

Relatório de Investimentos

REALIZEPREV

RealizePrev outubro/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 outubro

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
1,2495%	1,0207%	122,42%

Rentabilidade dos últimos 12 meses

RealizePrev	CDI	RealizePrev x CDI
10,193%	11,492%	88,69%

A rentabilidade de 1,25%, equivalente a 122,42% do CDI, foi possível graças a diversificação e otimização dos investimentos do RealizePrev, reduzindo o risco do portfólio. O mês de outubro foi marcado pela valorização dos ativos no Brasil e no mundo, apesar do cenário ainda desafiador para os 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 outubro, apesar da deflação apresentada pelo IGPM, o mercado passou a precificar inflação à frente com a diminuição dos efeitos das medidas que levaram à deflação nos meses anteriores. 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 leve fechamento no mês refletindo em retornos positivos apesar da volatilidade dos mercados; A carteira própria de títulos públicos do RealizePrev, composta por NTN-B com vencimentos em 2045 e 2050, apresentou um retorno positivo de 0,37%. A inflação medida pelo IGP-M registrou variação negativa de 0,97% e o IPCA 0,59% positivo.

Bolsa

Os principais índices de bolsa no Brasil, apresentaram o seguinte movimento no mês: IBOV 5,45%, IBRX 5,57%, IDIV 4,03% e SMLL 7,30%; No exterior, observa-se o seguinte movimento: nos índices de bolsa Americanos: S&P 500 7,99% e Nasdaq 3,90%, Europeus: CAC 40 10,85%, EURO STOXX 50 10,36%; FTSE MIB 11,30% e MOEX 10,69%, na Ásia: Nikkei 225: 4,87%, Kospi 8,06% e Hang Seng -6,16%; o índice dos mercados emergentes em geral apresentou uma variação de -3,15%. Com a variação do mês o Ibovespa acumula uma valorização de 10,70%, no ano. Na renda variável, os mercados globais apresentaram uma recuperação beneficiados pelas decisões de alguns bancos centrais que subiram as taxas de juros menos do que os mercados projetavam.

Selic

Em outubro, na reunião do COPOM (Comitê de Política Monetária), do Banco Central do Brasil, houve a manutenção da Taxa SELIC em 13,75% ao ano. O Comitê percebeu um ritmo mais moderado da atividade econômica e 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 2024. O BACEN continuará monitorando os efeitos da manutenção da SELIC nesse patamar por período suficientemente prolongado e não hesitará em retomar o ciclo de ajuste caso o processo de desinflação não surta efeito.



Na renda variável, os mercados globais apresentaram uma recuperação beneficiados pelas decisões de alguns bancos centrais que subiram as taxas de juros menos do que os mercados projetavam.

O Real apresentou uma apreciação de 3,68% frente ao Dólar.

