



# COLETIVA DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

**Balço do 2º trimestre de 2022**






Dados acumulados até 30 de junho



**ANBIMA**

# NÚMEROS GERAIS DA INDÚSTRIA

Captação líquida da indústria tem queda de 97,1% na comparação com primeiro semestre de 2021

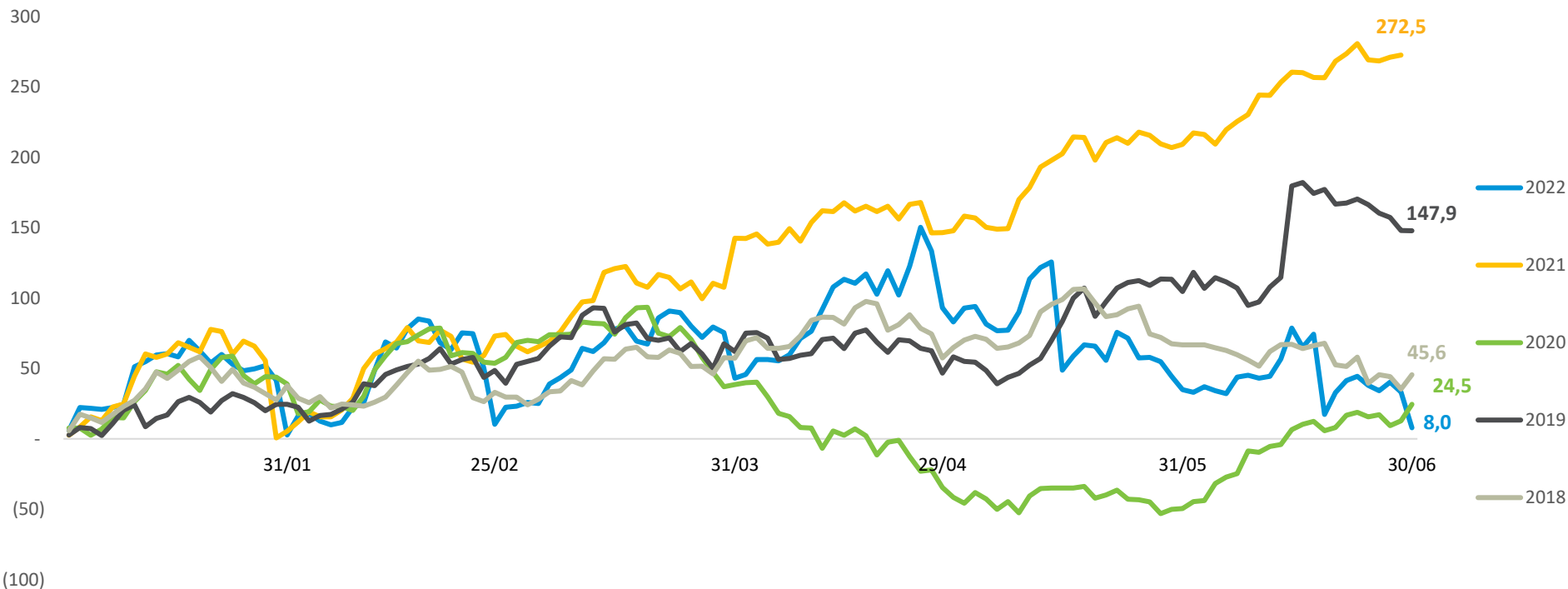
	Jun/21	Jun/22	Variação % no período
Patrimônio Líquido 	6,7 tri	7,2 tri	6,8
Captação Líquida Acumulada <sup>(2)</sup> 	272,5 bi	8,0 bi	-97,1
Nº de Contas <sup>(1)</sup> 	28.342.996	31.567.315	11,4
Nº de Fundos 	24.449	27.507	12,5
Gestores <sup>(1)</sup> 	777	881	13,4

(1) Posições referentes ao mês de maio.

(2) Captação líquida acumulada no ano até junho.

