



Relatório mensal de fundos de investimento por classificação ANBIMA – maio/2021

Patrimônio da indústria tem crescimento de 1,77% no mês.
Fundos de Ações têm crescimento de 4,77%.

CONFIRA O ESTUDO EXCLUSIVO ECONOMATICA

Relatório mensal de fundos de investimento por classificação ANBIMA – maio/2021– Patrimônio da indústria tem crescimento de 1,77% no mês. Fundos de Ações têm crescimento de 4,77%

Com base nos dados disponíveis na plataforma de fundos da Economática (fonte CVM/ANBIMA), elaboramos relatório de desempenho dos fundos de investimento no mês de maio de 2021. Para a elaboração do relatório foram consideradas as seguintes condições:

– Os cálculos de patrimônio líquido, captação líquida e a rentabilidade de cada tipo excluem os Fundos em Cotas (FC) e Fundos de investimento em cotas master (FM), evitando assim a dupla contagem. Conforme recomendação da ANBIMA no item 2 do relatório mensal desta instituição e comentários da ANBIMA ao relatório que é gerado pela Economática.

– A mediana da rentabilidade por classificação considera todos os fundos com dados disponíveis até cinco dias anteriores à data de corte. FIDC's,

FIPS, Fundos Imobiliários e Fundos Off Shore não fazem parte da amostra.

– Consideramos a data de corte sempre o último dia calendário de cada mês. Assim, para o mês de abril, por exemplo, foram tomados os últimos dados disponíveis no mês de todos os fundos; estes dados poderiam estar entre os dias 27 e 31 de maio.

– Excepcionalmente neste relatório excluímos o fundo BB Carteira Ativa do Banco do Brasil por ter efetuado um resgate de R\$ 43,8 bilhões no mês de janeiro/21 referente à posição das ações da Litel e Litela, o que acaba distorcendo as amostras de 12 meses e no ano de 2021.

Fundos de ações

No mês de maio os fundos de ações têm crescimento pelo quarto mês consecutivo, aumento de 4,77%. Em fevereiro tivemos crescimento de 0,42%, março o crescimento foi de 3,55% e em abril de 5,19%.

Sete categorias têm crescimento de patrimônio acima dos 5%. Os fundos Ações mono ação com crescimento de 15,42% têm o melhor desempenho, seguidos pelos Fundos de Ações índice ativo com 8,28% e Ações indexados com 8,15%.

Os fundos Ações setoriais tem o menor desempenho com crescimento de 2,86%.

O patrimônio dos fundos de ações em março registra crescimento de R\$ 31,9 bilhões, fechando maio com R\$ 700,6 bilhões.

A captação líquida dos fundos de ações em maio é positiva em R\$ 6,39 bilhões, puxada pelos fundos de Ações Invest. no Exterior com captação de R\$ 3,17 bilhões. Já os fundos Ações valor/crescimento têm a maior queda, com R\$ 526,0 milhões de captação líquida negativa.

Os fundos de mono ação registram na mediana o melhor desempenho no mês de maio com valorização de 13,61%. Nove categorias de fundos de ações na mediana têm rentabilidade superior a 5%. Os fundos de Ações

Invest. no Exterior têm o menor desempenho, na mediana têm valorização de 2,89%, seguidos pelos fundos fechados de ações com 3,40% de rentabilidade.

Excepcionalmente neste relatório excluímos o fundo BB Carteira Ativa do Banco do Brasil por ter efetuado um resgate de R\$ 43,8 bilhões no mês de janeiro referente à posição das ações da Litel e Litela, o que distorce as amostras de 12 meses e no ano de 2021.

