

Informativo FIPECqPREV



CENÁRIO ECONÔMICO FINANCEIRO

Verificou-se no mês de junho uma forte volatilidade no mercado financeiro global. Nesse contexto, os movimentos de bancos centrais por todo o mundo de elevação nas taxas de juros e as crescentes preocupações com uma possível recessão global tomaram a atenção dos investidores. Como exemplo, vide o resultado do S&P 500, índice que mede o desempenho das 500 maiores empresas listadas nos

Estados Unidos, apresentou uma desvalorização de 8,4% no mês.

No ambiente doméstico, a combinação de indicativos de uma deterioração fiscal, com a aprovação de pacotes de benefícios sociais pelo Congresso e a continuidade do ciclo de alta na taxa básica de juros (SELIC), que teve mais uma alta em junho anunciada pelo Comitê de Política Monetária (COPOM), de 12,75% para 13,25% ao ano, trouxe forte aversão ao risco aos investidores que monitoram os impactos destas medidas para economia a médio e longo prazo.

No mercado de renda variável (Bolsa de Valores), o mês de junho assistiu a maior queda mensal do Ibovespa desde o início da pandemia, representada por expressivos 11,50%, encerrando, portanto, o primeiro semestre de 2022 com queda de 5,99%. No mercado de renda fixa, o CDI somou alta de 1,01% no mês e 5,39% no acumulado do ano, enquanto o IMA-B (índice que mede o desempenho dos títulos públicos indexados à inflação) apresentou queda de 0,36% no mês e alta de 4,34% no ano.





BALANÇO FIPECqPREV

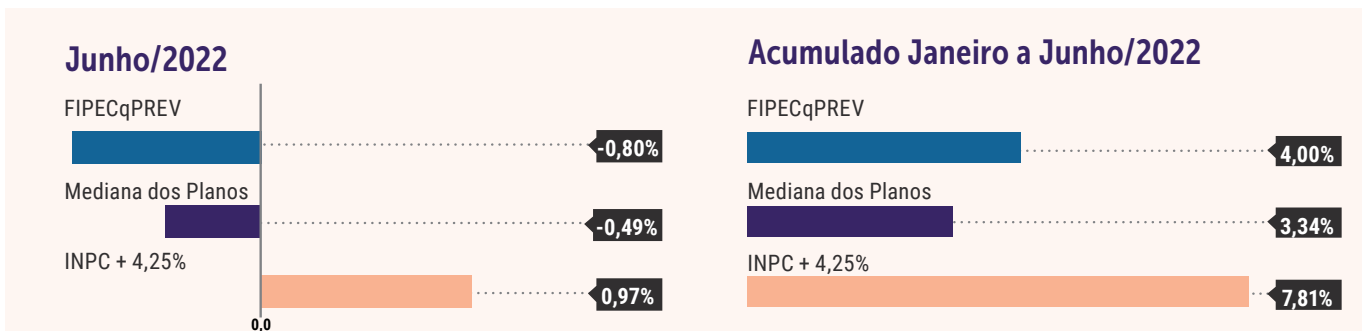
Em junho/22, o Plano FIPECqPREV apresentou superávit acumulado de R\$ 10.142 mil, representando um decréscimo de 1,05% em relação ao observado em maio/22.