# CAPTAÇÃO LÍQUIDA ACUMULADA NO ANO ATÉ JUNHO – R\$ BILHÕES

Resultado é o menor dos últimos cinco anos, totalizando R\$ 8 bilhões

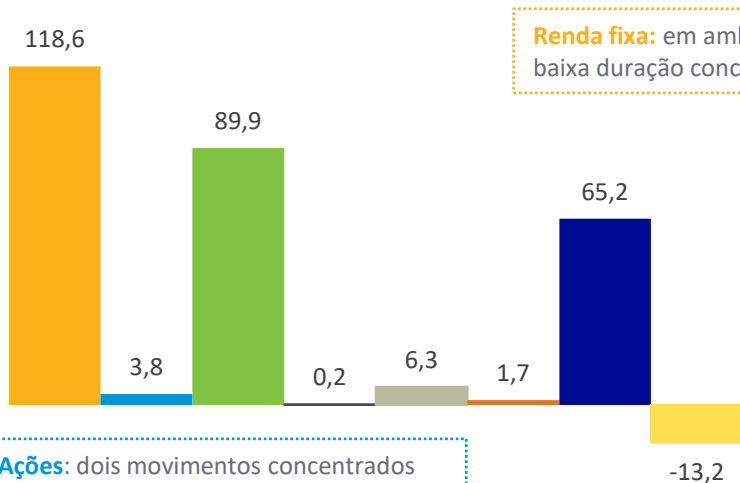


# CAPTAÇÃO LÍQUIDA ACUMULADA NO ANO – POR CLASSE

Ações e multimercados totalizam resgates líquidos de R\$ 111,3 bilhões

Total até jun/21: R\$ 272,5 bilhões

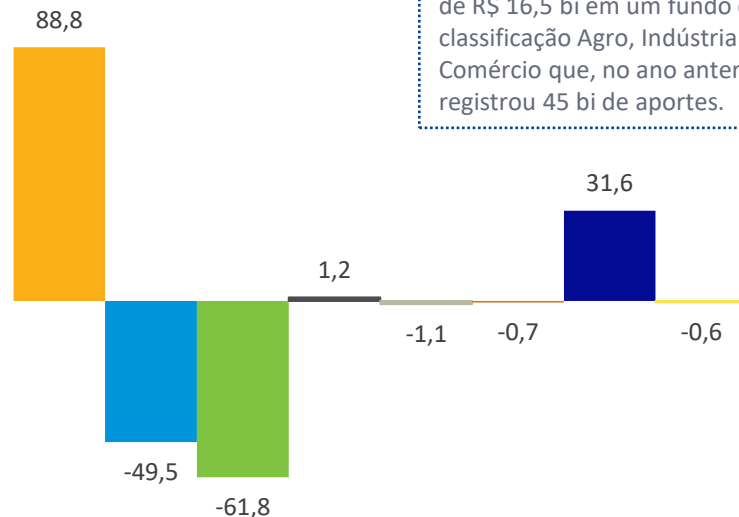
Total até jun/22: R\$ 8 bilhões



**Ações:** dois movimentos concentrados puxaram o resultado do período:

**Amortização de 43,9 bi** de um fundo de pensão e **mudança de classe** de um fundo que era de participações e passou a ser de ações no valor de **20 bi**.

**Renda fixa:** em ambos os períodos, os fundos DI e de baixa duração concentraram os aportes da classe.



**FIDC:** movimento concentrado de R\$ 16,5 bi em um fundo da classificação Agro, Indústria e Comércio que, no ano anterior, registrou 45 bi de aportes.

**Ações e multimercados:** movimentos pulverizados com destaque para os tipos de estratégia livre em ambas as classes.

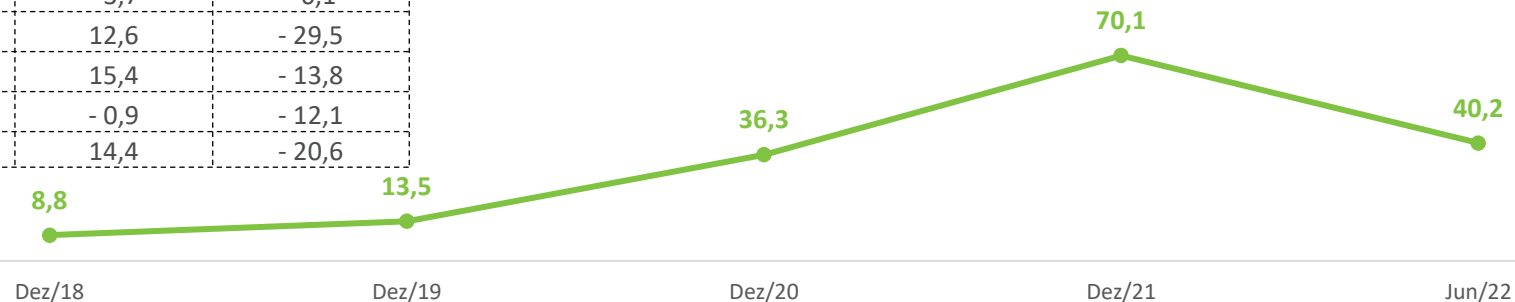
- Renda Fixa
- Ações
- Multimercados
- Cambial
- Previdência
- ETF
- FIDC
- FIP

# INVESTIMENTO NO EXTERIOR – DADOS GERAIS - R\$ BILHÕES

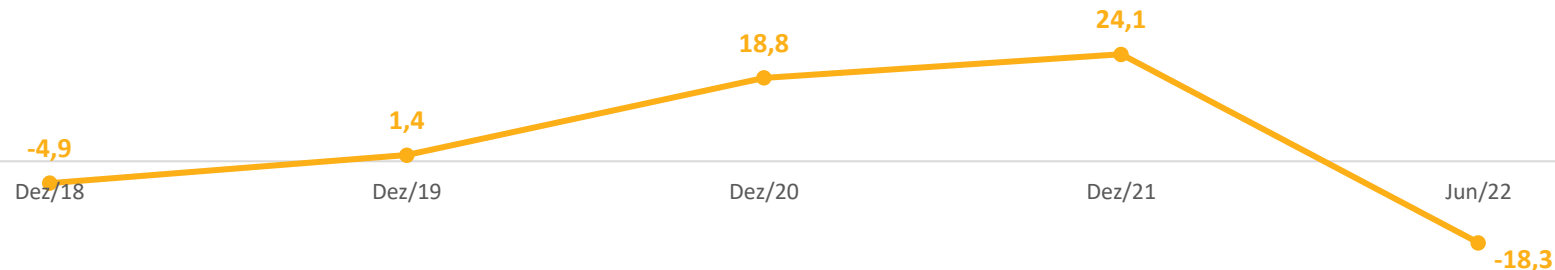
Fundos que investem mais de 67% no exterior têm resgates líquidos no primeiro semestre

	2021 até 30/06	2022 até 30/06
Dólar	- 3,7	- 6,1
Nasdaq	12,6	- 29,5
MSCI Europe	15,4	- 13,8
MSCI Asia	- 0,9	- 12,1
S&P 500	14,4	- 20,6

