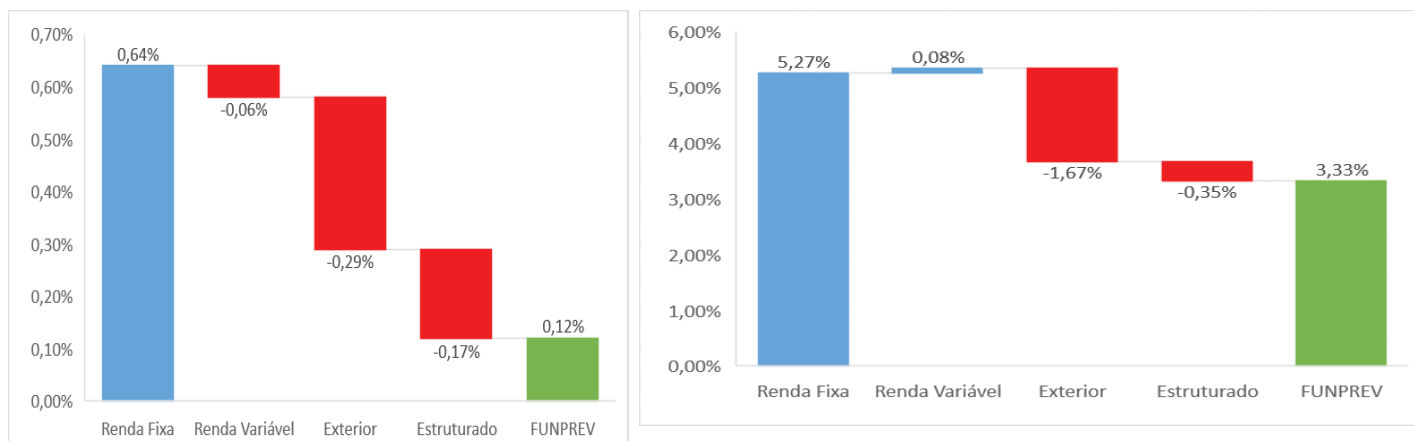


Gráfico 17: Contribuição ao Retorno – Estratégia e FUNPREV (Setembro 2022)



Fonte: Bloomberg/NUGIN.

Em termos de contribuições das Estratégias para o resultado do FUNPREV, observamos que Renda Fixa agregou 0,64% no mês e 5,27% no ano, a Renda Variável contribuiu com -0,06% no mês e 0,08% no ano, seguido pelo Exterior com contribuição de -0,29% mês e -1,67% ano e do Estruturado que contribuiu com -0,17% no mês e -0,35% no ano. O Exterior se mantém na liderança do detrator de performance do FUNPREV no ano.

Os detalhes do desempenho da carteira FUNPREV em Setembro e em 2022, por Estratégia e benchmark, pode ser visualizado abaixo:

Tabela 13: Retorno e Contribuição – Estratégia, Benchmark e FUNPREV (Setembro e 2022)

Estratégia	%	Retorno		Contribuição	
		set/22	2022	set/22	2022
Renda Fixa	74,95%	0,86%	7,21%	0,64%	5,27%
Alocação Dinâmica	34,90%	1,19%	8,61%	0,42%	2,85%
CDI Ativo	21,01%	1,25%	8,34%	0,27%	1,69%
CDI Referenciado	13,36%	1,09%	9,04%	0,14%	1,13%
Crédito Privado	0,53%	1,01%	5,90%	0,01%	0,03%
Tesouro SELIC	-	-	-	-	-
Juro Nominal	-	-	-	-	-
Tesouro Pré Fixado	-	-	-	-	-
Juro Real	40,05%	0,58%	5,91%	0,22%	2,42%
IDKA 2	4,31%	0,51%	6,53%	0,02%	0,27%
IMA-B 5	14,17%	0,41%	6,95%	0,05%	1,00%
IMA-B	8,56%	1,50%	5,84%	0,13%	0,64%
Vértice	3,71%	0,48%	4,27%	0,01%	0,50%
Tesouro Inflação	9,30%	0,09%	0,08%	0,01%	0,01%
Renda Variável	13,00%	-0,41%	0,80%	-0,06%	0,08%
Bolsa Brasil	13,00%	-0,41%	0,80%	-0,06%	0,08%
Livre	8,43%	-0,38%	0,86%	-0,03%	0,05%
Ibovespa	1,67%	0,23%	2,15%	0,00%	0,03%
Smallcaps	1,30%	-1,79%	-4,49%	-0,03%	-0,06%
FoF	1,60%	-0,12%	3,64%	0,00%	0,06%
Exterior	3,84%	-7,24%	-30,83%	-0,29%	-1,67%
Alocação Dólar	2,80%	-6,98%	-32,48%	-0,20%	-1,32%
Bolsa S&P Dólar	2,61%	-7,60%	-33,60%	-0,20%	-1,29%
Multimercado Dólar	0,19%	2,19%	-13,03%	0,00%	-0,03%
Alocação Hedge	1,04%	-7,96%	-25,88%	-0,09%	-0,35%
Bolsa S&P Hedge	0,50%	-9,76%	-31,84%	-0,05%	-0,22%
Multimercado Hedge	0,54%	-6,29%	-19,63%	-0,04%	-0,13%
Estruturado	8,22%	-2,04%	-4,13%	-0,17%	-0,35%
Multimercado Brasil	3,92%	1,20%	8,87%	0,04%	0,33%
Multimercado CDI+S&P	2,39%	-8,60%	-19,71%	-0,21%	-0,57%
Economia Real	1,91%	-0,27%	-5,77%	0,00%	-0,11%
FUNPREV	100,00%	0,12%	3,33%	0,12%	3,33%
CDI		1,07%	8,89%		
IPCA		-0,29%	4,09%		
IMA-B		1,48%	6,12%		
IPCA + 3%		-0,04%	6,42%		

Fonte: Bloomberg/NUGIN. Contribuição apresenta retornos aproximados.