| | | | | EM REAIS | | | |
|-------------------------------|-------------------|-------------------|---------------|---|-------------------|-------------------|----------------|
| ATIVO | JUNHO 2022 | MAIO 2022 | % | PASSIVO | JUNHO 2022 | MAIO 2022 | % |
| Disponível | 99.625 | 96.261 | 3,50% | Exigível Operacional | 302.770 | 76.702 | 294,73% |
| Realizável | 51.798.570 | 52.736.993 | -1,78% | Gestão Previdencial | 283.262 | 51.082 | 454,52% |
| Gestão Previdencial | 36.152 | 35.958 | 0,54% | Gestão Administrativa | 0 | 0 | 0,00% |
| Gestão Administrativa | 596.907 | 610.234 | -2,18% | Investimentos | 19.508 | 25.620 | -23,86% |
| Investimentos | 51.165.511 | 52.090.800 | -1,78% | Exigível Contingencial | 0 | 0 | 0,00% |
| Títulos Públicos | 28.663.781 | 28.415.222 | 0,87% | Gestão Previdencial | 0 | 0 | 0,00% |
| Créditos Privados e Depósitos | 0 | 0 | 0,00% | Gestão Administrativa | 0 | 0 | 0,00% |
| Ações | 0 | 0 | 0,00% | Investimentos | 0 | 0 | 0,00% |
| Fundos de Investimentos | 22.442.862 | 23.614.781 | -4,96% | Patrimônio Social | 51.595.425 | 52.756.551 | -2,20% |
| Investimentos Imobiliários | 0 | 0 | 0,00% | Patrimônio de Cobertura do Plano | 50.998.519 | 52.146.317 | -2,20% |
| Empréstimos | 58.869 | 60.796 | -3,17% | Provisões Matemáticas | 40.856.495 | 41.897.056 | -2,48% |
| Outros Realizáveis | 0 | 0 | 0,00% | Benefícios Concedidos | 5.131.690 | 5.135.417 | -0,07% |
| Permanente | 0 | 0 | 0,00% | Benefícios a Conceder | 35.724.805 | 36.761.639 | -2,82% |
| Imobilizado | 0 | 0 | 0,00% | Equilíbrio Técnico | 10.142.024 | 10.249.261 | -1,05% |
| Intangível | 0 | 0 | 0,00% | Superávit Acumulado | 10.142.024 | 10.249.261 | -1,05% |
| | | | | Déficit Acumulado | 0 | 0 | 0,00% |
| | | | | Fundos | 596.907 | 610.234 | -2,18% |
| | | | | Fundos Previdenciais | 0 | 0 | 0,00% |
| | | | | Fundos Administrativos | 596.907 | 610.234 | -2,18% |
| | | | | Fundos dos Investimentos | 0 | 0 | 0,00% |
| TOTAL DO ATIVO | 51.898.195 | 52.833.254 | -1,77% | TOTAL DO PASSIVO | 51.898.195 | 52.833.254 | -1,77% |

RENTABILIDADE DO PLANO FIPECqPREV

A rentabilidade do Plano¹ FIPECqPREV no mês de junho/22 foi de -0,80%, sendo inferior à mediana de -0,49% dos planos de contribuição definida (CD) da amostra de dados da Consultoria Aditus², e inferior à meta de rentabilidade (INPC + 4,25%), que ficou em 0,97%. No acumulado do ano (janeiro a junho), a rentabilidade do FIPECqPREV soma 4,00%, contra 3,34% da mediana dos planos CD e 7,81% da referida meta.



1 Rentabilidade deduzida do custeio.

2 A amostra compreende aos dados de 120 EFPC clientes da ADITUS e que juntas totalizam aproximadamente R\$ 301 bilhões em ativos mobiliários, distribuídos em 369 planos de benefícios, sendo 140 de Contribuição Definida (CD).



RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO PLANO FIPEC₉PREV POR SEGMENTO

Confira na tabela abaixo o detalhamento do resultado da Carteira dos Investimentos do FIPEC₉PREV, distribuídos por segmentos:

| ATIVOS | RENTABILIDADE (%) | | | | | | ACUM. NO ANO |
|--|-------------------|---------------|---------------|---------------|-------------|---------------|---------------|
| | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | |
| INVESTIMENTOS | 1,18 | 0,27 | 2,06 | 0,01 | 1,42 | (0,76) | 4,22 |
| SEGMENTO DE RENDA FIXA | 0,95 | 1,12 | 1,76 | 1,70 | 1,25 | 0,92 | 7,94 |
| NOTAS DO TESOURO NACIONAL - NTN-B | 0,96 | 1,17 | 1,89 | 1,87 | 1,29 | 0,87 | 8,31 |
| FUNDOS DE RENDA FIXA - FIRF | 0,80 | 0,79 | 1,01 | 0,88 | 1,15 | 1,08 | 5,84 |
| SEGMENTO DE INVEST. ESTRUTURADOS | 0,14 | 0,49 | (2,10) | 0,49 | 1,01 | 0,75 | 0,75 |
| FUNDOS DE INVEST. EM PARTICIPAÇÕES - FIP | (0,26) | (0,26) | (13,28) | (0,36) | 0,00 | 0,66 | (13,47) |
| FUNDOS DE INVEST. MULTIMERCADO - FIM | 0,32 | 0,83 | 2,15 | 0,82 | 1,39 | 1,11 | 6,80 |
| SEGMENTO DE OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES | 1,53 | 0,13 | 1,40 | 1,64 | 2,31 | 1,67 | 8,98 |
| OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES | 1,53 | 0,13 | 1,40 | 1,64 | 2,31 | 1,67 | 8,98 |
| FUNDO EXCLUSIVO BÚSSOLA FIC FIM CP | 2,16 | (2,12) | 4,27 | (4,86) | 1,98 | (6,47) | (5,39) |
| FUNDOS DE INVEST. EM RENDA FIXA - RF | 0,77 | 0,84 | 1,31 | 1,07 | 1,04 | 0,99 | 6,17 |
| FUNDOS DE INVEST. EM AÇÕES - FIA | 4,72 | (3,52) | 5,87 | (8,67) | 2,82 | (12,09) | (11,70) |
| FUNDOS DE INVEST. MULTIMERCADO - FIM | 0,91 | 0,63 | 2,91 | 1,23 | 1,39 | (0,35) | 6,93 |
| FUNDOS DE INVEST. NO EXTERIOR | (11,40) | (4,99) | (1,67) | (5,37) | (4,02) | (4,07) | (27,93) |