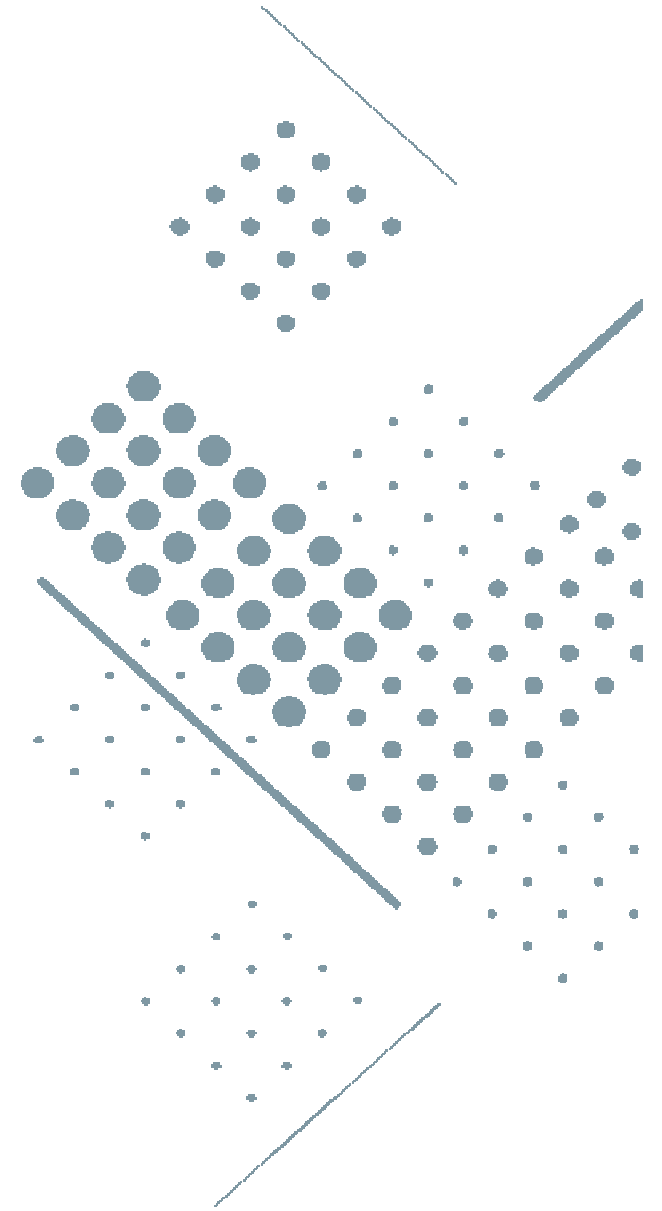
Os títulos públicos federais investidos pelo plano, com vencimentos mais longos, apresentaram retorno positivo.

Brasil

No Brasil, o destaque do mês foi o acirrado processo eleitoral. A nova composição do congresso, com maioria de centro-direita, leva a crer que o novo governo terá um árduo trabalho de negociações para conseguir aprovação de medidas. Para os próximos anos mantém-se as incertezas devido à indefinição sobre a equipe econômica do novo governo e pela falta de clareza da política econômica a ser seguida. As principais preocupações estão relacionadas à política fiscal, tendo em vista as discussões sobre o orçamento, à mudança na regra fiscal que substituirá o teto de gastos, bem como da aprovação de um "waiver" para acomodar despesas além do atual limite. Os efeitos do aperto da política monetária sobre a atividade começam a ser percebidos. O Real apresentou uma apreciação de 3,68% frente ao Dólar.

