

Panorama Mensal – Agosto

Comentário do Gestor

Panorama Macroeconômico

O desempenho dos mercados foi marcado por um desempenho positivo de juros e crédito, por outro lado, o mercado acionário viu todos os índices setoriais apresentarem um recuo expressivo. A nível global, observamos um aumento generalizado dos juros de longo prazo nas principais economias. Os núcleos de inflação permanecem elevados, porém acreditamos que há outros fatores empurrando os juros para cima, em especial a discussão a respeito da elevação ou não dos juros reais neutros de longo prazo das economias. Um estudo recente de pesquisadores do Fed apontou para um aumento de 75 pontos-base do juro neutro nos EUA entre 2020 e 2022. Se isso se confirmar, poderemos observar na média uma taxa de juros maior do que no período pós-crise financeira global. No Brasil, os dados do PIB mostraram uma manutenção da taxa de crescimento acima do patamar de longo prazo. A variação anual permanece próxima de 3,2%, enquanto nossa estimativa de crescimento potencial é de 1,6%. No mercado de juros, observamos um aumento dos prêmios de longo prazo. Esse fato coincide com a elevação dos prêmios globais e devido às discussões dentro do governo se a meta de resultado primário de 2024 será ou não elevada. A equipe econômica não deseja essa elevação, enquanto a ala política do PT começa a pressão nos bastidores.



Resultados

Agosto/2023

Plano de Contribuição Definida - Instituído

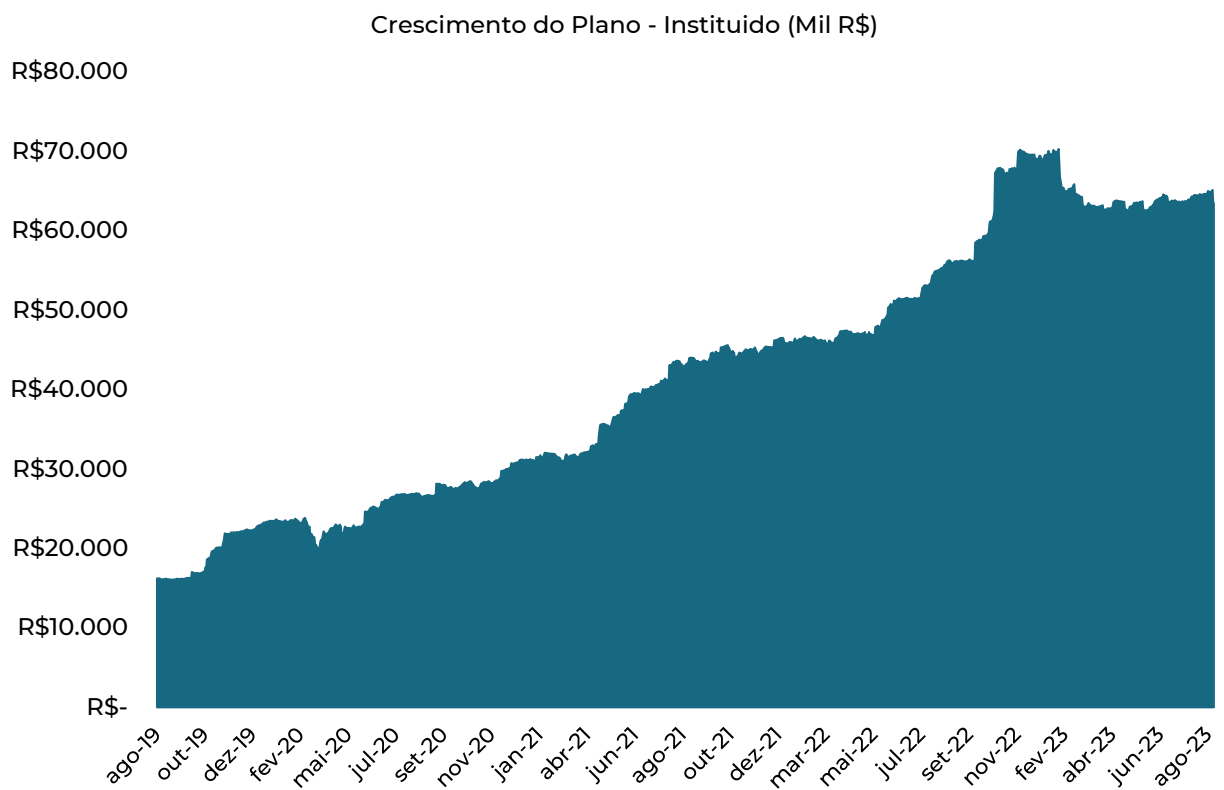
Performance detalhada referente ao mês de agosto

O Plano de Contribuição Definida Instituído teve uma variação de 0,77% no mês, enquanto o CDI performou 1,14% e o benchmark 0,49%.