| ÍNDICES | JAN | FEV | MAR | ABR | MAI | JUN | ACUM. NO ANO |
|---|------|------|------|---------|------|---------|--------------|
| META DE RENTABILIDADE (INPC + 4,25% a.a.) | 1,02 | 1,35 | 2,06 | 1,39 | 0,80 | 0,97 | 7,81 |
| INPC | 0,67 | 1,00 | 1,71 | 1,04 | 0,45 | 0,62 | 5,61 |
| CDI | 0,73 | 0,75 | 0,92 | 0,83 | 1,03 | 1,01 | 5,40 |
| IBOVESPA | 6,98 | 0,89 | 6,06 | (10,10) | 3,22 | (11,50) | (5,99) |



COMPARATIVO COM OS FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE PREVIDÊNCIA LISTADOS NA ANBIMA

Segundo dados da Anbima e consolidados pela Consultoria Aditus, o plano FIPECqPREV superou a mediana das rentabilidades dos fundos de investimentos de previdência, normalmente vinculados aos Planos Geradores de Benefício Livre (PGBL), que apresentaram 3,92% de retorno no acumulado do ano até junho, considerando todas as categorias Anbima, contra 4,00% do FIPECqPREV.



Dados Estatísticos da Indústria de Fundos
Considerando todos os fundos listados na Anbima
Data base: 30/06/2022