A valorização do Ibovespa no mês de maio é de 6,16%, somente três categorias têm rentabilidade acima do índice de referência.

| Ações | | | | | | | | | | | | |
|-----------------------------------|------------------------------|--------------------|-------------|---------------------------|-------|----------|------------------------------|-------------------|-------------------|-----------------------------|--------|----------|
| Data base 31 de Maio de 2021 | | | | | | | | | | | | |
| Classificação ANBIMA | Patrimônio Líquido (R\$ 000) | | | Mediana Rentabilidade (%) | | | Captação Líquida (R\$ - 000) | | | Mediana Premio vs IBOV p.p. | | |
| | 30/04/2021 | 31/05/2021 | Variação % | Mês | Ano | 12 Meses | Mês | Ano | 12 Meses | Mês | Ano | 12 Meses |
| Ações | 668.740.026 | 700.658.783 | 4,77 | | | | 6.393.165 | 33.184.157 | 57.811.425 | | | |
| Fundos de Mono Ação | 8.835.357 | 10.198.075 | 15,42 | 13,61 | -4,51 | 31,58 | 480.599 | 1.263.212 | 872.628 | 7,45 | -10,56 | -12,83 |
| Ações Setoriais | 36.682.221 | 37.732.963 | 2,86 | 6,36 | 8,17 | 41,04 | 26.685 | -1.869.245 | -1.378.981 | 0,20 | 2,12 | -3,37 |
| Ações Small Caps | 8.902.809 | 9.572.358 | 7,52 | 6,23 | 10,34 | 55,75 | 69.742 | -609.210 | -774.557 | 0,07 | 4,29 | 11,35 |
| Ações Indexados | 15.658.301 | 16.934.240 | 8,15 | 6,03 | 6,01 | 44,67 | 306.799 | 2.005.388 | 1.361.425 | -0,13 | -0,03 | 0,26 |
| Ações Valor/Crescimento | 31.593.981 | 32.713.393 | 3,54 | 5,88 | 6,08 | 42,15 | -526.029 | -2.396.516 | -3.478.404 | -0,28 | 0,03 | -2,26 |
| Ações Índice Ativo | 61.223.689 | 66.291.387 | 8,28 | 5,82 | 6,55 | 43,74 | 920.136 | 4.274.142 | 5.439.338 | -0,34 | 0,50 | -0,67 |
| Ações Dividendos | 11.470.674 | 11.907.186 | 3,81 | 5,54 | 4,38 | 35,77 | -161.564 | -1.151.074 | -1.024.187 | -0,62 | -1,67 | -8,64 |
| Ações Sustentabilidade/Governança | 2.346.140 | 2.482.657 | 5,82 | 5,41 | 0,64 | 24,06 | 16.278 | 267.917 | 692.046 | -0,75 | -5,41 | -20,35 |
| Ações FMP - FGTS | 6.927.520 | 7.405.040 | 6,89 | 5,23 | 3,00 | 32,51 | -74.350 | -332.332 | -604.756 | -0,93 | -3,04 | -11,89 |
| Ações Livre | 292.254.713 | 304.960.482 | 4,35 | 4,75 | 6,74 | 40,56 | 2.154.002 | 15.634.655 | 28.684.510 | -1,41 | 0,69 | -3,85 |
| Fechados de Ações | 39.306.742 | 41.786.300 | 6,31 | 3,40 | 5,81 | 37,49 | 1.450 | 590.110 | 1.636.931 | -2,75 | -0,23 | -6,92 |
| Ações Invest. no Exterior | 153.537.879 | 158.674.702 | 3,35 | 2,89 | 6,47 | 38,22 | 3.179.417 | 15.507.110 | 26.385.432 | -3,27 | 0,42 | -6,19 |

O Patrimônio Líquido, a captação líquida e a rentabilidade de cada tipo inclui os Fundos em Cotas (FC) e Fundos de investimento em cotas master (FM), evitando assim a dupla contagem.

Fundos de Investimento regidos pela ICVM 555/14, ICVM 141/91 e ICVM 359/02

A mediana da rentabilidade e do prêmio por classificação considera todos os fundos com dados disponíveis até 5 dias anteriores à data de corte

Fonte Economática.com

Fundos Multimercados

Em maio e pelo nono mês consecutivo o patrimônio dos fundos multimercado registra crescimento: no mês de setembro foi de 0,13%, outubro de 0,52%, novembro de 1,57%, dezembro 1,86%, janeiro/21 com 0,30%, fevereiro com 0,90%, março com 1,28%, abril 1,61% e maio 1,38%. Os Multimercados L/S – Neutro têm o maior crescimento com 2,29%. Quatro categorias têm recuo de patrimônio, os Multimercados balanceados registram a maior queda de patrimônio com -20,78%.