### PATRIMÔNIO LÍQUIDO (R\$ BILHÕES)



### CAPTAÇÃO LÍQUIDA ACUMULADA (R\$ BILHÕES)



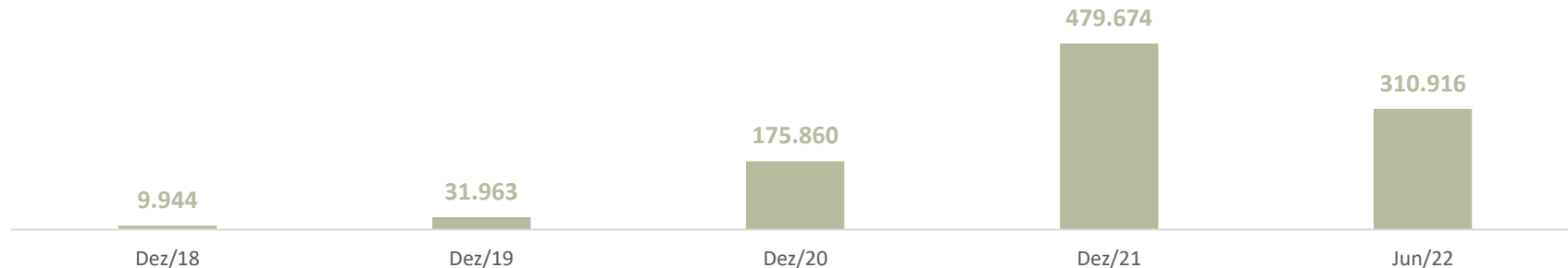
# INVESTIMENTO NO EXTERIOR – DADOS GERAIS

Número de fundos cresce mais de 500% na comparação com dezembro de 2018

## QUANTIDADE DE FUNDOS



## NÚMERO DE CONTAS



Foram considerados os fundos destinados a investidores qualificados que aplicam, no mínimo, 67% do seu patrimônio em ativos no exterior

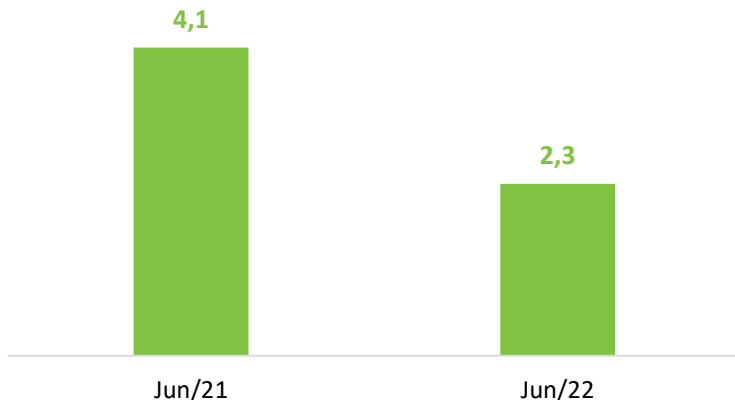
# INVESTIMENTO NO EXTERIOR – ETFs INTERNACIONAIS

Mesmo com índices internacionais em queda, aumenta o número de contas que investem em ETFs internacionais

