regius em Números

ABRIL DE 2022

Transformando o futuro todos os dias

Quadro Resumo

Plano	Recurso dos Planos (R$)	Rentabilidade (%)		Desempenho no ano (%)*	Meta/*Benchmark*
		No mês	No ano		
Plano BD-01	2.551.590.215	1,10	5,29	94,80	IPCA + 4,70% a.a.
Plano CD-02	78.054.153	1,24	4,92	87,54	IPCA + 4,00% a.a.
Plano CV-03	573.248.280	0,59	4,58	81,62	IPCA + 4,00% a.a.
Plano CD-Metrô-DF	76.575.633	0,53	3,89	69,29	IPCA + 4,00% a.a.
Plano CD-05	11.532.294	(0,01)	3,05	54,27	IPCA + 4,00% a.a.
Plano BrasíliaPrev	316.030	1,52	4,98	88,73	IPCA + 4,00% a.a.
PGA	85.877.238	1,31	5,14	91,51	IPCA + 4,00% a.a.

*Comparado à meta/*benchmark* do Plano

Recursos dos Planos (R$)	3.377.193.844

Comentários do Gestor

Em abril, o cenário global, especialmente nos EUA, continuou sendo marcado pelas pressões inflacionárias, devido aos países adotarem políticas monetárias mais restritivas. Tal fato acarretou alta da curva de juros americana ao longo do mês. Logo, afetou, assim, o mercado de bolsa de valores, que tornaram o juros norte-americanos atrativos aos investidores globais.

O mês também foi marcado pela alta de casos de Covid-19 em grandes cidades chinesas, o que gerou resposta dura de política sanitária por parte do país. Dessa forma, houve um bloqueio na cadeia de suprimento, que por sua vez, afetou a dinâmica da atividade econômica de produção de forma global, pelo menos no curto prazo. Ademais, a Renda Variável no Brasil foi afetada em razão da incerteza sobre o crescimento chinês e sua capacidade de estimular a economia para manter o crescimento projetado desacelerou o movimento de *commodities*.

Além disso, a guerra entre Rússia e Ucrânia prossegue, aumentando o risco sobre as perspectivas econômicas mundiais, particularmente para a Zona de Euro, que já tinha a perspectiva de pequeno crescimento. A Rússia é a segunda maior produtora de petróleo e a maior fornecedora de gás para a Europa, além de a Região ser importante produtora de alimentos e de *commodities* para o mundo globalizado.

Nota-se que as consequências decorrentes da Covid-19, da crise geopolítica, ainda são fatores que mantêm elevado o risco inflacionário global, que postergam a normalização das cadeias de produção e que acentuam a pressão sobre preços de insumos e de alimentos.

O aperto monetário imposto pela 1ª economia, no combate aos efeitos inflacionários está no começo do ciclo e pairam incertezas sobre o tamanho do aperto para o combate da inflação sem jogar a economia na recessão. Esse desafio e seu desfecho poderão balançar os mercados nos próximos meses.

No Brasil, as leituras de inflação vieram acima das expectativas, pressionando a curva de juros nominais. Os títulos mais curtos atrelados à inflação tiveram retornos positivos devido ao maior carrego inflacionário, enquanto os mais longos sofreram com a alta da curva. Por outro lado, a Bolsa apresentou queda e encerrou o mês com recuo de 10,10%, em linha com o padrão observado no mercado internacional, a exemplo da S&P500 que fechou com recuo de 8,80%.

Adicionalmente, o fluxo estrangeiro, que impulsionou a alta recente do Ibovespa, reverteu o movimento dos meses anteriores e houve saída de investimentos da Bolsa local. Em termos setoriais, as maiores quedas vieram de empresas de consumo e de serviços financeiros. Por outro lado, setores ligados ao petróleo se mostraram mais defensivos, recuando menos do que o índice.

regius em Números

ABRIL DE 2022

Transformando o futuro todos os dias

Plano BD-01

MACROALOCAÇÃO			RENTABILIDADE (%)		
Segmento	**Composição**	**Participação (%)**	**No Mês**	**No Ano**	**12 Meses**
Renda Fixa	2.244.563.318	87,97	1,56	5,59	15,59
Renda Variável	87.987.854	3,45	(8,87)	2,34	(8,00)
Estruturado	89.759.410	3,52	1,08	4,67	6,35
Imobiliário	99.663.554	3,90	0,53	1,95	(10,40)
Empréstimos	31.152.080	1,22	1,28	5,02	16,71
Exterior	452.589	0,02	(14,62)	(23,66)	(23,66)
Disponível	11.509	0,00	-	-	-
Depósito Judicial	279.016	0,01	-	-	-
Provisões (Contingencial)	(1.680.380)	(0,07)	-	-	-
Outros	(598.734)	(0,02)	-	-	-
TOTAL	**2.551.590.215**	**100,00**	**1,10**	**5,29**	**12,61**
META ATUARIAL (IPCA*+4,70% a.a.)			**2,03**	**5,58**	**16,53**

*IPCA defasado em 1 mês.

APURAÇÃO DO RESULTADO DO PLANO (R$)		
	No Mês	**Acumulado**
PATRIMÔNIO DE COBERTURA*	16.404.679	2.538.765.404
PROVISÕES MATEMÁTICAS**	(26.956.308)	(2.668.694.189)
Superavit / Deficit	**(10.551.629)**	**(129.928.786)**
Ajuste de Precificação 2021	**--**	**244.178.304**
Equilíbrio Técnico Ajustado	**--**	**114.249.518**

*Total dos recursos previdenciários para cobertura dos compromissos do Plano.

**Compromisso do Plano com os Participantes ativos e assistidos, contemplando os benefícios já concedidos e os benefícios a conceder e provisões matemáticas a constituir.

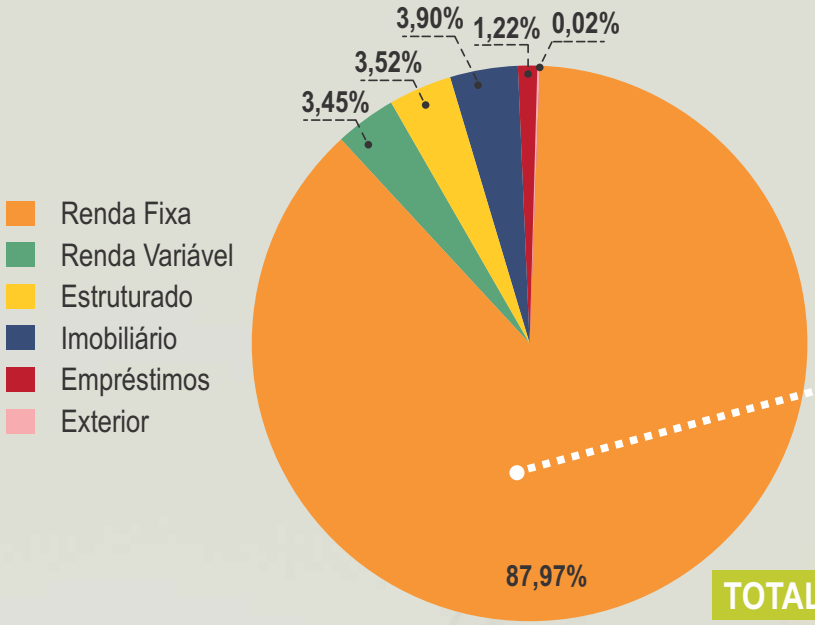
Para conhecer a carteira do Plano BD-01, clique aqui.