No mês de maio temos o quarto mês de captação positiva, em fevereiro a captação foi de R\$ 10,4 bilhões, em março de R\$ 8,24 bilhões, abril R\$ 12,4 bilhões e maio de R\$ 6,30 bilhões, que é o menor valor da série.

O carro chefe em captação líquida no mês de maio foram os fundos Multimercados Invest. no Exterior com R\$ 6,51 bilhões, seguidos pelos Multimercados livre com R\$ 2,42 bilhões. Na contramão estão os fundos

Multimercados balanceados com queda de R\$ -2,02 bilhões e

Multimercados macro com queda de R\$ -582,19 milhões.

Os fundos Multimercados L/S – Direcional têm o melhor desempenho, pois na mediana valorizaram 1,01%, o que representa 372,44% do CDI.

Em maio na mediana todas as categorias têm rentabilidade acima do CDI.

Em 12 meses, os Multimercados L/S – Neutro têm a menor rentabilidade com 117,71% do CDI.

Os fundos multimercado livre têm a maior captação líquida em 12 meses até o mês de maio de 2021 com R\$ 92,4 bilhões e os multimercado macro vão na contramão com captação líquida negativa de R\$ 7,69 bilhões.

| Multimercados | | | | | | | | | | | | |
|-----------------------------------|------------------------------|----------------------|-------------|---------------------------|------|----------|------------------------------|-------------------|--------------------|-------------------------|--------|----------|
| Data base 31 de Maio de 2021 | | | | | | | | | | | | |
| Classificação ANBIMA | Patrimônio Líquido (R\$ 000) | | | Mediana Rentabilidade (%) | | | Captação Líquida (R\$ - 000) | | | Mediana Premio vs CDI % | | |
| | 30/04/2021 | 31/05/2021 | Variação % | Mês | Ano | 12 Meses | Mês | Ano | 12 Meses | Mês | Ano | 12 Meses |
| Multimercados | 1.512.778.737 | 1.533.726.422 | 1,38 | | | | 6.304.628 | 63.322.525 | 161.320.897 | | | |
| Multimercados L/S - Direcional | 12.986.242 | 13.043.077 | 0,44 | 1,01 | 2,60 | 6,32 | -230.358 | -1.270.675 | -1.632.934 | 372,44 | 268,97 | 290,16 |
| Multimercados Balanceados | 9.250.071 | 7.327.490 | -20,78 | 0,88 | 1,85 | 7,93 | -2.026.252 | -2.759.591 | -2.886.024 | 324,41 | 190,85 | 364,11 |
| Multimercados Invest. no Exterior | 606.967.294 | 615.038.011 | 1,33 | 0,87 | 2,53 | 11,75 | 6.517.927 | 37.776.603 | 61.872.950 | 320,06 | 261,82 | 539,26 |
| Multimercados Livre | 572.096.902 | 584.734.317 | 2,21 | 0,77 | 1,63 | 8,45 | 2.422.462 | 29.360.189 | 92.440.518 | 283,29 | 168,67 | 387,83 |
| Multimercados Trading | 4.900.065 | 4.841.675 | -1,19 | 0,74 | 2,53 | 8,88 | -98.521 | -632.454 | -534.977 | 274,70 | 261,55 | 407,32 |
| Multimercados Dinâmico | 19.718.148 | 19.384.341 | -1,69 | 0,71 | 1,66 | 7,68 | -467.659 | 321.233 | 1.019.961 | 262,83 | 172,16 | 352,37 |
| Multimercados Macro | 183.630.662 | 184.624.122 | 0,54 | 0,70 | 1,63 | 8,20 | -582.193 | -2.589.170 | -7.696.455 | 259,98 | 168,67 | 376,40 |
| Multimercados Estrat. Especifica | 47.683.081 | 48.432.270 | 1,57 | 0,61 | 2,38 | 9,60 | 311.164 | 2.564.367 | 8.632.000 | 225,54 | 245,98 | 440,34 |
| Multimercados L/S - Neutro | 2.681.854 | 2.743.340 | 2,29 | 0,37 | 1,02 | 2,56 | 60.790 | -79.374 | -110.505 | 138,69 | 105,20 | 117,71 |
| Multimercados Juros e Moedas | 52.101.789 | 52.796.513 | 1,33 | 0,35 | 0,92 | 2,68 | 405.289 | 611.401 | 10.166.517 | 128,71 | 94,97 | 123,01 |
| Multimercados Capital Protegido | 762.629 | 761.266 | -0,18 | 0,27 | 0,64 | 3,18 | -8.021 | 19.996 | 49.846 | 98,97 | 65,74 | 145,81 |