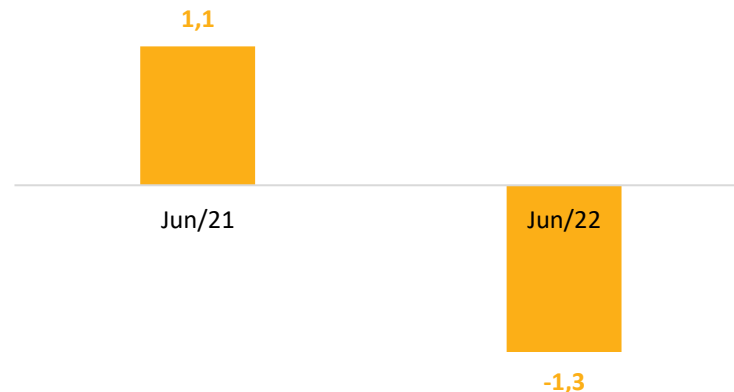
## NÚMERO DE CONTAS



## PATRIMÔNIO LÍQUIDO (R\$ BILHÕES)

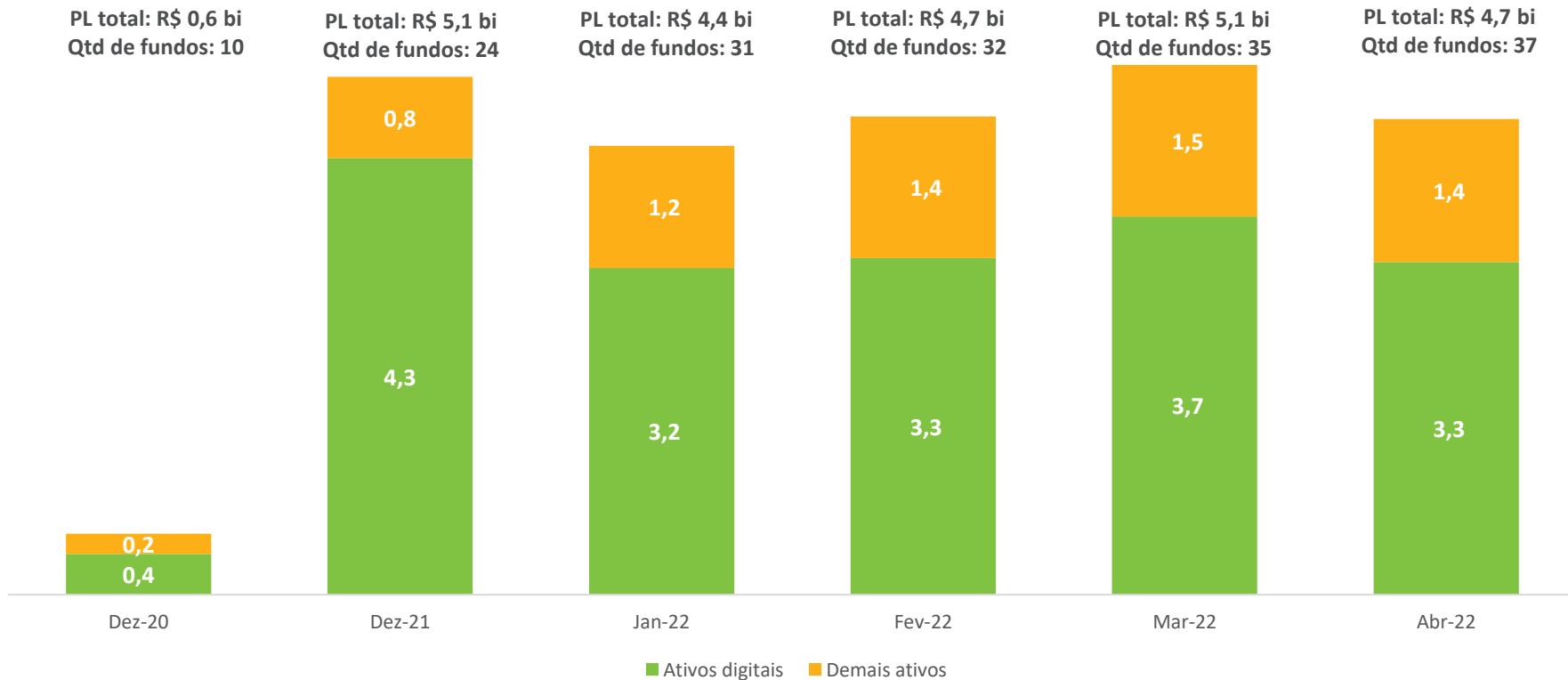


## CAPTAÇÃO LÍQUIDA ACUMULADA (R\$ BILHÕES)



# FUNDOS QUE APLICAM DIRETAMENTE EM ATIVOS DIGITAIS

Exposição em ativos digitais totaliza R\$ 3,3 bilhões em abril, com queda de 12% na comparação com março



