

Resultado dos Investimentos Informativo de Rentabilidade / outubro de 2022

Plano Previdencial BD



Cenário Econômico

O mês de outubro foi de bastante volatilidade nos mercados financeiros globais, como tem sido constante nos últimos meses. A inflação global ao redor do mundo continua sendo a principal preocupação, pressionando os Bancos Centrais de diversos países a realizar movimentos nas taxa de juros. As dívidas quanto à intensidade e duração dos apertos monetários e seus impactos na desaceleração da economia ainda permanecem.

No Brasil, na contramão dos movimentos dos Bancos Centrais do restante do mundo, o COPOM decidiu manter inalterada a taxa de juros em 13,75%. Apesar do segundo turno da eleição presidencial, a bolsa e o real tiveram performances positivas mesmo em um ambiente doméstico de elevada volatilidade.

Resultados das Estratégias de Investimentos

Renda Fixa

O segmento de Renda Fixa no mês apresentou retorno de 0,61% abaixo da Taxa SELIC que fechou em 1,02%. Contribuíram para o desempenho positivo os fundos exclusivos Darwin Liquidez e Caixa com retorno de 1,06% e 1,27%, respectivamente. Já a carteira própria de títulos públicos apresentou resultado positivo de 0,56%, devido à correção nos títulos indexados pelo IPCA que foi negativo no mês em 0,29%. No ano a rentabilidade do segmento é de 9,58% versus 10% da Taxa Selic.

Estruturado (FIP's)

A carteira do segmento de estruturado do Plano Previdencial BD é composta por nove FIP's - Fundos de Investimento em Participações, que no mês apresentou retorno negativo de 0,52% e no acumulado do ano o resultado encontra-se positivo em 6,84%.

A DESBAN informa que essas estratégias possuem foco em longo prazo e, portanto, a consistência de retorno positivo tende a ser vista com o passar do tempo.

Imobiliário

No consolidado, o segmento no mês apresentou uma rentabilidade de 0,35%. Atualmente a DESBAN possui em sua carteira 500 vagas no Estacionamento do LifeParking do Ed. Life Center.

Renda Variável (Fundo Exclusivo)

A volatilidade das bolsas foi grande ao longo do mês de outubro, mas no fim das contas, tanto no Brasil quanto no exterior, o saldo foi positivo. O Ibovespa fechou em alta de 5,45% e as principais bolsas globais também tiveram boa performance, com destaque para o S&P 500 que subiu mais de 8%.

O Fundo Exclusivo de Renda Variável da Desban teve sua rentabilidade positiva em 8,07%. Desde o seu início acumula retorno de 14,56% contra 11,73% do Ibovespa no mesmo período. O Fundo investe, conforme estratégia do gestor em Renda Variável Brasil e em Renda Variável Global (ativos atrelados ao dólar). Ressaltamos que a Desban junto com seus gestores realiza uma gestão ativa e prudencial, com foco no longo prazo.

Exterior (Fundo Exclusivo)

A DESBAN possui um Fundo Exclusivo que anteriormente comprava cotas de estratégias de multimercados, crédito e exterior. Com o desfazimento das cotas dos fundos de multimercados e crédito e, conseqüente alteração do regulamento, o Fundo Exclusivo Darwin Evolução FIC FIM IE ficou classificado no segmento de investimentos no exterior onde compra cotas de fundos com foco principal nos Hedge Funds e fundos alternativos Offshore.