Comentários do Gestor

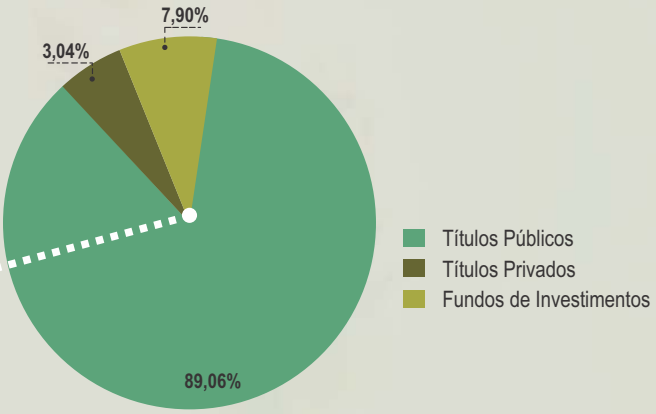
A rentabilidade no mês foi de 1,10% contra uma meta atuarial de 2,03%, que corresponde a 1,62% (IPCA do mês anterior) + 4,70% a.a.. No segmento de Renda Fixa, que representou 87,97% da carteira, a rentabilidade foi de 1,56%, o que superou o benchmark do segmento (CDI de 0,83%) em 86,98%. Em decorrência do objetivo alto do mês, nenhum segmento superou a meta, mas os segmentos de Renda Fixa, Estruturados e Empréstimos superaram com folga o CDI do mês. Aproveitando o momento de atratividade das taxas das NTN-B – Título Público indexado ao IPCA com juros reais superiores a 4,70% – foram adquiridos R$ 38,07 milhões de Títulos Públicos Federais para o Plano, com taxa acima da meta atuarial. Com as aquisições oportunizadas pelo estresse de mercado decorrente do contexto econômico mundial, a taxa média da carteira do Plano foi elevada para 6,05%. Mesmo com a taxa média dos ativos acima da meta atuarial, a performance da carteira poderá ser afetada, momentaneamente, pela marcação a mercado na ocorrência de elevação da taxa de juros. Quanto à posição em ações, o resultado foi de (8,87%), enquanto o IBOVESPA fechou em (10,10%) a Bolsa brasileira foi afetada pela saída do investidor estrangeiro em busca de realização de lucros. O desempenho da carteira de ativos, em 2022, está em 94,80% do esperado pela meta atuarial.

Investimentos

BD-01

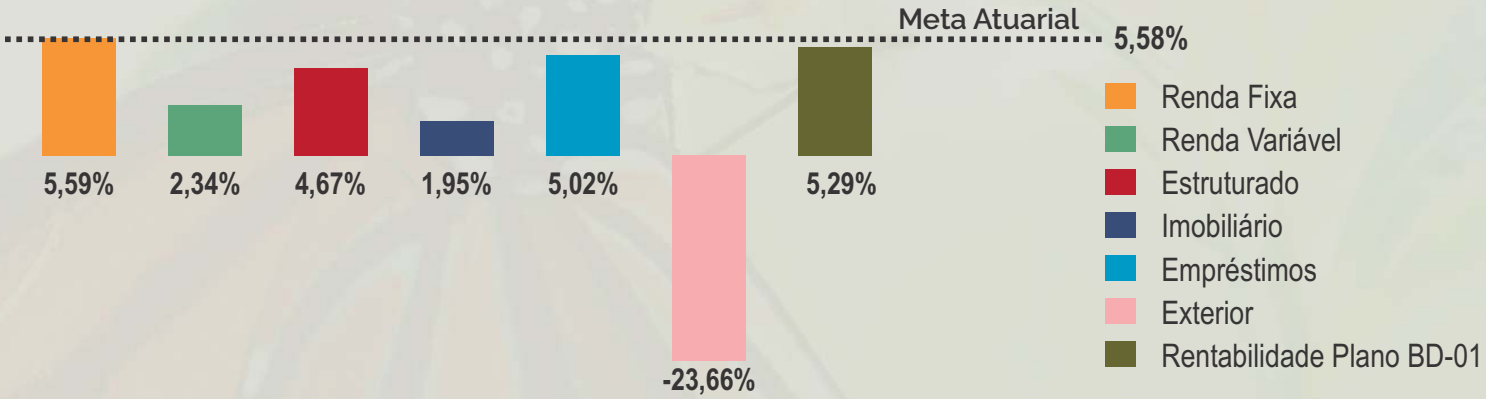


Renda Fixa

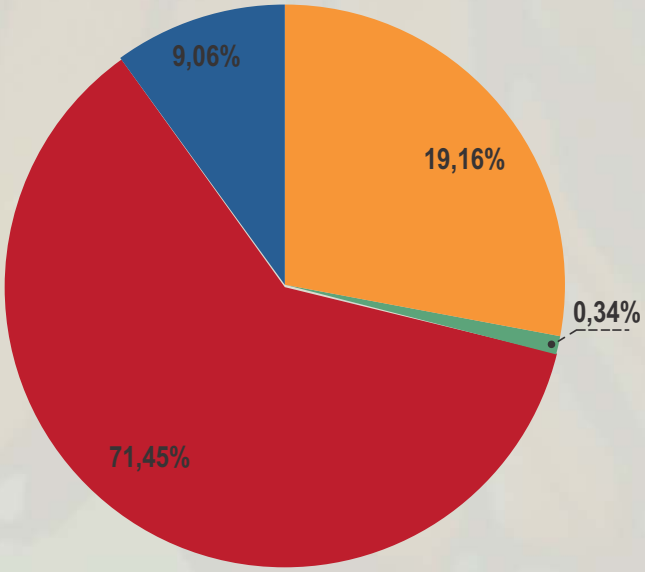


TOTAL DOS INVESTIMENTOS: R$2.551.590.215

Rentabilidade no ano



Quantidade de Participantes



347	Ativos
6	Autopatrocinados
0	Regime Especial
1.294	Aposentados
164	Pensionistas

TOTAL: 1.811

SGAS 902 – ED. ATHENAS – BL. C – 2º ANDAR
(61) 3035.4400 | relacionamento@regius.org.br
www.regius.org.br

Conteúdo: GERIC/GEPRE/GEINV | Produzido por Creative Tea Comunicação

regius em Números

ABRIL DE 2022

Transformando o futuro todos os dias

Plano CD-02

MACROALOCAÇÃO			RENTABILIDADE (%)		
Segmento	Composição	Participação (%)	No Mês	No Ano	12 Meses
Renda Fixa	73.527.354	94,20	1,22	4,78	9,90
Estruturado	4.531.054	5,81	1,50	7,07	9,52
Imobiliário	-	-	-	-	-
Disponível	1.289	0,00	-	-	-
Outros	(5.543)	(0,01)	-	-	-
TOTAL	**78.054.153**	**100,00**	**1,24**	**4,92**	**9,89**
REFERENCIAL (IPCA + 4,00% a.a.)			**1,36**	**5,62**	**16,06**

APURAÇÃO DO RESULTADO DO PLANO (R$)		
	No Mês	Acumulado
PATRIMÔNIO DE COBERTURA* = PROVISÕES MATEMÁTICAS**	138.659	76.877.963
FUNDOS PREVIDENCIAIS	11.003	893.046

*Total dos recursos previdenciários para cobertura dos compromissos do Plano.

**Compromisso do Plano com os Participantes ativos e assistidos, contemplando os benefícios já concedidos e os benefícios a conceder e provisões matemáticas a constituir.

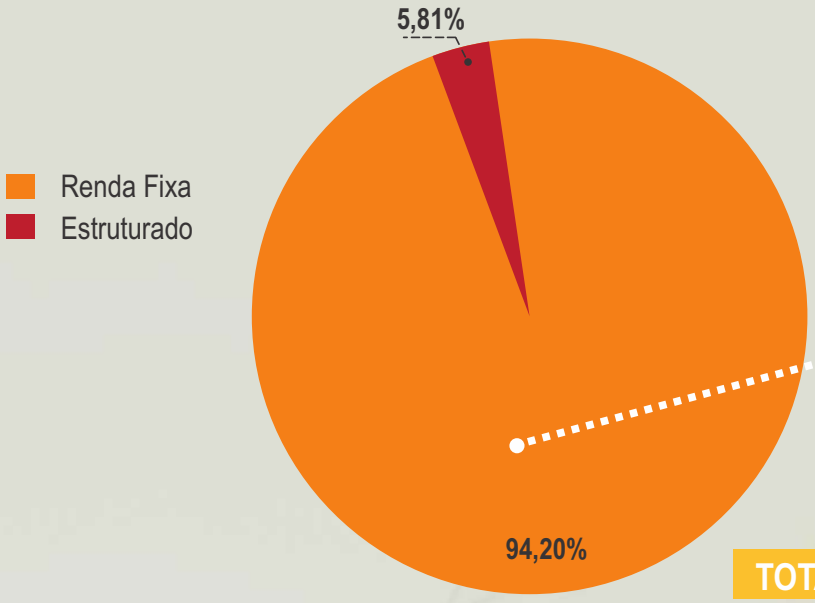
Comentários do Gestor

O segmento de Renda Fixa representou 94,20% da carteira, teve rentabilidade mensal de 1,22%; o segmento de Estruturados, que representou 5,81% do Plano, teve performance de 1,50%, enquanto o benchmark (CDI) ficou em 0,83%. Mesmo com os dois segmentos de investimento do Plano performando acima do CDI, a performance não foi suficiente para bater a referência atuarial esperada da carteira, que foi de IPCA (1,06%) +4%a.a., totalizando 1,36%. A rentabilidade da carteira no mês foi de 1,24%, sendo que a performance anual da carteira de ativos atingiu 87,54% da rentabilidade esperada do ano.