O Patrimônio Líquido, a captação líquida e a rentabilidade de cada tipo exclui os Fundos em Cotas (FC) e Fundos de investimento em cotas master (FM), evitando assim a dupla contagem.

Fundos de Investimento regidos pela ICVM 555/14, ICVM 141/91 e ICVM 359/02

A mediana da rentabilidade e do prêmio por classificação considera todos os fundos com dados disponíveis até 5 dias anteriores à data de corte

Fonte Economática.com

Fundos Renda Fixa

Pelo sexto mês consecutivo os fundos de renda fixa têm crescimento de patrimônio, em dezembro de 2020 o crescimento foi de R\$ 21,7 bilhões ou 1,0%, janeiro de 2021 de R\$ 36,14 bilhões ou 1,65%, fevereiro com R\$ 19,4 bilhões ou 0,87%, março de R\$ 19,6 bilhões ou 0,87%, abril com crescimento de R\$ 16,5 bilhões ou 0,73% e maio com crescimento de R\$ 22,86 bilhões ou 1,49%. Os fundos de RF fecham o mês de maio com patrimônio de R\$ 2,32 trilhões.

A captação líquida em maio é positiva pelo sexto mês consecutivo, em dezembro foi positiva em R\$ 2,75 bilhões, janeiro R\$ 28,9 bilhões, fevereiro R\$ 18,5 bilhões, março R\$ 9,33 bilhões, abril R\$ 8,18 bilhões e maio de R\$ 22,4 bilhões.

Oito categorias tiveram saída de recursos em maio. Os Renda Fixa Indexados queda de R\$ 6,82 bilhões, Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre queda de R\$ 1,84 bilhão e Renda Fixa Duração Média Grau de Invest. com queda de R\$ 1,31 bilhão.

Os fundos Renda Fixa Duração Baixa Soberano têm a maior captação líquida, com R\$ 19,2 bilhões.

Os fundos de Renda Fixa Duração Alta Soberano têm o melhor desempenho em maio, na mediana valorizaram 0,99%.

Três categorias têm rentabilidade na mediana abaixo do CDI e duas têm rentabilidade negativa.