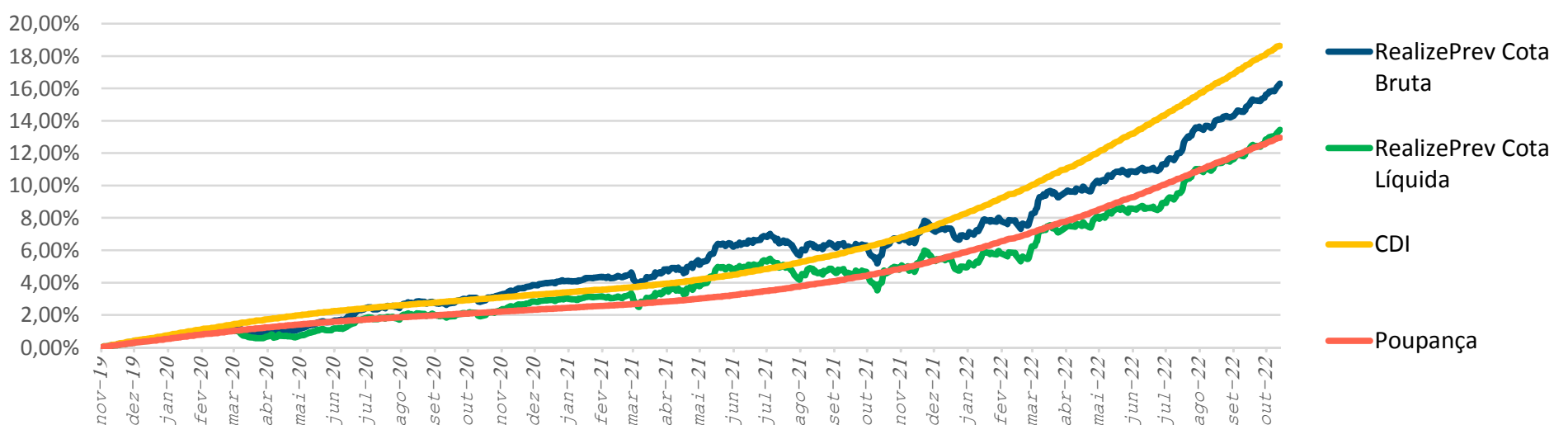
Exterior

No exterior a alta da inflação continua sendo motivo de preocupações. Questões políticas e a continuidade das discussões sobre a condução da política monetária foram destaques. No Reino Unido, após a repercussão negativa do novo pacote econômico, a primeira-ministra renunciou ao cargo 45 dias após sua posse. O Banco Central Europeu elevou as taxas de juros em 75 bps elevando-as para o patamar de 2%. Na China, a manutenção do terceiro mandato do atual presidente reforçaram a política de Covid-Zero, os planos de isolamento do país e de promover a intervenção estatal para atingir as metas de crescimento.



RealizePrev em números

Rentabilidade Acumulada (%)



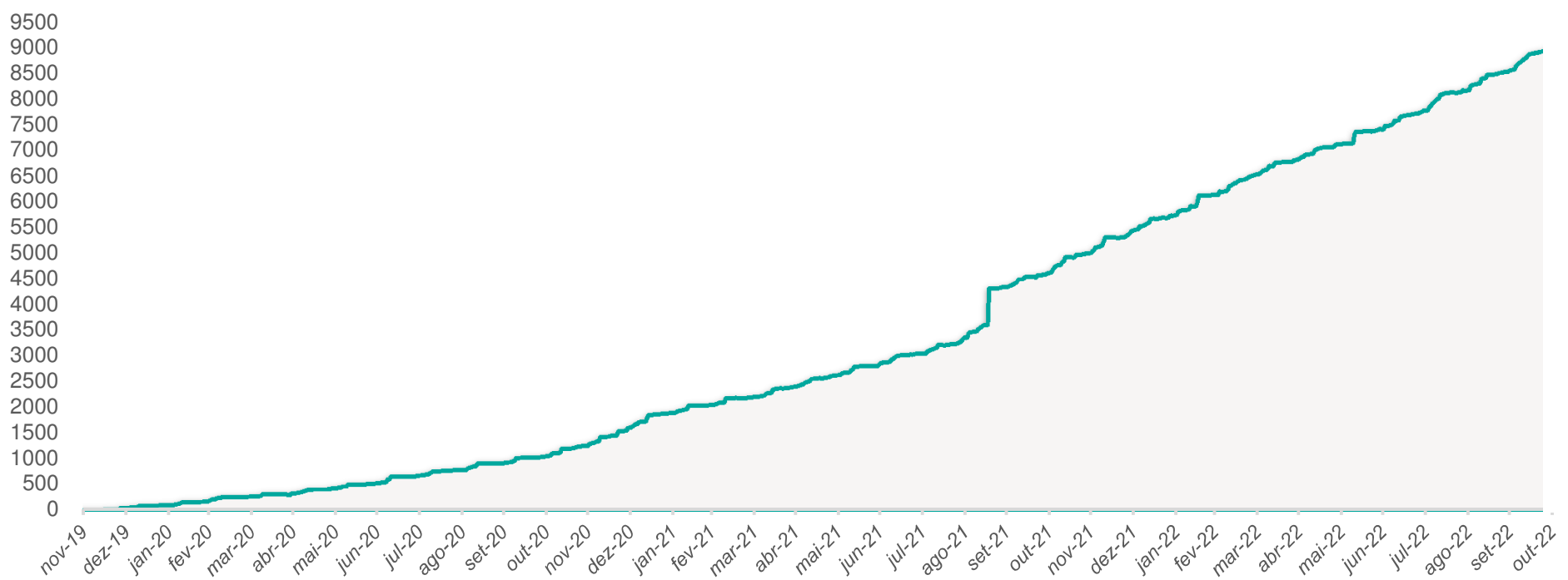
Rentabilidade x CDI | Últimos 12 meses

	Investimentos	Cota	CDI	Poupança	Investimentos (% do CDI)	Cota (% do CDI)	Investimentos (% da Poupança)
out 2022	1,2495%	1,1973%	1,0207%	0,7184%	122,42%	117,31%	173,94%
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%

