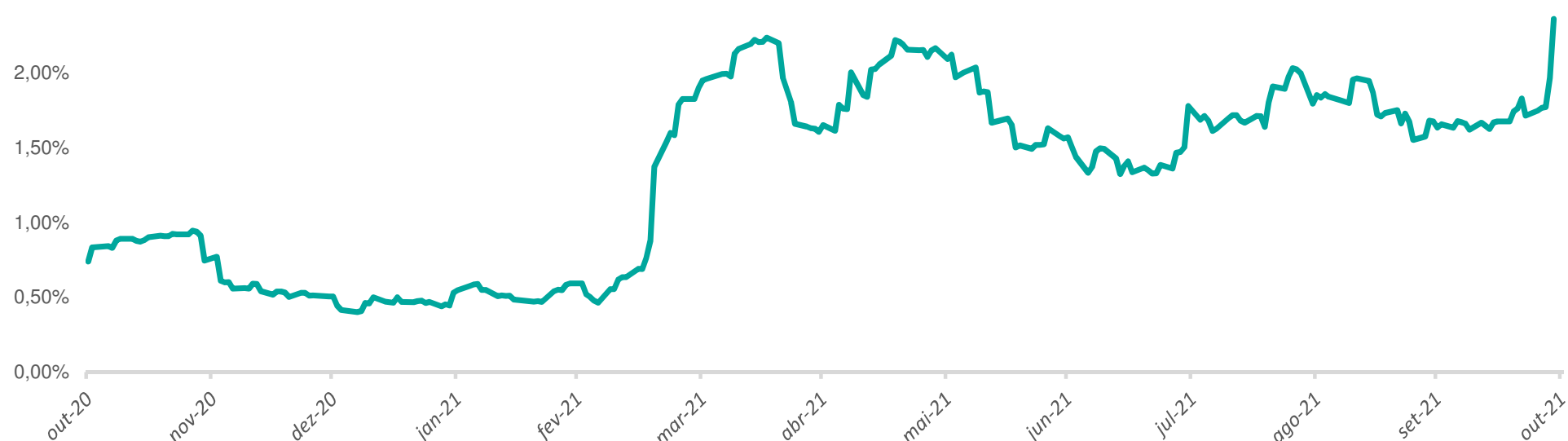


## Ativos investidos



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\$ 53,68
Administração e Controladoria	BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM
Custódia	BNY Mellon Banco S.A
Gestão	Fachesf
Patrimônio em 29/10/2021	R\$ 4.604.057,99
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	19	24
Meses negativos	5	0
% Meses Positivos	79%	100%
Meses acima do CDI	10	-
Meses abaixo do CDI	14	-
% Meses acima do CDI	42%	-
Melhor mês	0,9526%	0,4804%
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