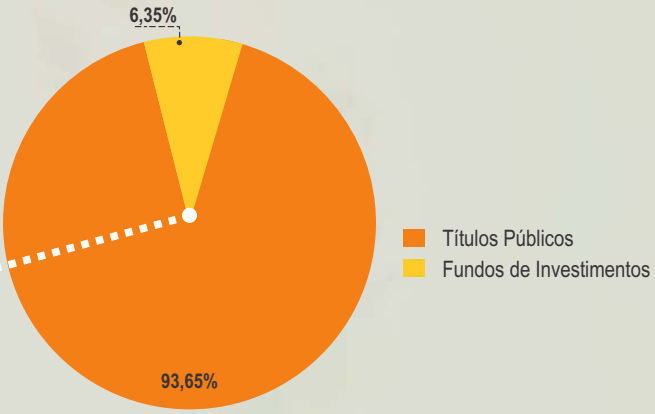
Para conhecer a carteira do Plano CD-02, clique aqui.

Investimentos

CD-02

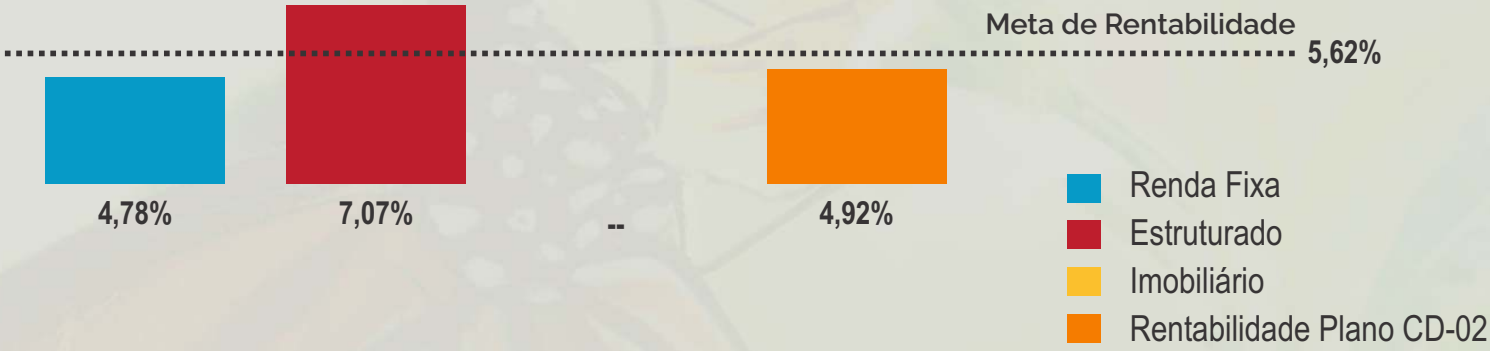


Renda Fixa

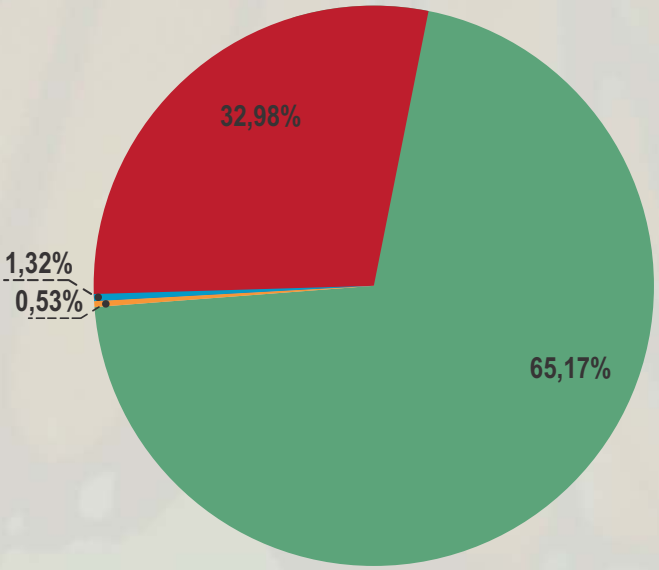


TOTAL DOS INVESTIMENTOS: R$78.054.153

Rentabilidade no ano



Quantidade de Participantes



247	Ativos
2	Autopatrocinados
5	Regime Especial
125	Aposentados

TOTAL: 379

regius em Números

ABRIL DE 2022

Transformando o futuro todos os dias

Plano CV-03

MACROALOCAÇÃO			RENTABILIDADE (%)		
Segmento	Composição	Participação (%)	No Mês	No Ano	12 Meses
Renda Fixa	498.954.498	87,04	1,24	4,90	13,06
Renda Variável	31.798.387	5,55	(9,37)	(1,29)	(13,46)
Estruturado	28.272.442	4,93	1,40	5,93	8,87
Imobiliário	554.671	0,10	(0,60)	(0,82)	1,59
Empréstimos	13.581.019	2,37	1,02	4,25	15,00
Exterior	100.466	0,02	(14,62)	(23,66)	(23,66)
Disponível	71.517	0,01	-	-	-
Outros	(84.719)	(0,02)	-	-	-
TOTAL	**573.248.280**	**100,00**	**0,59**	**4,58**	**10,82**
META ATUARIAL (IPCA + 4,00% a.a.)			**1,36**	**5,62**	**16,06**

APURAÇÃO DO RESULTADO DO PLANO (R$)		
	No Mês	Acumulado
PATRIMÔNIO DE COBERTURA*	6.529.566	549.097.435
PROVISÕES MATEMÁTICAS**	(5.169.034)	(547.793.854)
Superavit / Deficit	**1.360.532**	**1.303.581**
FUNDOS PREVIDENCIAIS	236.922	23.374.033
Superavit / Deficit	**1.360.532**	**1.303.581**
Ajuste de Precificação 2021	**-**	**4.648.586**
Equilíbrio Técnico Ajustado	**-**	**5.952.167**

*Total dos recursos previdenciários para cobertura dos compromissos do Plano.

**Compromisso do Plano com os participantes ativos e assistidos, contemplando os benefícios já concedidos e os benefícios a conceder.

Comentários do Gestor

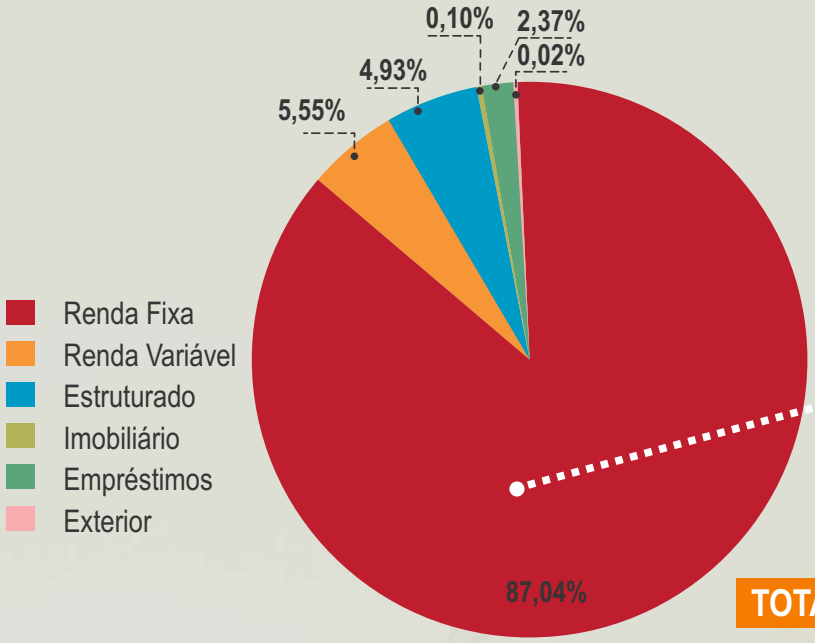
A rentabilidade da carteira do Plano foi de 0,59%, enquanto a meta atuarial foi de 1,36% [IPCA (1,06%) +4%a.a.]. A performance da carteira representou 81,62% da rentabilidade esperada no ano. O segmento de Renda Fixa representou 87,04% da carteira do Plano e teve rentabilidade de 1,24%, enquanto o segmento de Estruturado, representado por 4,93% da carteira, rendeu 1,40%, tendo o benchmark (CDI) desses segmentos atingido 0,83%. Somente o segmento de Estruturado conseguiu superar a meta do Plano no mês e no ano. Neste mês, a Performance da Renda Variável (brasileira e exterior) e do imobiliário, que juntos representam 5,66% da carteira, afetaram o retorno da carteira do Plano.