Plano de Contribuição Definida - Instituído			
	Mês	Ano	12 M
ANABBPREV - Instituído	0,77%	10,22%	12,18%
INPC + 3,26%	0,49%	5,02%	7,44%
% do CDI	67,41%	115,23%	89,85%

Crescimento do plano Instituído

O plano apresentou uma variável patrimonial de -1,39% no mês de agosto e 290,48% desde o início.





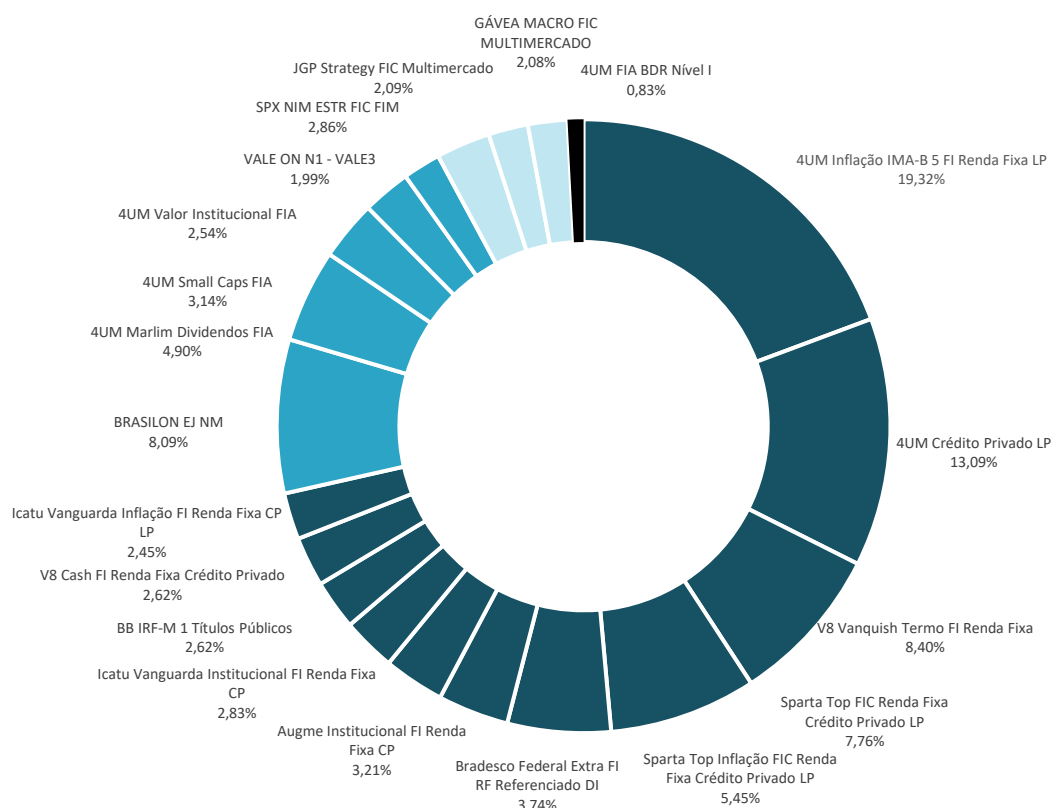
Resultados

Agosto/2023

Composição do Portfólio - Instituído

Carteira Consolidada				
Fundo	Classe	R\$		%
4UM Inflação IMA-B 5 FI Renda Fixa LP	Renda Fixa	R\$	12.110.754,01	19,32%
4UM Crédito Privado LP	Renda Fixa	R\$	8.203.461,79	13,09%
V8 Vanquish Termo FI Renda Fixa	Renda Fixa	R\$	5.262.392,54	8,40%
Sparta Top FIC Renda Fixa Crédito Privado LP	Renda Fixa	R\$	4.863.877,97	7,76%
Sparta Top Inflação FIC Renda Fixa Crédito Privado LP	Renda Fixa	R\$	3.413.785,72	5,45%
Bradesco Federal Extra FI RF Referenciado DI	Renda Fixa	R\$	2.341.534,45	3,74%
Augme Institucional FI Renda Fixa CP	Renda Fixa	R\$	2.012.989,05	3,21%
Icatu Vanguarda Institucional FI Renda Fixa CP	Renda Fixa	R\$	1.775.648,61	2,83%
BB IRF-M 1 Títulos Públicos	Renda Fixa	R\$	1.640.830,85	2,62%