| Renda Fixa | | | | | | | | | | | | |
|--|------------------------------|----------------------|-------------|---------------------------|-------|----------|------------------------------|--------------------|--------------------|-------------------------|--------|----------|
| Data base 31 de Maio de 2021 | | | | | | | | | | | | |
| Classificação ANBIMA | Patrimônio Líquido (R\$ 000) | | | Mediana Rentabilidade (%) | | | Captação Líquida (R\$ - 000) | | | Mediana Premio vs CDI % | | |
| | 30/04/2021 | 31/05/2021 | Variação % | Mês | Ano | 12 Meses | Mês | Ano | 12 Meses | Mês | Ano | 12 Meses |
| Renda fixa | 2.287.239.610 | 2.321.209.053 | 1,49 | | | | 22.480.119 | 100.478.614 | 202.940.010 | | | |
| Renda Fixa Duração Alta Soberano | 15.408.074 | 15.688.145 | 1,82 | 0,99 | -0,82 | 9,55 | 136.691 | 685.219 | 4.053.951 | 364,44 | -84,66 | 438,31 |
| Renda Fixa Duração Alta Grau de Invest. | 118.491.990 | 127.316.702 | 7,45 | 0,92 | 0,44 | 8,49 | 6.716.715 | 8.353.473 | 10.412.249 | 341,14 | 45,75 | 389,75 |
| Renda Fixa Duração Alta Crédito Livre | 547.484 | 570.161 | 4,14 | 0,74 | 0,13 | 7,97 | 19.210 | 97.409 | 146.858 | 273,45 | 13,33 | 365,84 |
| Renda Fixa Indexados | 194.234.036 | 188.663.725 | -2,87 | 0,64 | -0,94 | 7,08 | -6.826.737 | -29.767.407 | 17.711.409 | 237,30 | -97,40 | 324,76 |
| Renda Fixa Duração Baixa Crédito Livre | 22.850.894 | 24.329.270 | 6,47 | 0,45 | 1,82 | 5,01 | 1.386.304 | 1.937.853 | 3.101.579 | 164,52 | 188,23 | 229,91 |
| Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre | 116.779.621 | 115.805.328 | -0,83 | 0,43 | 1,43 | 6,11 | -1.848.026 | 1.487.067 | 10.221.389 | 160,56 | 147,62 | 280,32 |
| Renda Fixa Duração Média Crédito Livre | 4.348.313 | 4.332.182 | -0,37 | 0,40 | 2,06 | 6,89 | -31.646 | -242.176 | -326.859 | 148,53 | 213,49 | 316,10 |
| Renda Fixa Duração Livre Soberano | 148.736.525 | 149.103.786 | 0,25 | 0,38 | 0,85 | 2,07 | -491.785 | 15.018.081 | 12.750.144 | 140,37 | 87,75 | 94,85 |
| Renda Fixa Duração Livre Grau de Invest. | 473.709.414 | 476.175.584 | 0,52 | 0,36 | 0,95 | 3,15 | -253.745 | 5.024.595 | 30.171.624 | 134,35 | 98,05 | 144,45 |
| Renda Fixa Duração Média Grau de Invest. | 67.276.885 | 66.175.242 | -1,64 | 0,34 | 1,10 | 2,62 | -1.311.694 | -2.013.742 | -5.969.811 | 124,84 | 113,89 | 120,23 |
| Renda Fixa Duração Baixa Grau de Invest. | 505.284.195 | 508.981.035 | 0,73 | 0,30 | 0,96 | 2,17 | 2.119.889 | 648.043 | -40.528.186 | 111,73 | 99,07 | 99,49 |
| Renda Fixa Duração Média Soberano | 5.474.419 | 5.364.491 | -2,01 | 0,29 | 0,86 | 1,92 | -124.105 | -682.251 | -411.272 | 107,48 | 89,29 | 87,98 |
| Renda Fixa Simples | 56.162.988 | 59.760.338 | 6,41 | 0,28 | 0,87 | 1,74 | 3.458.486 | 11.392.403 | 17.005.815 | 105,21 | 89,77 | 79,99 |
| Renda Fixa Duração Baixa Soberano | 551.477.614 | 572.345.971 | 3,78 | 0,27 | 0,84 | 1,71 | 19.281.396 | 86.465.669 | 139.970.832 | 98,26 | 87,04 | 78,70 |
| Renda Fixa Invest. no Exterior | 5.924.256 | 6.105.875 | 3,07 | -0,44 | 0,88 | 5,91 | 276.399 | 2.065.825 | 4.557.990 | -164,32 | 90,55 | 271,13 |
| Renda Fixa Dívida Externa | 532.902 | 491.218 | -7,82 | -2,87 | 0,16 | 1,59 | -27.233 | 8.553 | 72.298 | -1.061,40 | 16,42 | 72,82 |

O Patrimônio Líquido, a captação líquida e a rentabilidade de cada tipo exclui os Fundos em Cotas (FC) e Fundos de investimento em cotas master (FM), evitando assim a dupla contagem.
Fundos de Investimento regidos pela ICVM 555/14, ICVM 141/91 e ICVM 359/02
A mediana da rentabilidade e do prêmio por classificação considera todos os fundos com dados disponíveis até 5 dias anteriores à data de corte
Fonte Economática.com

Fundos de Previdência

Os fundos de previdência registram crescimento de 0,81% de patrimônio, ficando com patrimônio de R\$ 1,01 trilhão em 31 de maio de 2021.