Considerando o contexto geoeconômico que propiciou taxa atrativas e com proteção da inflação (NTN-B) foram realizadas novas alocações em taxas de juros de, aproximadamente, R$ 11,55 milhões em Título Públicos Federais, com taxa acima da meta do Plano, elevando, assim a taxa média da carteira. A posição da Renda Fixa marcada a mercado está sujeita a oscilação de rentabilidade, representada pela volatilidade das taxas.

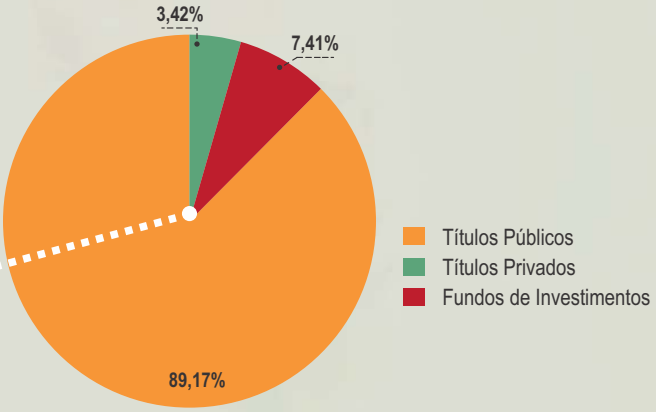
Para conhecer a carteira do Plano CV-03, clique aqui.

CV-03

Investimentos

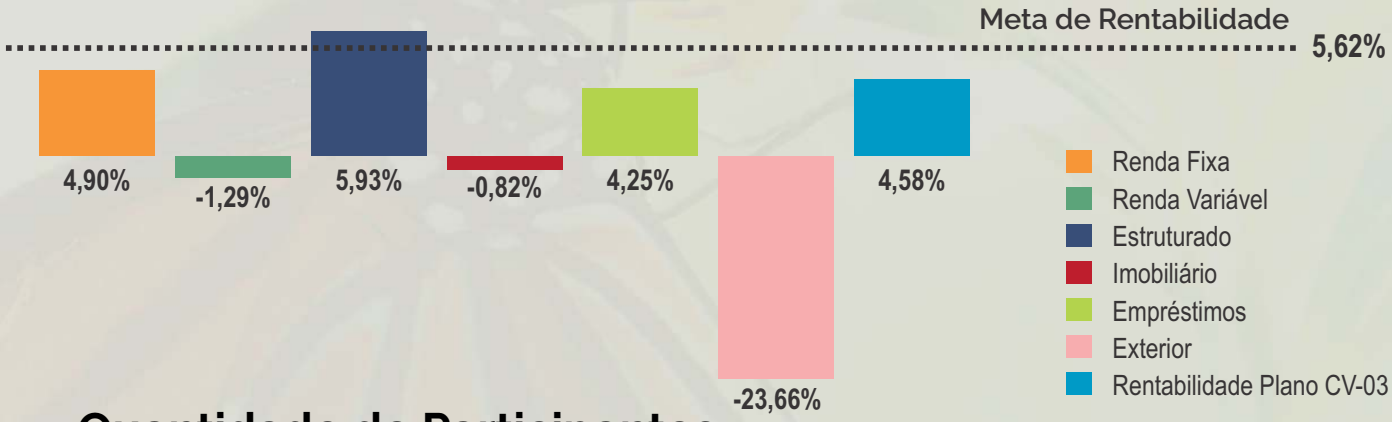


Renda Fixa

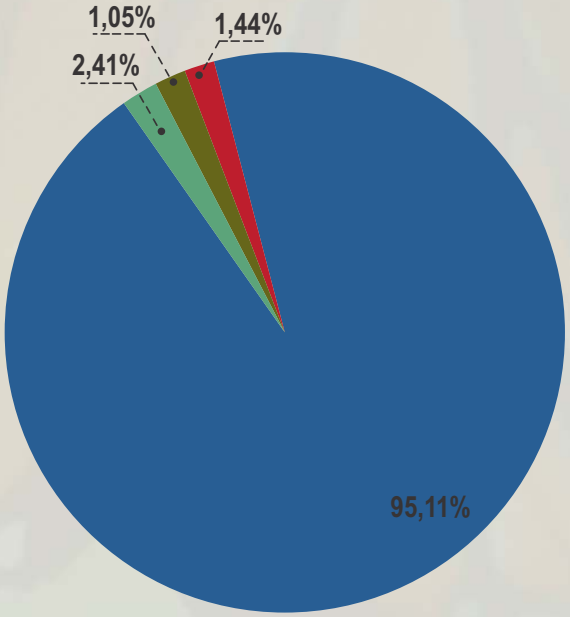


TOTAL DOS INVESTIMENTOS: R$573.248.280

Rentabilidade no ano



Quantidade de Participantes



2.177	Ativos
55	Autopatrocinados
24	Regime Especial
33	Aposentados

TOTAL: 2.289

SGAS 902 – ED. ATHENAS – BL. C – 2º ANDAR
(61) 3035.4400 | relacionamento@regius.org.br
www.regius.org.br

regius

Conteúdo: GERIC/GEPRE/GEINV | Produzido por Creative Tea Comunicação

regius em Números

ABRIL DE 2022

Transformando o futuro todos os dias

SELO DE AUTORREGULAÇÃO – GOVERNANÇA DE INVESTIMENTOS – PROCESSO CERTIFICADO

Plano CD-Metrô-DF

MACROALOCAÇÃO			RENTABILIDADE (%)		
Segmento	Composição	Participação (%)	No Mês	No Ano	12 Meses
Renda Fixa	69.125.710	90,27	0,93	4,21	10,36
Renda Variável	2.649.816	3,46	(10,95)	(10,00)	(30,34)
Estruturado	4.516.335	5,90	2,12	7,85	9,68
Empréstimos	287.821	0,38	1,03	4,16	12,46
Disponível	2.815	0,00	-	-	-
Outros	(6.865)	(0,01)	-	-	-
TOTAL	**76.575.633**	**100,00**	**0,53**	**3,89**	**7,93**
REFERENCIAL (IPCA + 4,00% a.a.)			**1,36**	**5,62**	**16,06**

APURAÇÃO DO RESULTADO DO PLANO (R$)		
	No Mês	Acumulado
PATRIMÔNIO DE COBERTURA* = PROVISÕES MATEMÁTICAS**	1.035.006	75.992.364
FUNDOS PREVIDENCIAIS	6.135	513.651

*Total dos recursos previdenciários para cobertura dos compromissos do Plano.

**Compromisso do Plano com os participantes ativos, contemplando os benefícios a conceder.

Para conhecer a carteira do Plano CD-Metrô-DF, clique aqui.