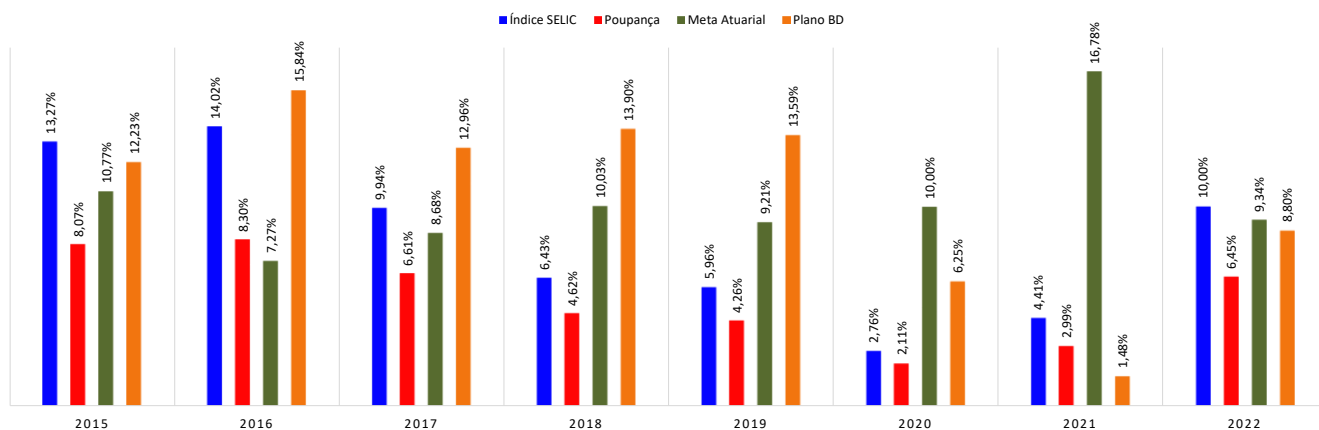
O Fundo no mês apresentou rentabilidade de positiva de 2,04% e no ano acumula um retorno de 3,66%.

Operações com Participantes

No mês o segmento apresentou uma rentabilidade de 1,02% acima do seu índice de referência (IPCA+9,25% a.a.) que apresentou 0,45%.

A DESBAN informa que essa estratégia possui foco em longo prazo e, portanto, a consistência de retorno positivo tende a ser vista com o passar do tempo.

Rentabilidade Ano a Ano

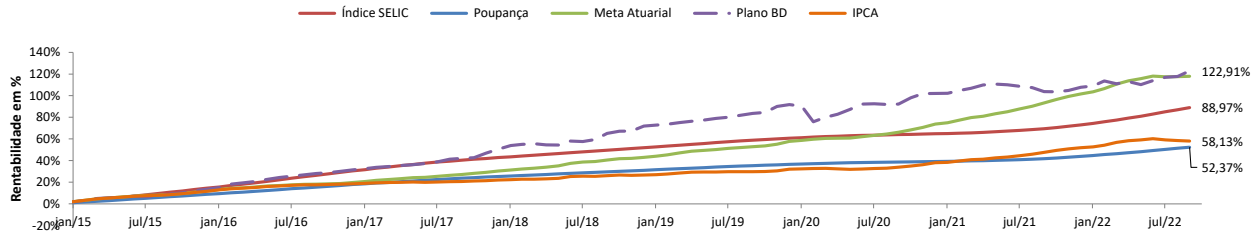


Resultado dos Investimentos Informativo de Rentabilidade / outubro de 2022

Plano Previdencial BD



Rentabilidade Acumulada



Rentabilidade Acumulada por Segmento

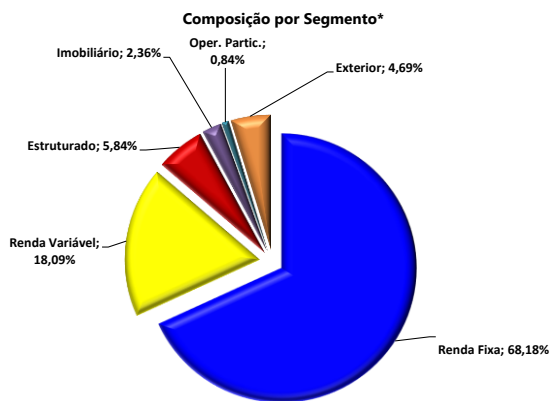
Segmento	Mês Atual	No Ano	12 meses	24 meses
Renda Fixa	0,61	9,58	12,66	28,31
Renda Variável	8,07	8,13	6,41	12,13
Estruturado	-0,52	6,84	3,33	-0,47
Exterior	2,04	3,59	-	-
Imobiliário	0,35	4,32	6,30	-11,58
Operações com Participantes	0,53	16,31	20,85	47,15
Plano BD	2,34	8,80	9,41	15,96
Meta Atuarial	0,13	9,34	12,75	31,08
IBX	5,57	10,25	11,78	23,41