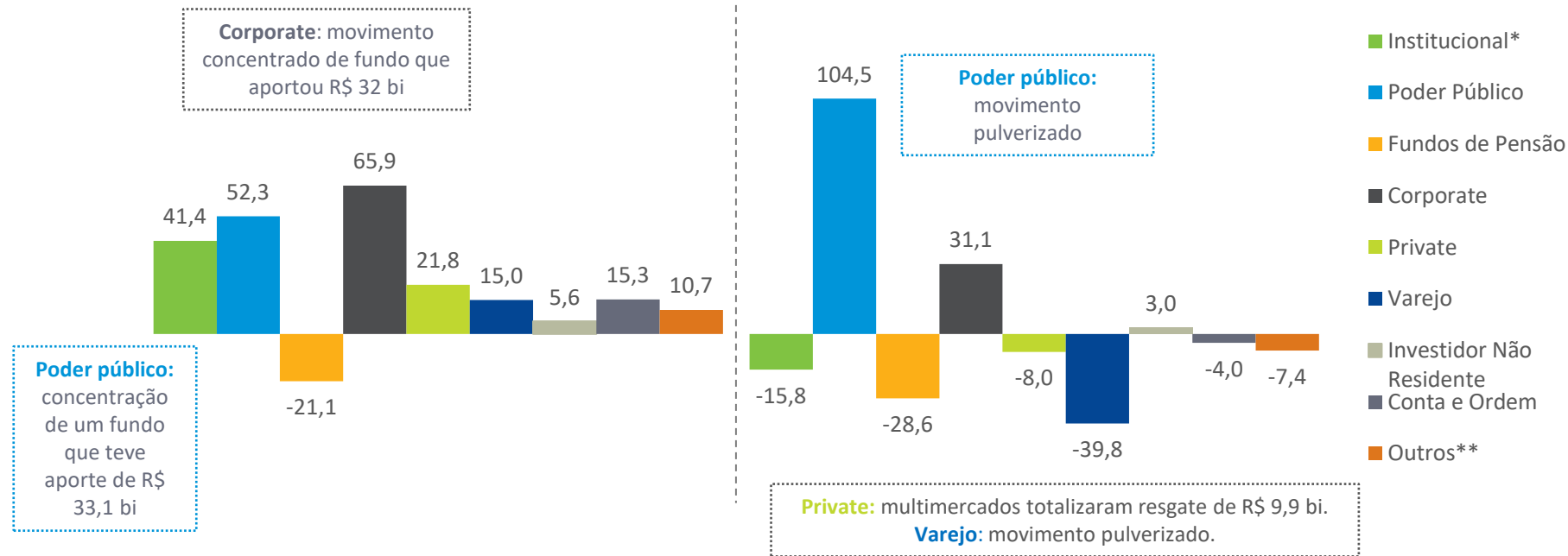


# CAPTAÇÃO LÍQUIDA ACUMULADA ATÉ MAIO – POR SEGMENTO DE INVESTIDOR

Varejo e private registram resgates líquidos de R\$ 47,8 bilhões

Total até maio/21: R\$ 206,8 bilhões

Total até maio/22: R\$ 35,0 bilhões



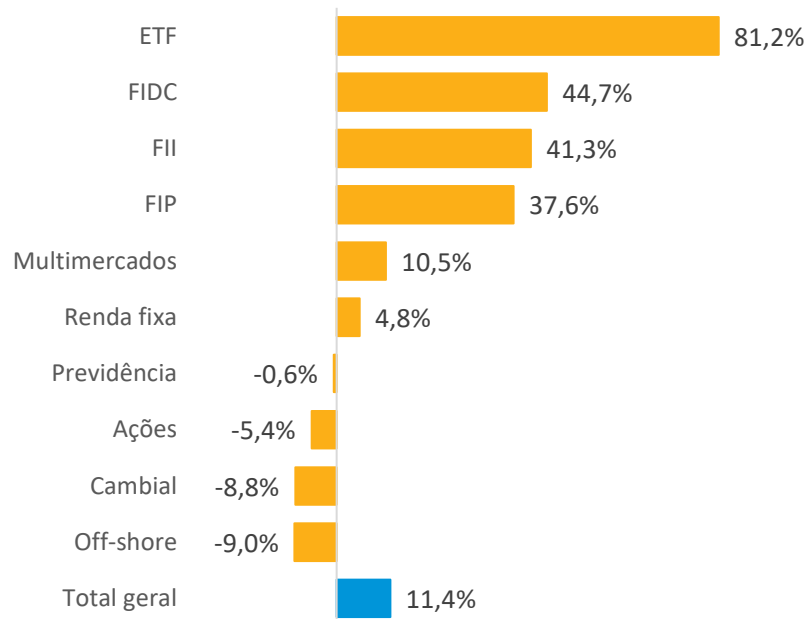
\* Institucional: EAPCs (Entidades Abertas de Previdência Complementar), seguradoras, fundos e capitalização

\*\* Outros inclui segmentos que não têm representatividade para abertura dos dados e/ou não identificados

# NÚMERO DE CONTAS – POR CLASSE

Mesmo com as altas da Selic, contas de fundos multimercados sobem 10,5%

## Variação % no período (mai/21 x mai/22)

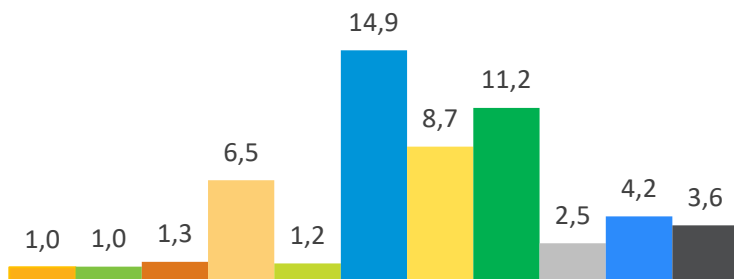


	mai/21	mai/22	Diferença
ETF	474.157	859.220	385.063
FIDC	23.377	33.836	10.459
FII	5.348.844	7.558.146	2.209.302
FIP	38.631	53.169	14.538
Multimercados	4.812.210	5.316.437	504.227
Renda fixa	10.037.606	10.523.583	485.977
Previdência	579.420	575.786	-3.634
Ações	6.906.334	6.535.545	-370.789
Cambial	122.161	111.360	-10.801
Off-shore	256	233	-23
<b>Total geral</b>	<b>28.342.996</b>	<b>31.567.315</b>	<b>3.224.319</b>

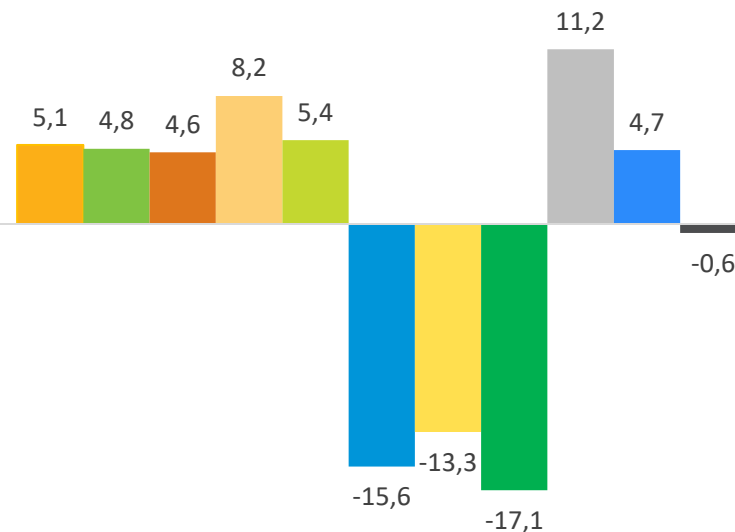
# RENTABILIDADE ACUMULADA (%) ATÉ JUNHO – TODAS AS CLASSES

Renda fixa tem retornos próximos ao DI, enquanto ações têm resultado abaixo do Ibovespa

## 2021 até junho



## 2022 até junho



	2021 até 30/06	2022 até 30/06
Dólar	-3,7	-6,1
IMA-Geral	0,1	4,5
IMA-B	-0,7	4,3
Ibovespa	6,5	-6,0
DI	1,3	5,4