V8 Cash FI Renda Fixa Crédito Privado	Renda Fixa	R\$	1.640.008,54	2,62%
Icatu Vanguarda Inflação FI Renda Fixa CP LP	Renda Fixa	R\$	1.537.911,23	2,45%
BRASILON EJ NM	Renda Variável	R\$	5.072.670,00	8,09%
4UM Marlim Dividendos FIA	Renda Variável	R\$	3.070.913,17	4,90%
4UM Small Caps FIA	Renda Variável	R\$	1.968.299,41	3,14%
4UM Valor Institucional FIA	Renda Variável	R\$	1.592.700,45	2,54%
VALE ON N1 - VALE3	Renda Variável	R\$	1.249.536,00	1,99%
SPX NIM ESTR FIC FIM	Multimercado	R\$	1.790.448,55	2,86%
JGP Strategy FIC Multimercado	Multimercado	R\$	1.310.227,23	2,09%
GÁVEA MACRO FIC MULTIMERCADO	Multimercado	R\$	1.302.012,24	2,08%
4UM FIA BDR Nível I	Investimento no Exterior	R\$	523.334,31	0,83%
Patrimônio Líquido (Somatório da Carteira)		R\$	62.683.336,12	100,00%

*O PL do plano não leva em consideração contas a pagar/receber e saldo em tesouraria.





Resultados

Agosto/2023

Plano de Contribuição Definida - Patrocinado

Performance detalhada referente ao mês de agosto

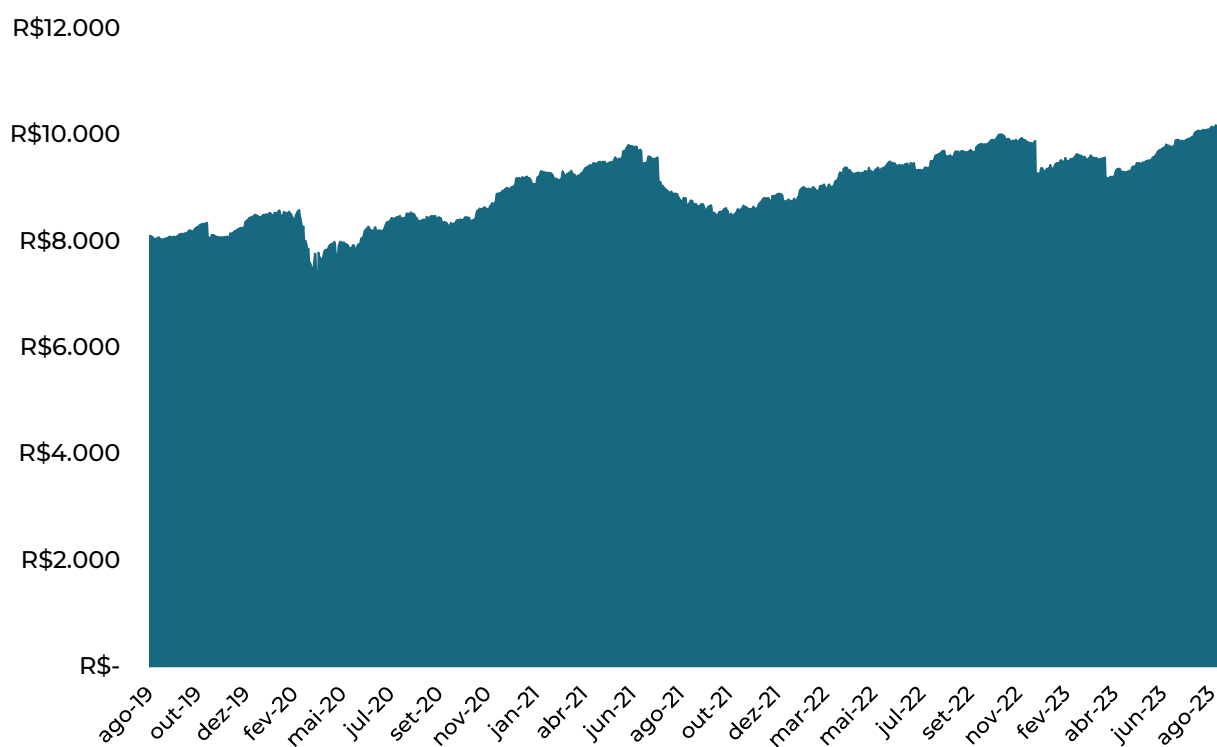
O Plano de Contribuição Definida Patrocinado teve uma variação de 0,78% no mês, enquanto o CDI performou 1,14% e o benchmark 0,49%.