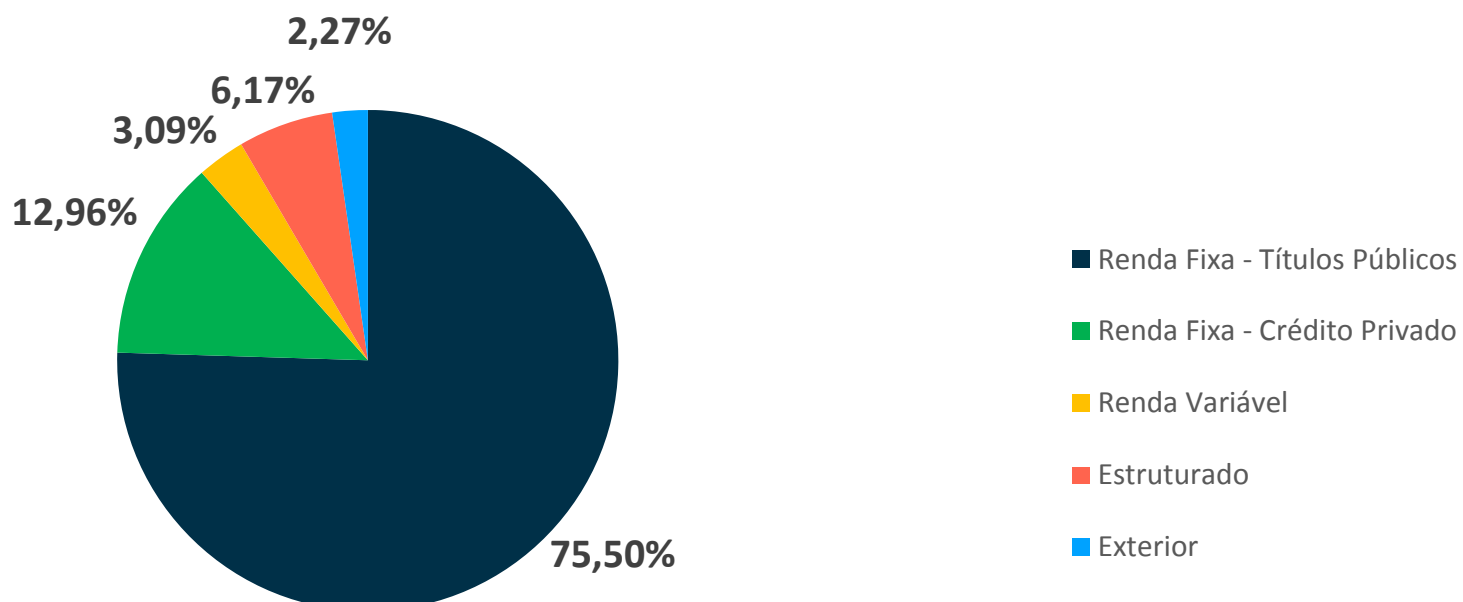
Acumulado	Investimentos	Cota	CDI	Poupança	Investimentos (% do CDI)	Cota (% do CDI)	Investimentos (% da Poupança)
2022	8,3250%	7,5573%	10,0020%	6,9685%	83,23%	75,56%	119,47%
2021	3,2504%	2,4963%	4,3950%	3,1453%	73,96%	56,80%	103,34%
2020	3,4654%	2,4991%	2,7677%	1,9918%	125,21%	90,30%	173,99%
Início *	16,2993%	13,4506%	18,6394%	12,9527%	87,45%	72,16%	125,84%

* Início em novembro/2019.

