

Informativo FIPECqPREV



CENÁRIO ECONÔMICO- -FINANCEIRO

O mês de junho/23 consolidou a perspectiva positiva dos agentes de mercado para o cenário econômico brasileiro de médio prazo, encerrando o 1º semestre do ano com valorização nos principais índices de mercado financeiro e de capitais. O arrefecimento da inflação e a revisão do regime de metas de inflação pelo Comitê de Monetário Nacional (CMN), as perspectivas de corte na taxa básica de juros (Selic) já no começo do 2º semestre, e, no campo político, avanços no congresso acerca dos trâmites da Reforma Tributária e do Novo Arcabouço Fiscal são

apontados como os principais fatores que contribuíram para o bom desempenho na primeira metade do ano de 2023.

Nesse contexto, o principal índice de ações do mercado de renda variável do Brasil, o Ibovespa, ampliou a tendência positiva verificada desde abril e rentabilizou 9% no mês de junho, levando a fechar o semestre com 7,61% de ganhos. No mercado de renda fixa, o CDI somou alta de 1,07% em junho, levando o acumulado do ano para 6,50%, enquanto o IMA-B, que acompanha os títulos públicos indexados à inflação, subiu 2,39% no mês, com valorização de 11,37% no ano até junho.

No ambiente internacional, o S&P 500, que replica o comportamento das maiores empresas listadas nos Estados Unidos, também apresentou ganho de 6,47% no mês de junho e 15,91% no ano na variação medida em dólar. No câmbio, verificou-se no dólar queda de 5,43% no mês de junho, levando o acumulado do ano para uma desvalorização de 7,64% frente ao real.



BALANÇO FIPECqPREV

Em junho/23, o Plano FIPECqPREV apresentou superávit acumulado de R\$ 11.022 mil, representando um acréscimo de 1,93% em relação ao observado em maio/23 de R\$ 10.814 mil.

RESULTADO DO PLANO FIPECqPREV

ATIVO	JUN./2023	MAI./2023	%
Disponível	46.669,51	57.193,98	-18,40%
Realizável	56.424.494,81	55.496.241,47	1,67%
Gestão Previdencial	34.593,62	34.472,54	0,35%
Gestão Administrativa	232.604,62	216.404,56	7,49%
Investimentos	56.157.296,57	55.245.364,37	1,65%
Títulos Públicos	27.133.986,10	27.007.097,95	0,47%
Fundos de Investimentos	28.883.719,33	28.096.676,93	2,80%
Empréstimos	139.591,14	140.911,19	-0,94%
Outros Realizáveis	0,00	678,30	-100,00%
TOTAL DO ATIVO	56.471.164,32	55.553.435,45	1,65%

PASSIVO	JUN./2023	MAI./2023	%
Exigível Operacional	87.163,46	129.310,36	-32,59%
Gestão Previdencial	62.730,91	105.562,67	-40,57%
Investimentos	24.432,55	23.747,69	2,88%
Patrimônio Social	56.384.000,86	55.424.125,09	1,73%
Patrimônio de Cobertura do Plano	56.151.396,24	55.207.720,53	1,71%
Provisões Matemáticas	45.128.643,81	44.393.332,23	1,66%
Benefícios Concedidos	5.114.762,80	5.107.966,90	0,13%
Benefícios a Conceder	40.013.881,01	39.285.365,33	1,85%
Equilíbrio Técnico	11.022.752,43	10.814.388,30	1,93%
Superávit Acumulado	11.022.752,43	10.814.388,30	1,93%
Fundos	232.604,62	216.404,56	7,49%
Fundos Administrativos	232.604,62	216.404,56	7,49%
TOTAL DO PASSIVO	56.471.164,32	55.553.435,45	1,65%

RENTABILIDADE DO PLANO FIPECqPREV

A rentabilidade líquida¹ do Plano FIPECqPREV no mês de junho/23 foi de 1,56%, superior à mediana de 1,52% das rentabilidades dos planos de contribuição definida (CD) da amostra² de dados da Consultoria Aditus e à meta de rentabilidade (INPC + 4,25% a.a.), que ficou em 0,25% no mês. No acumulado do ano, a rentabilidade do FIPECqPREV acumula 5,67% contra 6,19% da mediana dos planos CD e 4,84% da meta de rentabilidade.

Junho/2023

FIPECq PREV



Mediana dos Planos



INPC + 4,25%a.a.



Acumulado 2023

FIPECq PREV



Mediana dos Planos

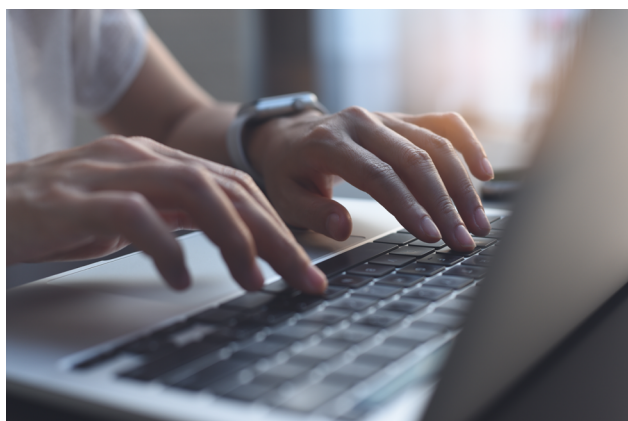


INPC + 4,25%a.a.



¹Rentabilidade deduzida do custeio

²A amostra compreende aos dados de 120 EFPC clientes da Aditus e que juntas totalizam aproximadamente R\$ 307 bilhões em ativos mobiliários, distribuídos em 369 planos de benefícios, sendo 140 de Contribuição Definida (CD).



RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO PLANO FIPECqPREV POR SEGMENTO

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

POSIÇÃO: JUNHO/2023

ATIVOS	RENTABILIDADE BRUTA (%)							RENTABILIDADE/ META DE RENTABILIDADE (%)	
	JAN.	FEV.	MAR.	ABR.	MAI.	JUN.	ACUM. NO ANO	JUN.	NO ANO
RENTABILIDADE TOTAL DOS INVESTIMENTOS	0,96	(0,04)	0,22	1,13	1,90	1,60	5,89	1,35	1,01
SEGMENTO DE RENDA FIXA	1,23	0,95	1,42	0,95	1,29	0,67	6,41	0,42	1,50
NOTAS DO TESOURO NACIONAL - NTN-B	1,23	0,95	1,44	0,95	1,38	0,47	6,27	0,22	1,37
FUNDOS DE RENDA FIXA - FIRF	1,15	0,90	1,17	0,89	1,10	1,08	6,30	0,83	1,40
SEGMENTO DE INVEST. ESTRUTURADOS	(2,81)	0,53	(5,81)	0,97	1,77	(0,25)	(5,67)	(0,50)	(10,02)
FUNDOS DE INVEST. EM PARTICIPAÇÕES - FIP	(0,27)	(0,04)	(37,61)	(0,77)	(0,72)	(10,99)	(45,46)	(11,21)	(47,97)
FUNDOS DE INVEST. MULTIMERCADO - FIM	(3,82)	0,76	1,94	1,39	2,35	1,92	4,47	1,66	(0,35)
SEGMENTO DE OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	1,05	1,32	0,17	1,17	1,17	1,18	6,21	0,93	1,31
OPERAÇÕES COM PARTICIPANTES	1,05	1,32	0,17	1,17	1,17	1,18	6,21	0,93	1,31
FUNDO EXCLUSIVO BÚSSOLA FIC FIM CP	1,21	(3,53)	(1,10)	1,87	4,77	5,34	8,56	5,08	3,55
FUNDOS DE INVEST. EM RENDA FIXA - RF	0,49	0,64	1,00	0,85	1,18	1,12	5,49	0,87	0,62
FUNDOS DE INVEST. EM AÇÕES - FIA	1,89	(6,93)	(3,24)	3,15	9,05	9,49	12,94	9,22	7,73
FUNDOS DE INVEST. MULTIMERCADO - FIM	1,24	(0,52)	0,57	0,42	1,01	1,81	4,58	1,56	(0,25)

ÍNDICES	JAN.	FEV.	MAR.	ABR.	MAI.	JUN.	ACUM. NO ANO
META DE RENTABILIDADE (INPC + 4,25% a.a.)	0,81	1,12	0,99	0,88	0,71	0,25	4,84
INPC	0,46	0,77	0,64	0,53	0,36	(0,10)	2,69
CDI	1,12	0,92	1,17	0,92	1,12	1,07	6,49
IBOVESPA	3,37	(7,49)	(2,91)	2,50	3,74	9,00	7,61



COMPARATIVO COM OS FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE PREVIDÊNCIA LISTADOS NA ANBIMA

Segundo dados da Anbima consolidados pela Consultoria Aditus, a rentabilidade do plano FIPECqPREV não superou a mediana da rentabilidade dos fundos de investimentos de previdência, normalmente vinculados aos Planos Geradores de Benefício Livre (PGBL), que apresentaram 6,06% de retorno no acumulado do ano até junho/23, considerando as categorias balanceadas até 15, contra os referidos 5,67% do FIPECqPREV.

Dados Estatísticos da Indústria de Fundos
Considerando todos os fundos listados na Anbima
Data base: 30/06/2023



Categorias (Anbima)	Resultados	Rentabilidades Anuais (%)													Rent	Vol			
		2009	2010	2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021			2022	2023	
Previdência Ações	Nº de Fundos	11	11	15	18	22	30	28	31	30	29	38	73	170	260	305			
	Média	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	-2,97	9,65	19,74		
	Mediana	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	-0,95	9,39	18,95		
Previdência Balanceados > 30	Nº de Fundos	61	70	80	88	95	101	93	91	85	85	87	81	86	88	88			
	Média	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	6,99	6,63	8,54		
	Mediana	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	7,57	6,62	8,75		
Previdência Balanceados Até 15	Nº de Fundos	31	33	37	37	42	45	43	44	44	46	47	47	47	45	38			
	Média	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	9,42	6,10	2,28		
	Mediana	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	9,71	6,06	4,42		
Previdência Balanceados 15 a 30	Nº de Fundos	48	52	56	59	65	68	70	66	63	65	71	70	70	68	65			
	Média	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	8,27	6,28	4,26		
	Mediana	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	8,75	6,15	4,42		
Previdência Data Alvo	Nº de Fundos	28	28	31	31	31	31	37	40	63	42	32	30	29	29	29			
	Média	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	7,27	6,45	3,46		
	Mediana	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	7,73	6,43	2,13		
Previdência Multimercados	Nº de Fundos	64	89	120	168	228	341	377	472	523	599	741	1020	1380	1827	2253			
	Média	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	8,09	6,74	4,52		
	Mediana	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	9,41	6,17	2,96		
Previdência Renda Fixa	Nº de Fundos	176	198	227	256	298	359	392	462	492	550	604	673	717	807	953			
	Média	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	10,33	7,15	1,70		
	Mediana	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	11,22	6,52	0,71		
Todas as Categorias (Anbima)	Nº de Fundos	419	481	566	657	781	975	1040	1206	1277	1416	1620	1996	2500	3124	3731			
	Média	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	7,73	7,01	5,11		
	Mediana	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	9,44	6,37	2,71		