RF Simples

RF Dur. Livre Crédito Livre

MM Macro

RF Dur. Baixa Soberano

Ações Small Caps

MM Livre

RF Dur. Alta Soberano

Ações Livre

MM Inv. no Exterior

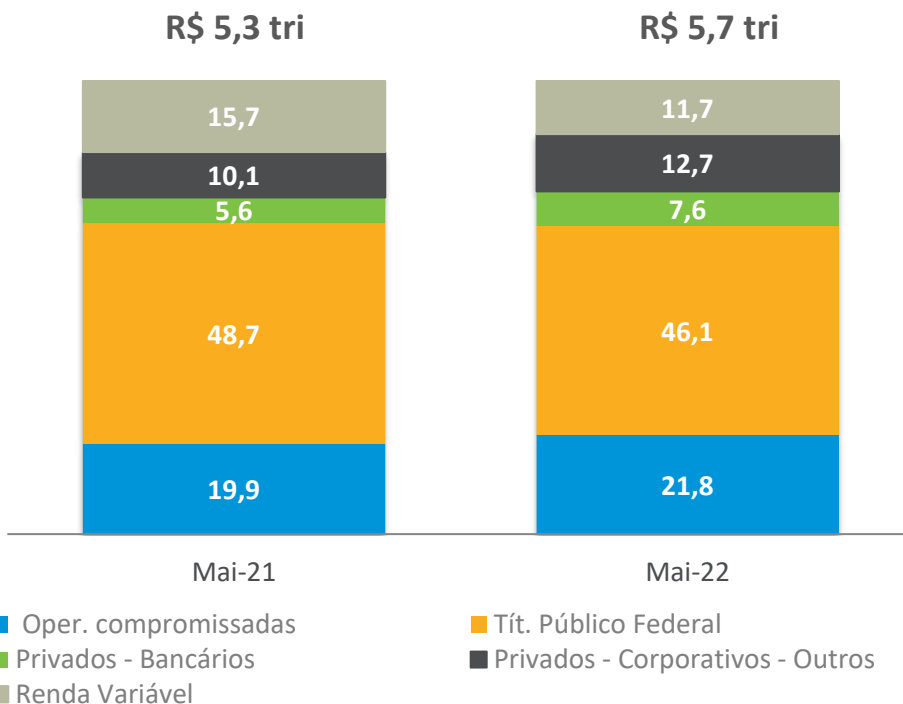
RF Dur. Alta Grau de Inv.

Ações Inv. no Exterior

# EVOLUÇÃO DOS ATIVOS DAS CARTEIRAS

Com Selic alta e mercado de ofertas de ações menos aquecido, aumenta a participação de crédito privado

## DADOS EM %



PL - R\$ Milhões	mai/21	mai/22	Var. %
Oper. Compromissadas	1.053.491,69	1.243.878,53	18,1
Tít. Públicos Federais	2.582.080,44	2.628.478,97	1,8
CDB/RDB	72.262,02	84.234,06	16,6
Letras Financeiras	215.186,46	340.068,41	58,0
DPGE	11.294,91	10.734,37	-5,0
Debêntures	217.732,79	331.157,00	52,1
Notas Promissórias	11.598,45	11.831,77	2,0
Direitos Creditórios	63.206,78	102.972,41	62,9
CCB/CCCB	1.972,24	7.164,81	263,3
Títulos Imob.	70.192,73	83.627,47	19,1
Inv. Exterior	66.609,89	54.170,36	-18,7
Outros	103.069,81	131.411,97	27,5
RV	830.009,45	666.444,67	-19,7
<b>Total</b>	<b>5.298.707,66</b>	<b>5.696.174,80</b>	<b>7,5</b>

## Regulação

- Continuar as conversas com o regulador sobre a implementação das novas regras de fundos (555, FIDC, FIP, fundos imobiliários e ETF);
- Elaborar proposta para regulação do Fiagro e revisão dos produtos para investidores (foco: FIP para varejo).

## Autorregulação

- Modernizar o Código de Administração de Recursos de Terceiros com a inclusão de regras para fundos com exposição a ativos digitais e a definição de critérios para identificação de fundos sustentáveis para outras classes (FIDCs, multimercados e FIPs);
- Revisão do Código de Serviços Qualificados.

## Dados e Informações

- Adequar as bases de dados à nova regulação de fundos de investimento e avaliar outros aprimoramentos necessários.