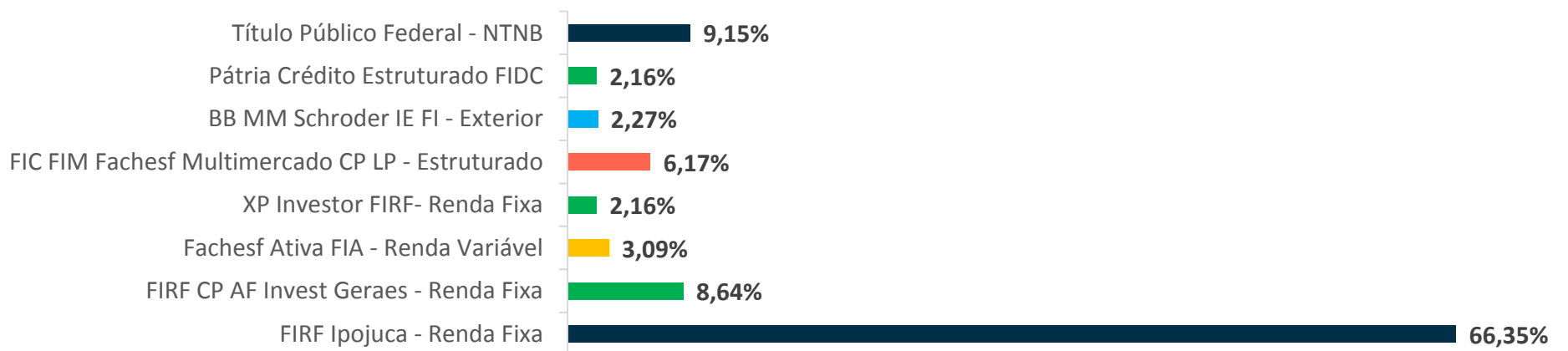
Evolução do Patrimônio (R\$ mil)



Alocação por segmento

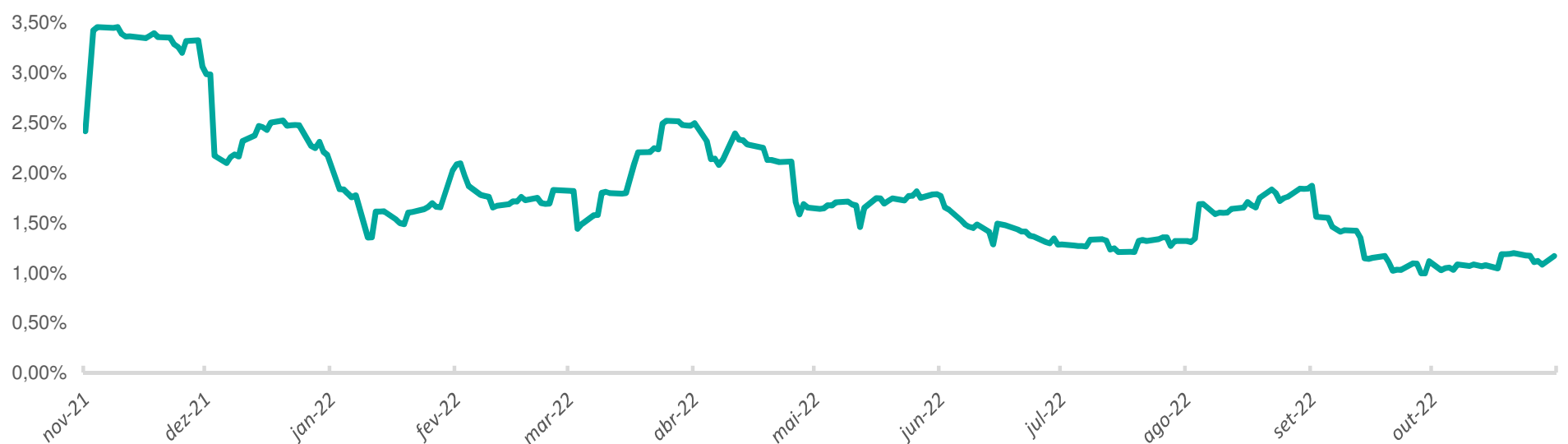


Ativos investidos



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 31/10/2022	R\$ 8.989.840,56
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