Comentários do Gestor

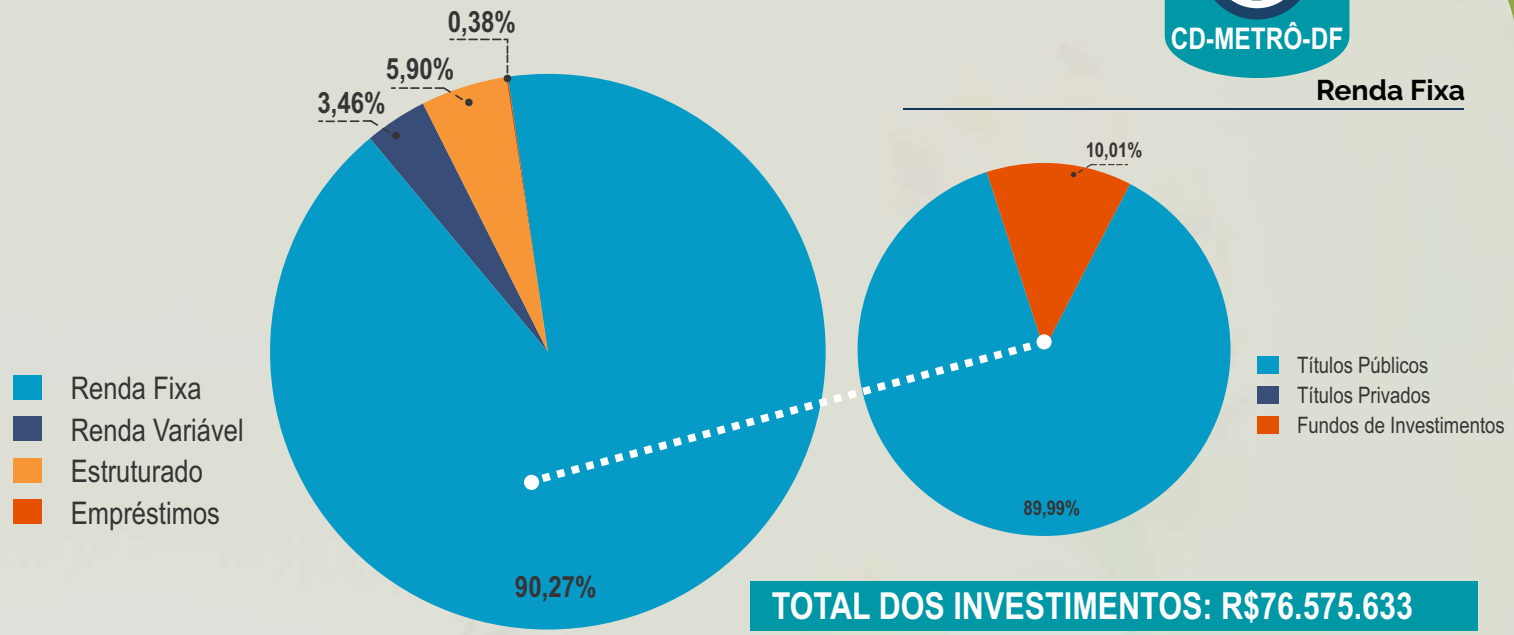
A rentabilidade do Plano foi de 0,53%, enquanto a meta atuarial [IPCA (1,06%)+4% a.a.] foi de 1,36%. O segmento de Renda Fixa, que representou 90,27% da carteira, teve rentabilidade de 0,93% e o segmento de Estruturados, que representou 5,90% e teve rentabilidade de 2,12 %, frente à meta de 1,36 % e ao benchmark (CDI) de 0,83%. O segmento de Estruturado foi o único segmento que superou a meta no mês e no ano e, embora a taxa média da Renda Fixa tenha se elevado em face das aquisições propiciadas pelo cenário geoeconômico, estará sujeita às oscilações por marcação a mercado, situação esperada dada a nova ordem econômica mundial.

Permanece a estratégia de aquisição de ativos livres de riscos e indexados ao passivo do Plano enquanto as taxas apresentarem superiores a referência atuarial do Plano. Nesse contexto foram adquiridos R$ 3,71 milhões de NTN-B no mês.

O Ibovespa teve performance de (10,10%) no mês e a Renda Variável do Plano acompanhou a performance do índice atingindo o retorno negativo de 10,95% no mês.

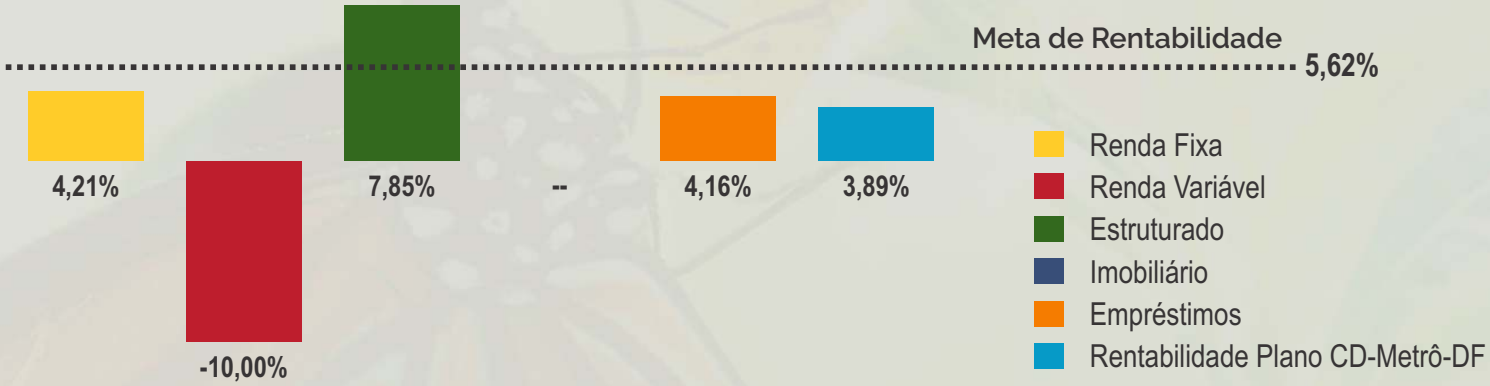
CD-METRÔ-DF

Investimentos

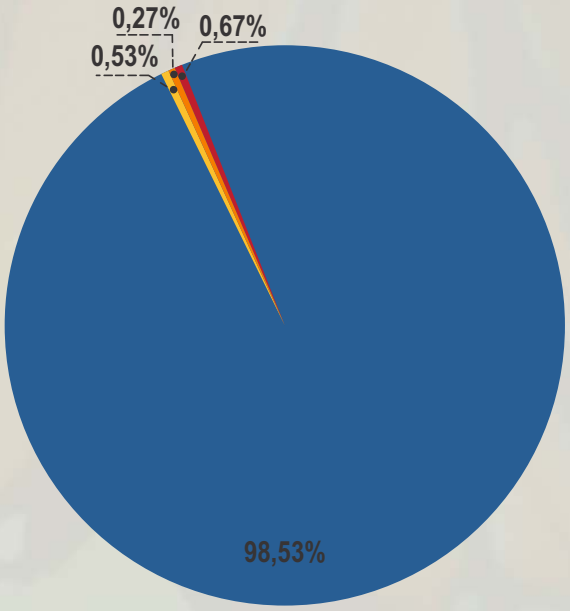


TOTAL DOS INVESTIMENTOS: R$76.575.633

Rentabilidade no ano



Quantidade de Participantes



738	Ativos
4	Autopatrocinados
2	Regime Especial
5	Aposentados

TOTAL: 749

SGAS 902 – ED. ATHENAS – BL. C – 2º ANDAR
(61) 3035.4400 | relacionamento@regius.org.br
www.regius.org.br

Conteúdo: GERIC/GEPRE/GEINV | Produzido por Creative Tea Comunicação

regius em Números

ABRIL DE 2022

Transformando o futuro todos os dias

Plano CD-05

MACROALOCAÇÃO			RENTABILIDADE (%)		
Segmento	Composição	Participação (%)	No Mês	No Ano	12 Meses
Renda Fixa	10.375.084	89,97	0,37	2,95	4,67
Renda Variável	577.976	5,01	(7,53)	0,31	(14,81)
Estruturado	519.195	4,50	1,57	6,10	5,21
Empréstimos	44.879	0,39	1,00	4,07	12,87
Disponível	16.231	0,14	-	-	-
Outros	(1.071)	(0,01)	-	-	-
TOTAL	**11.532.294**	**100,00**	**(0,01)**	**3,05**	**3,18**
REFERENCIAL (IPCA + 4,00% a.a.)			**1,36**	**5,62**	**16,06**

APURAÇÃO DO RESULTADO DO PLANO (R$)		
	No Mês	Acumulado
PATRIMÔNIO DE COBERTURA* = PROVISÕES MATEMÁTICAS**	228.246	10.592.233
FUNDOS PREVIDENCIAIS	55.073	892.464

*Total dos recursos previdenciários para cobertura dos compromissos do Plano.
**Compromisso do Plano com os participantes ativos, contemplando os benefícios a conceder.