## Perguntas dos jornalistas



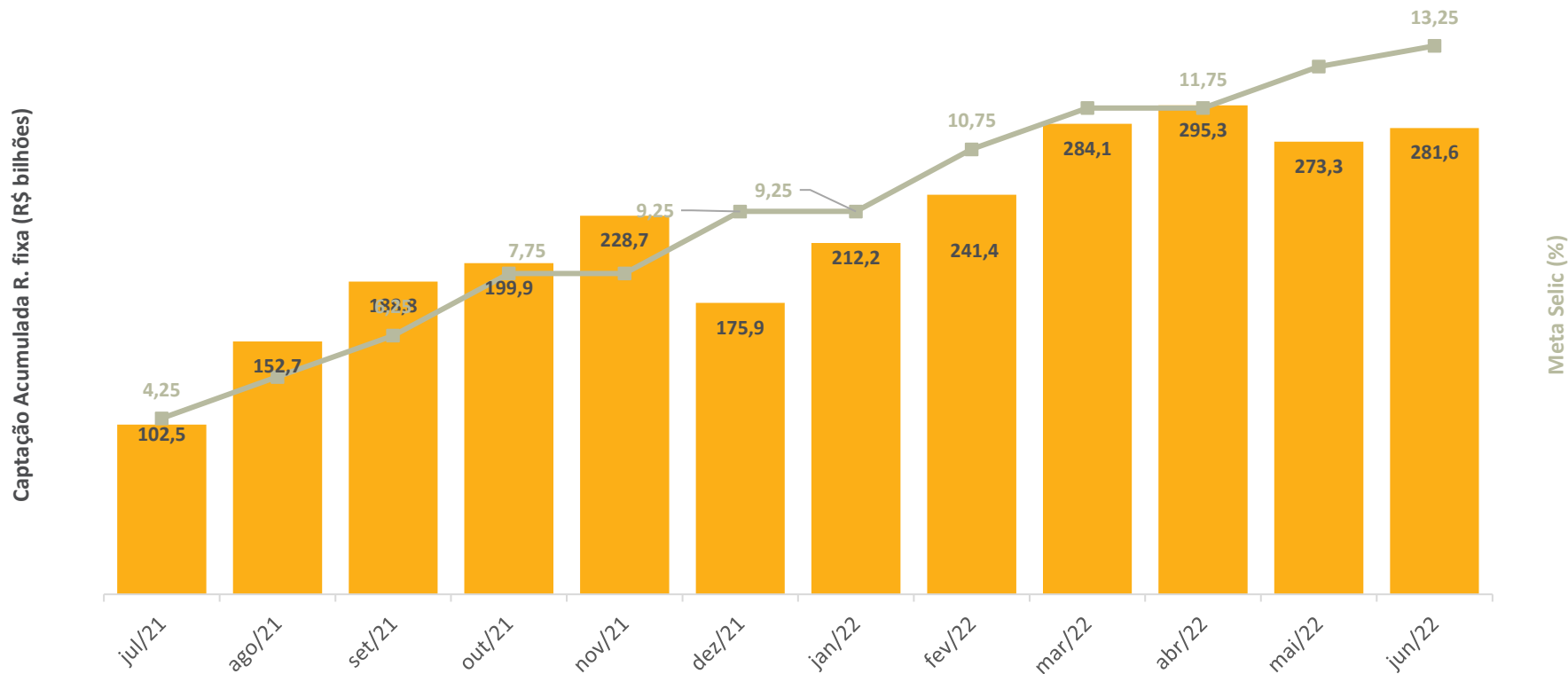
**ANEXO**



**ANBIMA**

# CAPTAÇÃO LÍQUIDA ACUMULADA – R. FIXA x SELIC (12 MESES)

Altas da Selic influenciam na captação da renda fixa, que atinge o total acumulado de R\$ 281,6 bi nos últimos 12 meses





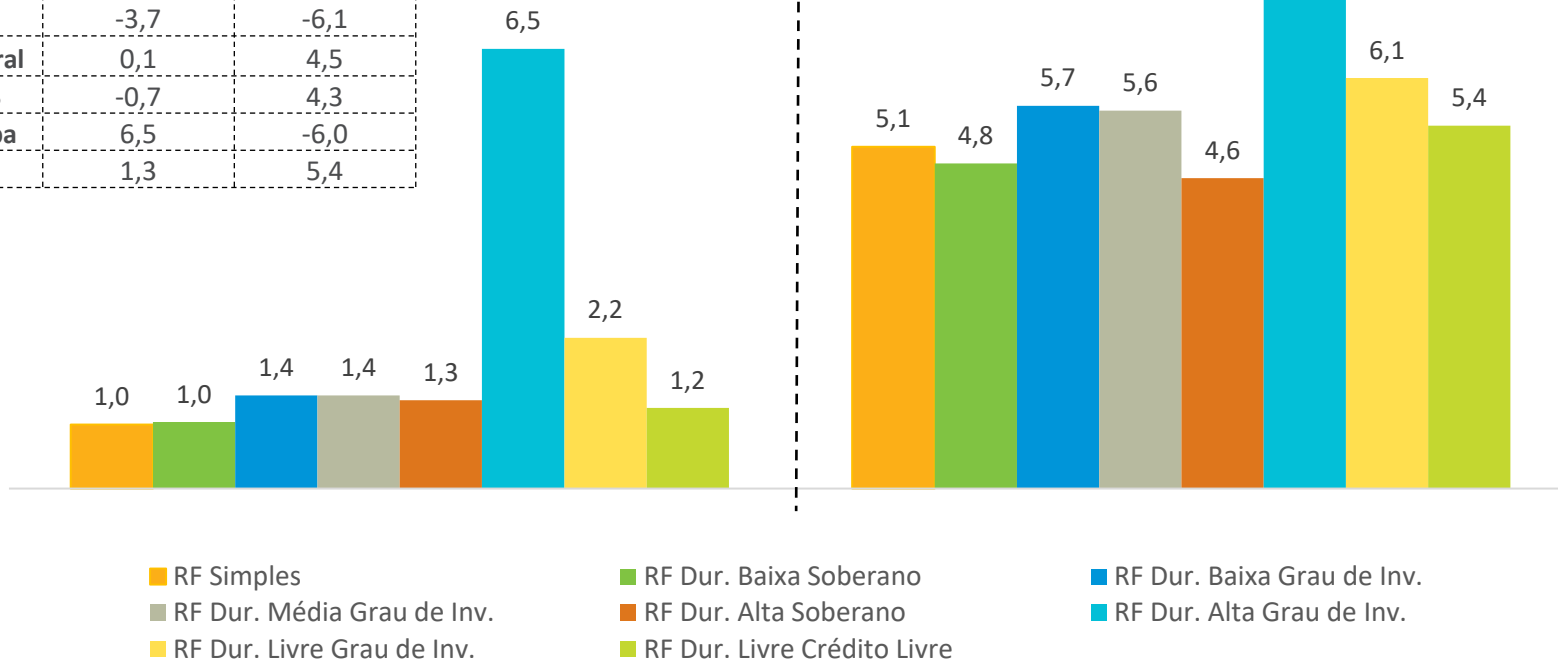
# RENTABILIDADE ACUMULADA (%) ATÉ JUNHO – RENDA FIXA