Rentabilidade Acumulada em Diferentes Períodos

Período	Plano (%)	Meta Atuarial*	% da Meta
Mês atual	2,34	0,13	1814,46
No Ano	8,80	9,34	94,25
Últimos 12 meses	9,41	12,75	73,78
Últimos 24 meses	15,96	31,08	51,34
Últimos 36 meses	21,44	42,59	50,35
Últimos 48 meses	34,96	55,13	63,42
Últimos 60 meses	56,87	71,47	79,56
Desde Jan/2015	122,91	117,95	104,21

Obs.: *Meta Atuarial em 2016: IPCA+5,72%a.a.; Meta Atuarial em 2017: IPCA+5,72%a.a.; Meta Atuarial em 2018: IPCA+5,75%a.a.; Meta Atuarial em 2019: IPCA+5,75%a.a.; Meta Atuarial em 2020: IPCA+5,45%a.a.; Meta Atuarial em 2021: IPCA+5,45%a.a.; Meta Atuarial em 2022: IPCA+5,16%a.a.

Composição dos Investimentos

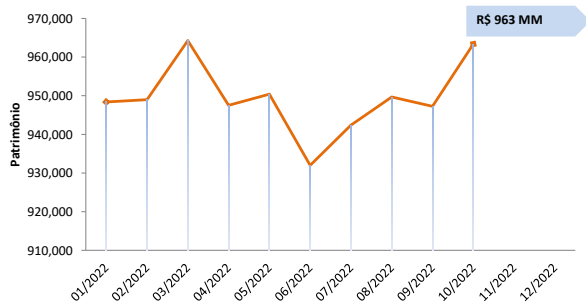


* Os dados informados da composição por segmento contempla as informações do Relatório de Compliance fechado do mês anterior da Consultoria Aditus.

Composição Carteira por Ativos

Ativos	Valor	% PL	Rent. Mês	Rent. Acum. Ano
NTN-B	529.144.634,65	54,93%	0,56%	9,96% #
Debênture	3.538.142,43	0,37%	-6,31%	-27,39%
FIDC Saneago	210.275,91	0,02%	1,27%	16,74%
Darwin Liquidez FIC FIM CP	22.128.315,21	2,30%	1,06%	10,39%
Darwin Caixa FIC FIM CP	59.230.776,93	6,15%	1,27%	9,36%
Darwin Seleção FIC FIA	239.644.140,23	24,88%	8,07%	8,13%
Darwin Evolução FIC FIM	25.375.410,70	2,63%	2,04%	3,66%
FIP Lacan Florestal	7.628.332,28	0,79%	-0,08%	12,24%
Kinea FIP Multiestratégia	10.581.835,58	1,10%	0,23%	29,33%
FIP Patria Real State II	493.718,21	0,05%	-7,02%	-33,81%
FIP Patria Real State III	1.784.141,62	0,19%	-7,29%	-32,79%
FIP BTG Infraestrutura	593.135,89	0,06%	-0,68%	-23,55%
P2 Brasil Infra. FIQ FIP	18.652.458,42	1,94%	-1,42%	23,15%
FIP Minas Gerais	10.726.850,46	1,11%	1,44%	-3,55%
FIP Malbec	-	-	-	-
FIQ FIP Neo Mezanino III	3.936.513,05	0,41%	-0,10%	0,50%
Oper. Participantes	7.972.271,50	0,83%	0,53%	16,31%
Imóveis	21.679.942,79	2,25%	0,35%	4,32%
Total Plano	963.320.895,86	100,00%	2,34%	8,80%

Evolução dos Investimentos do Plano no Ano



Limites de Alocação por Segmento de Aplicação - PI/2022