Para conhecer a carteira do Plano CD-05, clique aqui.

Comentários do Gestor

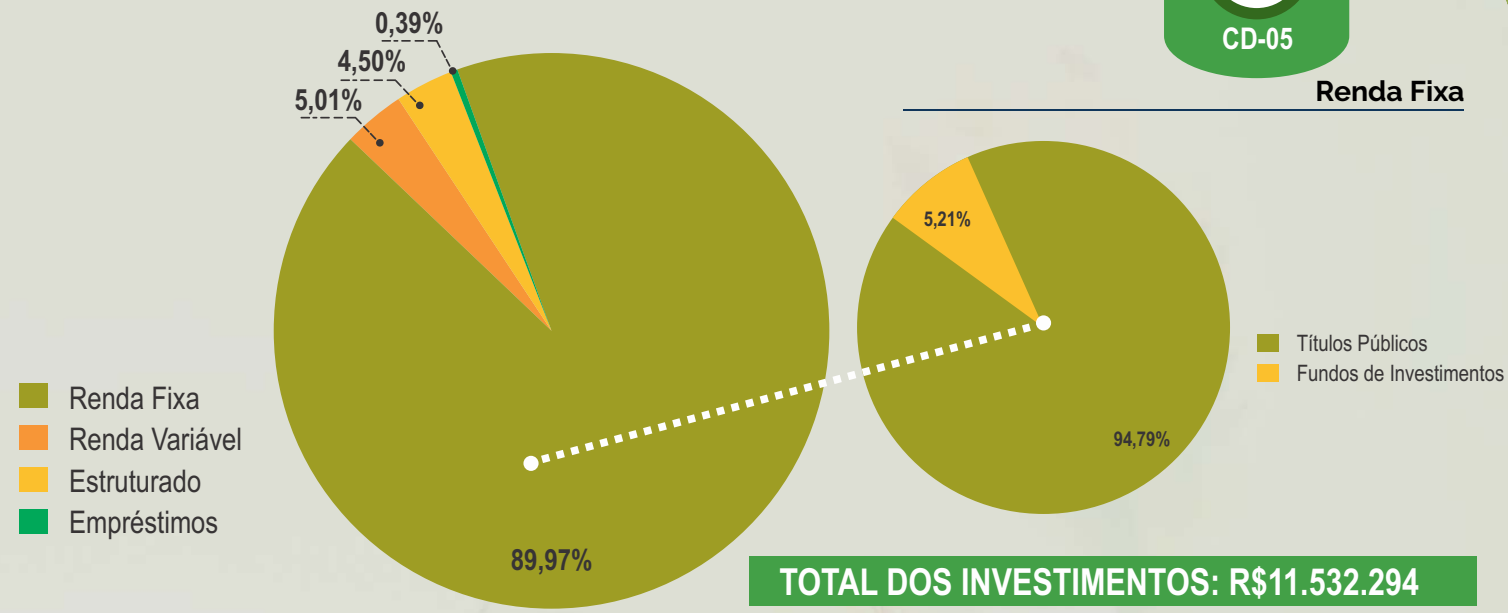
A rentabilidade da carteira foi de (0,01%), enquanto a referência de rentabilidade esperada [IPCA (1,06%) + 4%a.a.] para o mês foi de 1,36%. A performance do segmento de Renda Fixa, que representa 89,97% da carteira, foi de 0,37% impactada pelo movimento de marcação a mercado das taxas longas. O segmento de Estruturado, que participou com 4,50% da carteira, rendeu 1,57% e superou a meta do Plano no mês e no ano. O CDI rendeu 0,83% e o Ibovespa teve retorno negativo de 10,10%.

Até ao momento, a carteira do Plano entregou 54,27% da rentabilidade esperada para o ano, cuja a pior performance adveio da posição de renda variável que representou 5,01% e rendeu 0,31% no ano.

Enquanto as taxas reais de juros superarem a referência atuarial do Plano, mantém a estratégia de aquisição dos títulos NTN-B, cuja as aquisições feitas nesse momento de mudança na ordem global, tem elevado a taxa média de carteira e que, mesmo com os efeitos momentâneos da marcação a mercado, beneficiará os retornos do plano no médio e longo prazo. Atualmente a taxa média dos juros reais da carteira de NTN-B encontra-se em 4,81% contra 4% da referência atuarial. Nesse contexto, foram adquiridos, aproximadamente, R$ 300 mil em NTN-B no mês de abril.

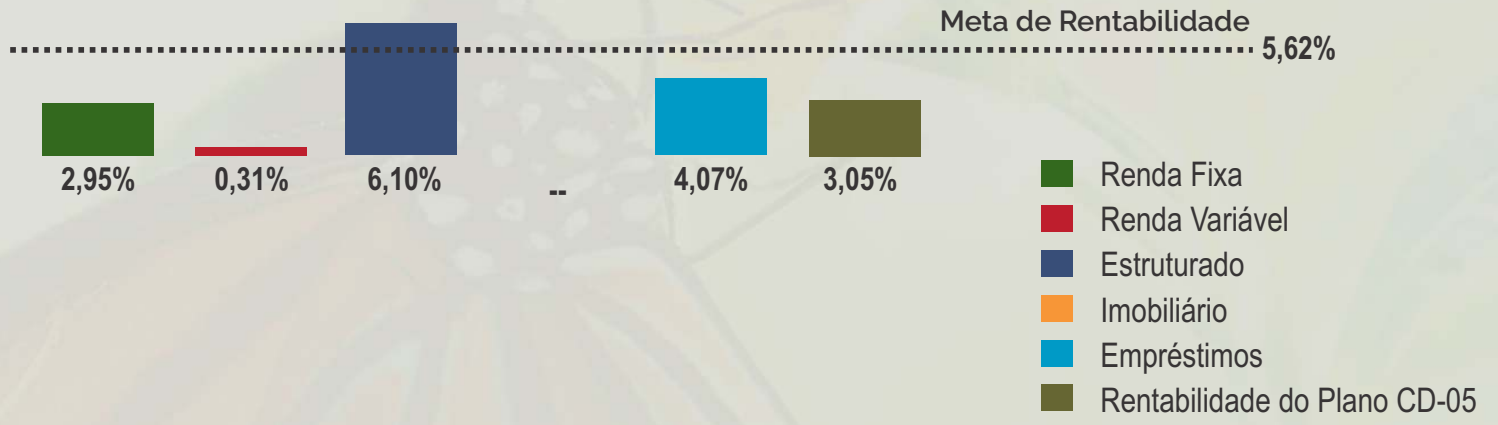
CD-05

Investimentos

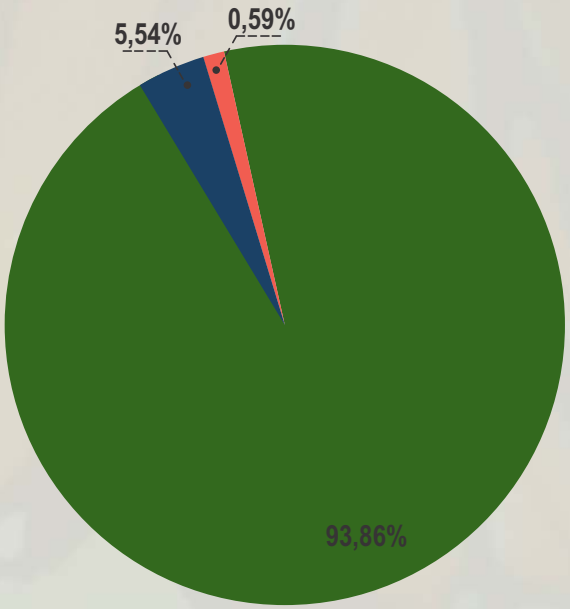


TOTAL DOS INVESTIMENTOS: R$11.532.294

Rentabilidade no ano



Quantidade de Participantes



474	Ativos
28	Autopatrocinado
3	Regime Especial

TOTAL: 505

regius em Números

ABRIL DE 2022

Transformando o futuro todos os dias

Plano BrasíliaPrev

MACROALOCAÇÃO			RENTABILIDADE (%)		
Segmento	**Composição**	**Participação (%)**	**No Mês**	**No Ano**	**12 Meses**
Renda Fixa	315.742	99,91	1,52	4,98	8,69
Disponível	289	0,09	-	-	-
Outros	-	0,00	-	-	-
TOTAL	**316.030**	**100,00**	**1,52**	**4,98**	**8,69**
REFERENCIAL (IPCA + 4,00% a.a.)			**1,36**	**5,62**	**16,06**