Fundos de renda fixa performaram acima do IMA-Geral

2021 até junho

2022 até junho

	2021 até 30/06	2022 até 30/06
Dólar	-3,7	-6,1
IMA-Geral	0,1	4,5
IMA-B	-0,7	4,3
Ibovespa	6,5	-6,0
DI	1,3	5,4



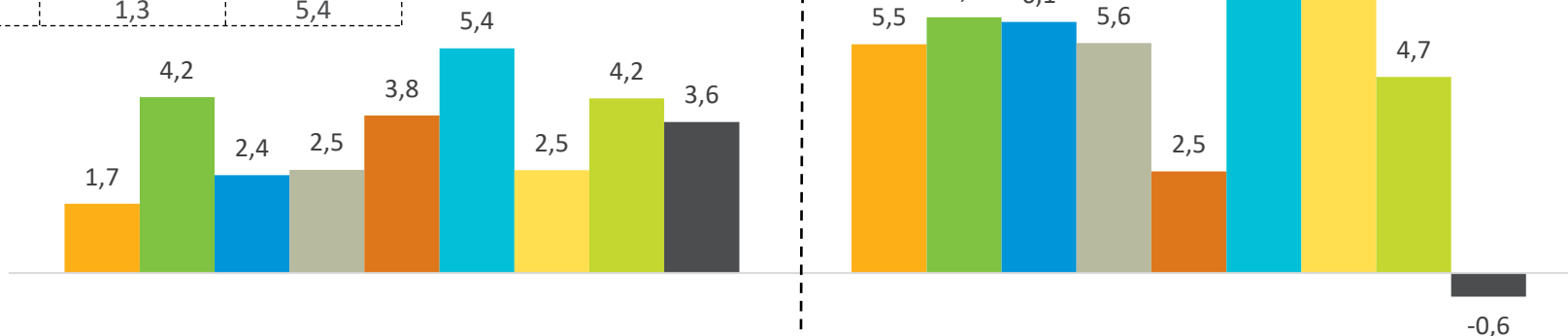
# RENTABILIDADE ACUMULADA (%) ATÉ JUNHO – MULTIMERCADOS

Todos os tipos de multimercado têm retornos positivos, com exceção do investimento no exterior

2021 até junho

2022 até junho

	2021 até 30/06	2022 até 30/06
Dólar	-3,7	-6,1
IMA-Geral	0,1	4,5
IMA-B	-0,7	4,3
Ibovespa	6,5	-6,0
DI	1,3	5,4

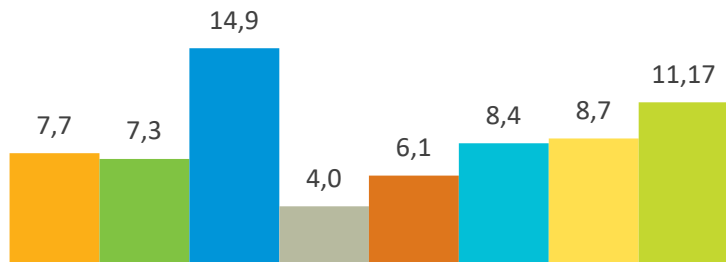


- MM Juros e Moedas
- MM Balanceados
- MM Dinâmico
- MM Trading
- MM L/S - Direcional
- MM L/S - Neutro
- MM Macro
- MM Livre
- MM Inv. no Exterior

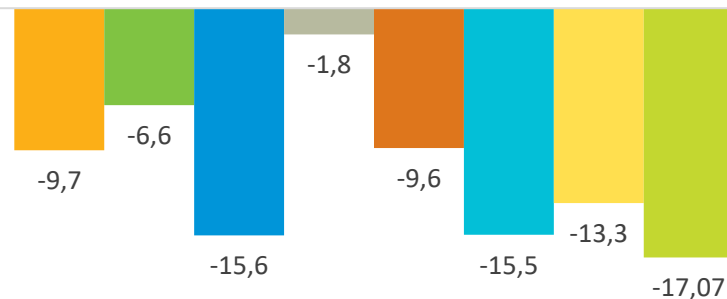
# RENTABILIDADE ACUMULADA (%) ATÉ JUNHO – AÇÕES

Quase todos os tipos de fundos de ações têm desempenho abaixo do Ibovespa

### 2021 até junho



### 2022 até junho



	2021 até 30/06	2022 até 30/06
Dólar	-3,7	-6,1
IMA-Geral	0,1	4,5
IMA-B	-0,7	4,3
Ibovespa	6,5	-6,0
DI	1,3	5,4

■ Ações Índice Ativo

■ Ações Indexados

■ Ações Small Caps

■ Ações Dividendos

■ Ações Sustent./Governança

■ Ações Valor/Crescimento

■ Ações Livre

■ Ações Inv. no Exterior

- **IMA-Geral:** representa todos os títulos que compõem a dívida pública brasileira.
- **IMA-B:** reflete os títulos públicos indexados à inflação medida pelo IPCA (Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo), que são as NTN-Bs (Notas do Tesouro Nacional – Série B ou Tesouro IPCA+ com Juros Semestrais).

**Rio de Janeiro**

*Praia de Botafogo, 501, bloco II,  
conjunto 704  
22250-042 Rio de Janeiro RJ Brasil  
+ 55 21 2104-9300*

**São Paulo**

*Av. das Nações Unidas, 8.501 21º andar  
05425-070 São Paulo SP Brasil  
+ 55 11 3471 4200*



**ANBIMA**