| Categorias (Anbima) | Resultados | Rentabilidades Anuais (%) | | | | | | | | | | | | | | Rent | Vol |
|---------------------------------|--------------|---------------------------|-------|-------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|-------|------|--------|-------|-------|
| | | 2008 | 2009 | 2010 | 2011 | 2012 | 2013 | 2014 | 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | | |
| Previdência Ações | Nº de Fundos | 7 | 11 | 11 | 15 | 18 | 22 | 30 | 28 | 31 | 30 | 29 | 38 | 73 | 170 | 269 | |
| | Média | -40,33 | 73,05 | 3,80 | -15,32 | 9,36 | -6,71 | -3,57 | -11,60 | 32,36 | 27,28 | 16,63 | 37,63 | 3,31 | -14,41 | -9,96 | 21,12 |
| | Mediana | -43,14 | 74,00 | 2,25 | -16,90 | 9,65 | -5,76 | -3,03 | -11,94 | 34,80 | 26,31 | 16,28 | 36,00 | 2,53 | -14,85 | -9,39 | 20,56 |
| Previdência Balanceados > 30 | Nº de Fundos | 51 | 61 | 70 | 80 | 88 | 95 | 101 | 93 | 91 | 85 | 85 | 87 | 81 | 86 | 91 | |
| | Média | -13,12 | 31,97 | 4,89 | -2,43 | 7,69 | -3,10 | 2,89 | -0,10 | 21,98 | 15,13 | 8,97 | 17,37 | 2,30 | -5,44 | -0,36 | 8,94 |
| | Mediana | -14,56 | 31,80 | 4,62 | -3,14 | 7,33 | -3,02 | 3,02 | -0,17 | 21,98 | 15,41 | 9,02 | 16,35 | 2,73 | -4,93 | -0,08 | 8,57 |
| Previdência Balanceados Até 15 | Nº de Fundos | 30 | 31 | 33 | 37 | 37 | 42 | 45 | 43 | 44 | 44 | 46 | 47 | 47 | 47 | 47 | |
| | Média | 3,43 | 14,04 | 6,99 | 6,33 | 7,53 | 2,54 | 7,32 | 7,77 | 15,36 | 10,52 | 5,97 | 8,95 | 2,06 | 0,28 | 3,45 | 2,29 |
| | Mediana | 3,03 | 14,39 | 7,09 | 6,33 | 7,39 | 2,59 | 7,39 | 7,94 | 15,21 | 10,61 | 5,97 | 8,21 | 1,92 | 0,49 | 3,47 | 4,47 |
| Previdência Balanceados 15 a 30 | Nº de Fundos | 44 | 48 | 52 | 56 | 59 | 65 | 68 | 70 | 66 | 63 | 65 | 71 | 70 | 70 | 70 | |
| | Média | -3,69 | 20,56 | 6,28 | 2,70 | 7,52 | 0,08 | 5,76 | 5,06 | 17,65 | 11,98 | 7,05 | 11,61 | 2,26 | -1,48 | 2,11 | 4,30 |
| | Mediana | -3,75 | 20,59 | 6,19 | 2,89 | 7,44 | 0,11 | 5,93 | 4,79 | 17,38 | 11,92 | 6,84 | 10,99 | 2,31 | -1,38 | 2,22 | 4,47 |
| Previdência Data Alvo | Nº de Fundos | 13 | 28 | 28 | 31 | 31 | 31 | 31 | 37 | 40 | 63 | 42 | 32 | 32 | 30 | 29 | |
| | Média | -10,33 | 32,37 | 10,31 | 1,25 | 17,10 | -8,94 | 6,62 | 2,19 | 22,20 | 11,98 | 8,82 | 16,88 | 3,50 | -1,91 | 1,95 | 4,44 |
| | Mediana | -12,51 | 35,38 | 10,61 | -0,32 | 18,64 | -10,25 | 6,67 | 0,49 | 22,72 | 11,92 | 9,07 | 19,79 | 3,45 | -0,54 | 2,27 | 3,44 |
| Previdência Multimercados | Nº de Fundos | 39 | 64 | 89 | 120 | 168 | 228 | 341 | 377 | 472 | 523 | 599 | 741 | 1020 | 1380 | 1919 | |
| | Média | 2,11 | 17,83 | 8,72 | 7,08 | 11,10 | 1,69 | 9,00 | 10,25 | 15,69 | 11,43 | 7,70 | 11,95 | 3,72 | -0,39 | 2,45 | 5,60 |
| | Mediana | 6,23 | 13,95 | 8,81 | 8,75 | 10,04 | 2,92 | 10,01 | 12,01 | 14,17 | 10,83 | 7,15 | 10,11 | 3,42 | 0,52 | 3,73 | 3,60 |
| Previdência Renda Fixa | Nº de Fundos | 158 | 176 | 198 | 227 | 256 | 298 | 359 | 392 | 462 | 492 | 550 | 604 | 673 | 717 | 815 | |
| | Média | 10,48 | 9,21 | 9,44 | 10,82 | 10,00 | 3,34 | 10,09 | 10,93 | 15,54 | 10,17 | 7,44 | 9,83 | 3,75 | 2,26 | 4,78 | 1,80 |
| | Mediana | 10,53 | 9,16 | 8,97 | 10,95 | 8,60 | 5,33 | 10,04 | 11,41 | 13,88 | 9,96 | 6,28 | 6,60 | 2,75 | 2,99 | 5,16 | 0,57 |
| Todas as Categorias (Anbima) | Nº de Fundos | 342 | 419 | 481 | 566 | 657 | 781 | 975 | 1040 | 1206 | 1277 | 1416 | 1620 | 1996 | 2500 | 3240 | |
| | Média | 1,73 | 18,72 | 8,06 | 5,84 | 9,93 | 0,99 | 8,00 | 8,25 | 16,85 | 11,61 | 7,80 | 12,05 | 3,57 | -0,80 | 1,89 | 6,10 |
| | Mediana | 7,23 | 13,49 | 8,14 | 8,57 | 8,63 | 2,61 | 9,22 | 10,72 | 14,56 | 10,73 | 6,86 | 9,45 | 2,99 | 0,73 | 3,92 | 3,41 |

* Rentabilidade até Junho de 2022

Fonte Primária Anbima, secundária Economática



DESTAQUE FIPECq

RETORNO DOS ATENDIMENTOS PRESENCIAIS

A FIPECq Previdência retorna com o atendimento presencial aos Participantes e Assistidos. Seguindo todos os protocolos de segurança e recomendações dos órgãos de saúde, os atendimentos voltaram a acontecer nas sedes da FIPECq Previdência no Rio de Janeiro e em Brasília.