APURAÇÃO DO RESULTADO DO PLANO (R$)		
	No Mês	**Acumulado**
PATRIMÔNIO DE COBERTURA* = PROVISÕES MATEMÁTICAS**	31.168	316.030
FUNDOS PREVIDENCIAIS	0,00	0,00

*Total dos recursos previdenciários para cobertura dos compromissos do Plano.
**Compromisso do Plano com os participantes ativos, contemplando os benefícios a conceder.

Comentários do Gestor

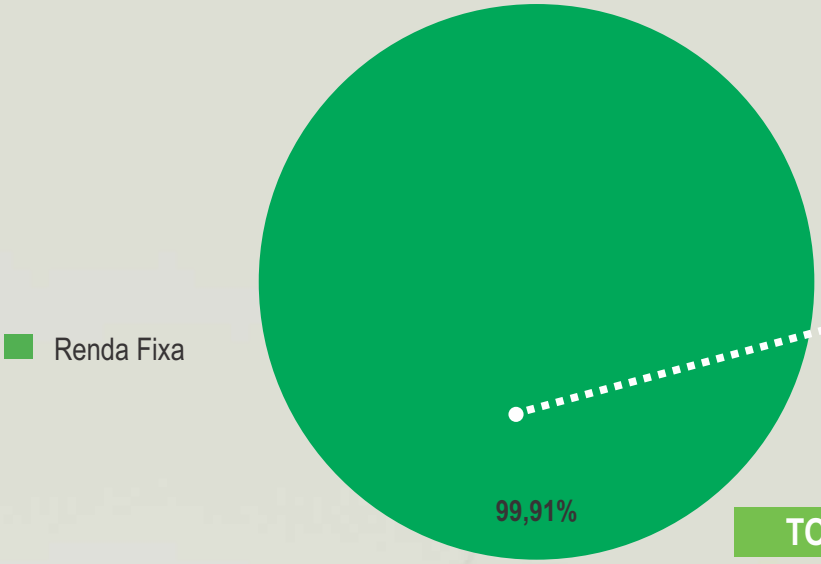
A Renda Fixa representou a totalidade da carteira e obteve resultado de 1,52%, enquanto que o benchmark do segmento foi 0,83% e o referencial [IPCA (1,06%) + 4%a.a.] foi de 1,36%.

O Plano tem pouco mais de um ano de existência e tem o propósito de levar a cobertura previdenciária aos familiares dos participantes e aos associados das instituidoras, estando em fase de acumulação, com pouca diversificação dado o volume do patrimônio acumulado. Dado o momento propicio para a aquisição de NTN-B foi iniciada a aquisição desses títulos para compor a carteira do Plano, esses ativos são marcados a mercado e podem apresentar volatilidade no curso do investimento. A carteira de ativos entregou a rentabilidade de 4,98% no ano, representando 88,73% da referência atuarial e 151,59% do CDI.

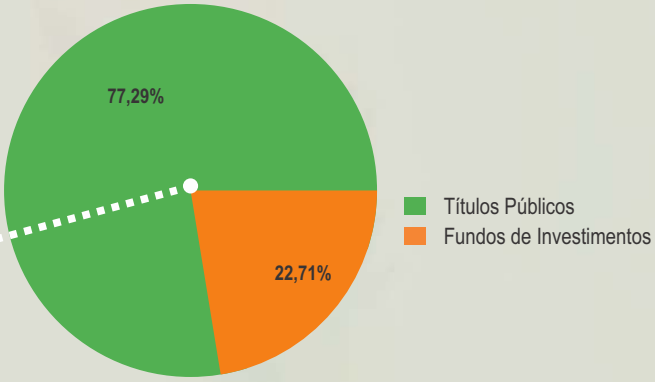
Para conhecer a carteira do Plano BrasíliaPrev, clique aqui.