Plano de Contribuição Definida - Patrocinado			
	Mês	Ano	12 M
ANABBPREV - Patrocinado	0,78%	10,22%	12,11%
INPC + 3,26%	0,49%	5,02%	7,44%
% do CDI	68,51%	115,23%	89,34%

Crescimento do Plano Patrocinado

O plano apresentou uma variação patrimonial de 0,79% no mês de agosto e 25,06% desde o início.

Crescimento do Plano - Patrocinado (Mil R\$)





Resultados

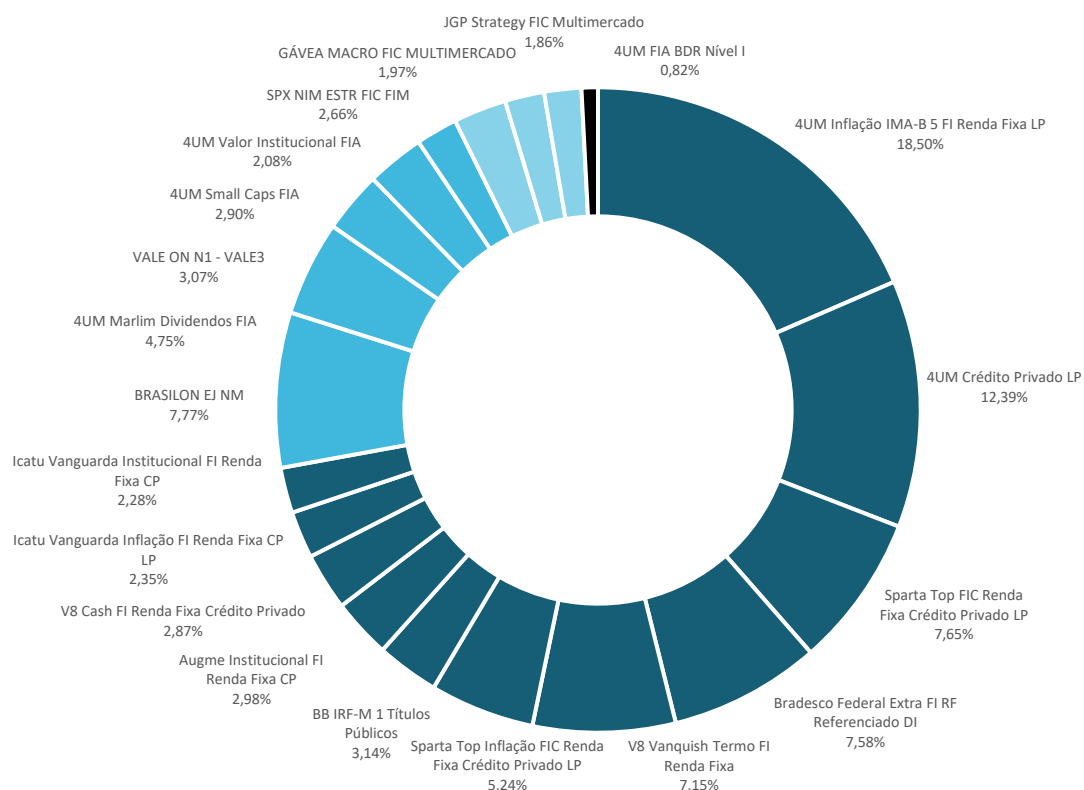
Agosto/2023

Composição do Portfólio - Patrocinado

Carteira Consolidada				
Fundo	Classe	R\$		%
4UM Inflação IMA-B 5 FI Renda Fixa LP	Renda Fixa	R\$	1.884.550,30	18,50%
4UM Crédito Privado LP	Renda Fixa	R\$	1.261.913,43	12,39%
Sparta Top FIC Renda Fixa Crédito Privado LP	Renda Fixa	R\$	779.768,60	7,65%
Bradesco Federal Extra FI RF Referenciado DI	Renda Fixa	R\$	772.200,17	7,58%
V8 Vanquish Termo FI Renda Fixa	Renda Fixa	R\$	727.984,78	7,15%
Sparta Top Inflação FIC Renda Fixa Crédito Privado LP	Renda Fixa	R\$	534.210,83	5,24%
BB IRF-M 1 Títulos Públicos	Renda Fixa	R\$	319.602,89	3,14%
Augme Institucional FI Renda Fixa CP	Renda Fixa	R\$	303.436,52	2,98%
V8 Cash FI Renda Fixa Crédito Privado	Renda Fixa	R\$	292.639,14	2,87%
Icatu Vanguarda Inflação FI Renda Fixa CP LP	Renda Fixa	R\$	239.523,49	2,35%
Icatu Vanguarda Institucional FI Renda Fixa CP	Renda Fixa	R\$	231.877,37	2,28%
BRASILON EJ NM	Renda Variável	R\$	791.280,00	7,77%
4UM Marlim Dividendos FIA	Renda Variável	R\$	484.234,24	4,75%
VALE ON N1 - VALE3	Renda Variável	R\$	312.384,00	3,07%
4UM Small Caps FIA	Renda Variável	R\$	295.570,21	2,90%
4UM Valor Institucional FIA	Renda Variável	R\$	212.246,83	2,08%
SPX NIM ESTR FIC FIM	Multimercado	R\$	270.846,42	2,66%
GÁVEA MACRO FIC MULTIMERCADO	Multimercado	R\$	200.309,58	1,97%
JGP Strategy FIC Multimercado	Multimercado	R\$	189.490,65	1,86%
4UM FIA BDR Nível I	Investimento no Exterior	R\$	83.551,31	0,82%

Patrimônio Líquido (Somatório da Carteira) **R\$ 10.187.620,76 100,00%**

*O PL do plano não leva em consideração contas a pagar/receber e saldo em tesouraria.





Performance

Agosto/2023

Renda Fixa

Fundo e Ativo de Renda Fixa	Mês	Ano	12M	24M	36M
4UM Inflação IMA-B 5 FI Renda Fixa LP	0,61%	7,54%	11,11%	19,56%	21,11%
4UM Crédito Privado LP	1,34%	9,40%	14,58%	27,64%	32,37%
Augme Institucional FI Renda Fixa CP*	1,53%	4,88%	9,88%	24,67%	33,85%
Sparta Top FIC Renda Fixa Crédito Privado LP****	1,73%	7,59%	12,59%	26,09%	33,74%
Icatu Vanguarda Institucional FI Renda Fixa CP***	1,38%	5,28%	10,49%	23,80%	-
Sparta Top Inflação FIC Renda Fixa Crédito Privado LP****	1,22%	7,27%	10,79%	23,13%	-
V8 Vanquish Termo FI Renda Fixa**	1,11%	8,90%	13,72%	26,55%	30,97%
Icatu Vanguarda Inflação FI Renda Fixa CP LP****	0,96%	6,44%	9,87%	21,02%	28,39%
BB IRF-M 1 Títulos Públicos	1,12%	8,82%	13,40%	23,37%	25,63%
Bradesco Federal Extra FI RF Referenciado DI*****	1,13%	8,69%	13,28%	24,58%	27,53%
V8 Cash FI Renda Fixa Crédito Privado**	1,12%	8,81%	13,47%	25,41%	29,41%
CDI	1,14%	8,87%	13,55%	25,14%	28,52%

* Alocação em 10/08/2021; ** Alocação em 26/08/2021; *** Alocação em 31/08/2022; **** Alocação em 30/09/2022; ***** Alocação em 14/03/2023.

Renda Variável

Fundo e Ativos de Ações	Mês	Ano	12M	24M	36M
VALE ON N1**	-3,06%	-22,91%	6,59%	-16,00%	54,19%
BRASILON EJ NM*	-0,56%	45,55%	26,21%	90,95%	89,19%
4UM Marlim Dividendos FIA	-2,83%	10,65%	7,04%	5,51%	29,64%
4UM Small Caps FIA	2,48%	24,07%	13,66%	5,16%	22,61%
4UM Valor Institucional FIA	1,04%	17,59%	4,48%	8,06%	-
Ibovespa	-5,09%	5,47%	5,68%	-2,56%	16,48%

* Alocação em 20/12/2022; ** Alocação em 30/08/2023

Multimercado

Fundo Multimercado	Mês	Ano	12M	24M	36M
SPX NIM ESTR FIC FIM	1,61%	-2,60%	-3,44%	26,96%	35,07%
JGP Strategy FIC Multimercado*	0,19%	4,27%	9,75%	24,95%	24,38%
GÁVEA MACRO FIC MULTIMERCADO**	0,50%	5,92%	9,95%	27,10%	36,35%
CDI	1,14%	8,87%	13,55%	25,14%	28,52%

* Alocação em 17/12/2021; ** Alocação em 29/08/2023

Investimento no Exterior

Investimento no exterior	Mês	Ano	12M	24M	36M
4UM FI Ações BDR Nível I	3,72%	1,37%	3,11%	-9,70%	-
S&P 500	1,97%	10,75%	8,32%	-4,62%	15,85%



CONTATOS

Telefone

(61) 3317-2600 | 0800 727 2611

E-mail

atendimento@anabbprev.org.br

Horário de atendimento

Seg – Sex 09:00 às 18:00