Brasília Prev

Investimentos

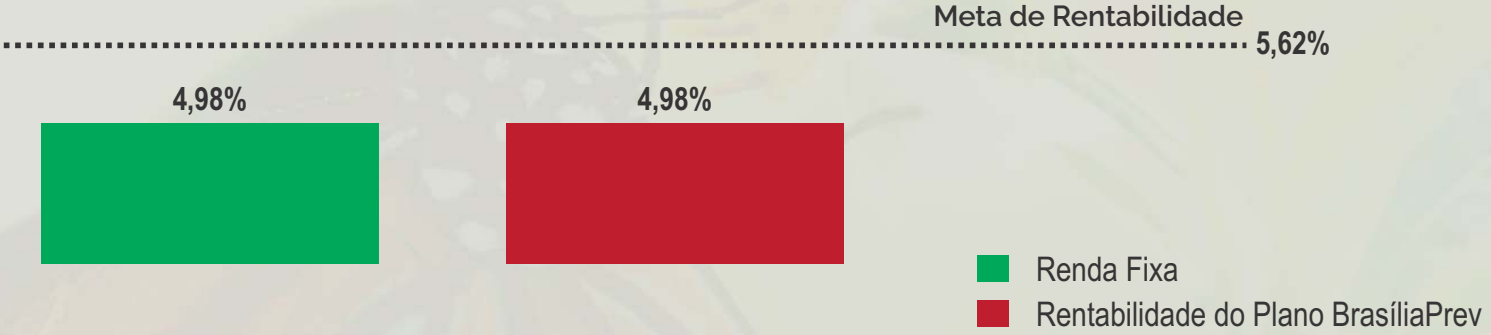


Renda Fixa

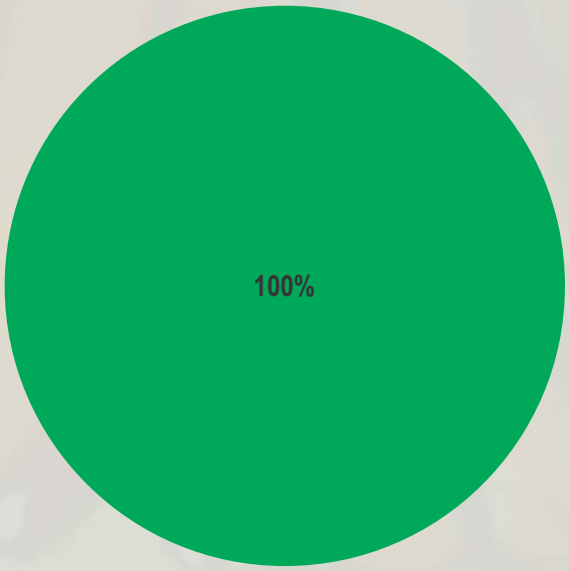


TOTAL DOS INVESTIMENTOS: R$316.030

Rentabilidade no ano



Quantidade de Participantes



250 Ativos

TOTAL: 250

regius em Números

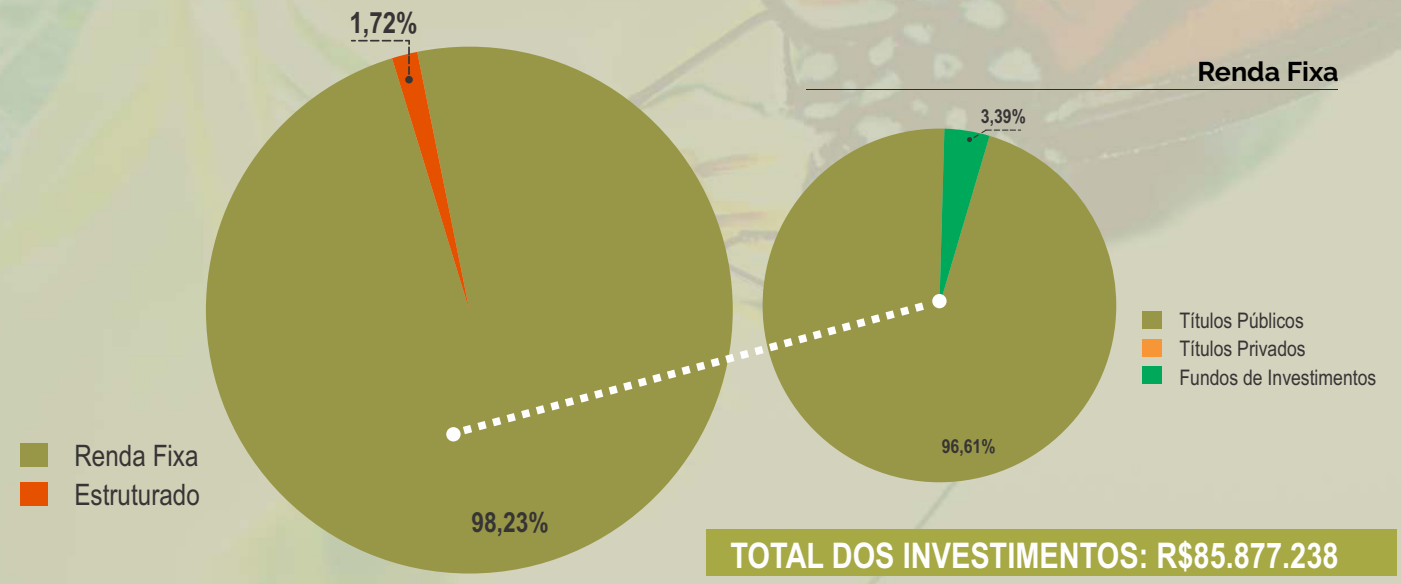
ABRIL DE 2022

Transformando o futuro todos os dias

Plano de Gestão Administrativa PGA

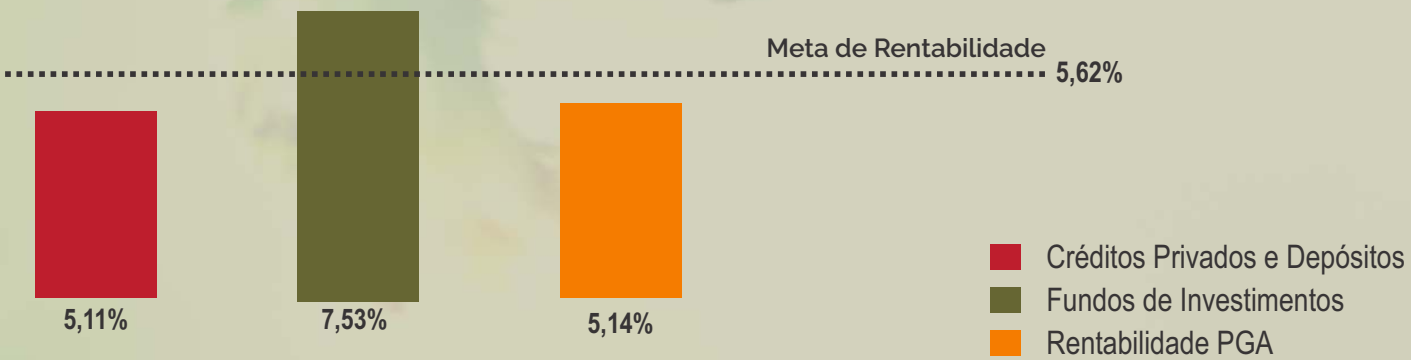
MACROALOCAÇÃO			RENTABILIDADE (%)		
Segmento	Composição	Participação (%)	No Mês	No Ano	12 Meses
Renda Fixa	84.361.650	98,23	1,30	5,11	14,22
Estruturado	1.476.497	1,72	2,12	7,53	6,89
Disponível	39.091	0,05	-	-	-
TOTAL	**85.877.238**	**100,00**	**1,31**	**5,14**	**13,81**
REFERENCIAL (IPCA + 4,00% a.a.)			**1,36**	**5,62**	**16,06**

Investimentos



TOTAL DOS INVESTIMENTOS: R$85.877.238

Rentabilidade no ano

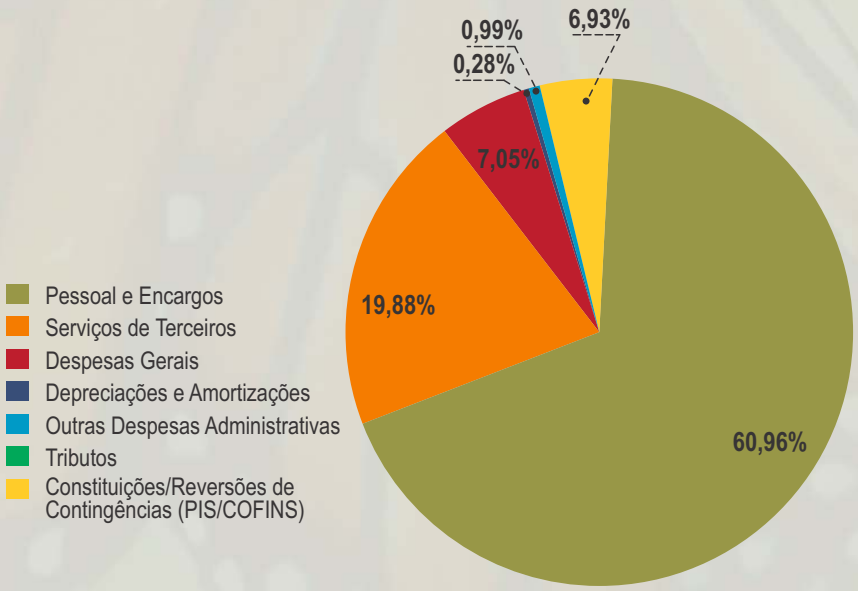
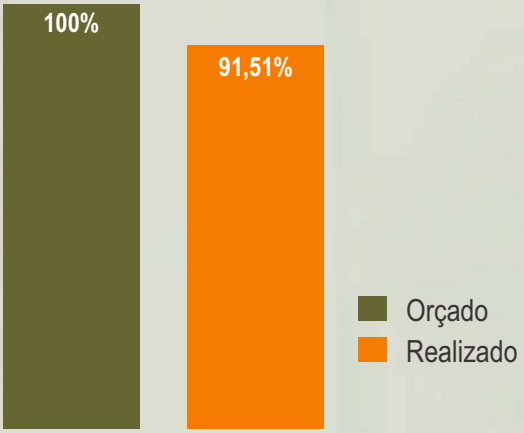


Para conhecer a carteira do Plano de Gestão Administrativa, clique aqui.

PGA

Comentários do Gestor

O PGA teve rentabilidade de 1,31% no mês e 5,14% no ano, que corresponde a 91,51% da rentabilidade esperada [IPCA (1,06%) + 4% a.a.]. O segmento de Renda Fixa, que representou 98,24% da carteira, teve um resultado de 1,30%, enquanto o benchmark do segmento (CDI) foi de 0,83%. O segmento de Estruturado (1,72% da carteira) rendeu 2,12%, entregando acima da meta esperada no mês e no ano.

APURAÇÃO DO RESULTADO (R$)				ORÇAMENTO (R$)	
		No Mês	Acumulado	Realizado	Projetado
(+)	Receitas da Gestão Previdencial	383.785	1.533.957	5.654.247	6.179.002
(+)	Receitas da Gestão de Investimentos	690.214	2.684.000		
(+)	Receitas Diretas	-	-		
(+)	Outras Receitas	-	-		
(-/+)	Resultado dos Investimentos	1.102.460	4.203.726		
(-)	Despesas	(1.357,350)	(5.262.639)		
(-/+)	Constituição / Reversão das Provisões Cotingenciais	(101,205)	(391.608)	Despesas realizadas 8,49% abaixo do valor orçado até o mês de abril de 2022.	
=	**Constituição / Reversão do Fundo ADM**	**717.904**	**2.767.435**		

Despesas