Em maio a captação líquida consolidada dos fundos de previdência é positiva quebrando uma sequência de três meses consecutivos de queda, em fevereiro a queda foi de R\$ -681,2 milhões, março de R\$ -1,35 bilhão, abril -R\$ 3,40 bilhões e em maio positiva em R\$ 491,2 milhões.

Os fundos de Previdência Multimercado Livre têm a maior captação líquida em maio com R\$ 5,68 bilhões, seguidos pelos Previdência RF Duração Baixa Grau de Inv. com captação líquida de R\$ 2,65 bilhões. Na contramão, os fundos de Previdência RF Duração Média Grau de Inv. têm

captação líquida negativa de R\$ -3,39 bilhões e os de Previdência RF Duração Baixa Soberano de R\$ -2,21 bilhões.

Os fundos de Previdência Ações Indexados têm o melhor desempenho no mês de maio, na mediana a rentabilidade é de 5,83%, seguidos pelos fundos Previdência Multimercados com 5,70%.

Em 12 meses quatro categorias têm na mediana rentabilidade abaixo do CDI e dezoito categorias têm rentabilidade acima do CDI.

| Previdência | | | | | | | | | | | | |
|--|------------------------------|----------------------|-------------|---------------------------|-------|----------|------------------------------|------------------|-------------------|-------------------------|---------|----------|
| Data base 31 de Maio de 2021 | | | | | | | | | | | | |
| Classificação ANBIMA | Patrimônio Líquido (R\$ 000) | | | Mediana Rentabilidade (%) | | | Captação Líquida (R\$ - 000) | | | Mediana Premio vs CDI % | | |
| | 30/04/2021 | 31/05/2021 | Variação % | Mês | Ano | 12 Meses | Mês | Ano | 12 Meses | Mês | Ano | 12 Meses |
| Previdência | 1.008.499.931 | 1.016.704.935 | 0,81 | | | | 491.222 | 5.831.700 | 43.961.795 | | | |
| Previdência Ações Indexados | 17.514.293 | 18.659.311 | 6,54 | 5,83 | 6,00 | 43,56 | 93.687 | 1.611.016 | -1.267.412 | 2.156,88 | 620,60 | 1999,01 |
| Previdência Multimercados | 1.236.122 | 1.378.795 | 11,54 | 5,70 | 6,45 | 36,88 | 70.247 | 158.977 | -27.276 | 2.107,75 | 667,06 | 1692,70 |
| Previdência Ações Ativo | 19.863.192 | 21.636.540 | 8,93 | 5,57 | 6,00 | 40,73 | 655.303 | 2.749.602 | 5.396.584 | 2.061,21 | 620,93 | 1868,93 |
| Previdência Balanceados de 30-49 | 599.590 | 618.506 | 3,15 | 2,51 | 2,16 | 15,77 | 1.670 | -17.051 | 10.430 | 926,55 | 223,03 | 723,75 |
| Previdência Balanceados Data Alto | 761.050 | 787.382 | 3,46 | 2,13 | 0,49 | 14,79 | 10.135 | 51.961 | 135.433 | 788,77 | 51,01 | 678,64 |
| Previdência Balanceados de 15-30 | 320.479 | 323.114 | 0,82 | 1,63 | 1,40 | 9,26 | -1.363 | -10.399 | -33.486 | 601,04 | 145,00 | 424,82 |
| Previdência Balanceados até 15 | 497.969 | 503.669 | 1,14 | 1,05 | 0,62 | 6,15 | -571 | 36.115 | 111.413 | 389,65 | 64,25 | 282,03 |
| Previdência Multimercado Livre | 155.968.637 | 163.309.031 | 4,71 | 1,02 | 1,63 | 9,47 | 5.685.570 | 32.292.140 | 57.986.564 | 377,39 | 169,09 | 434,82 |
| Previdência Balanceados acima de 49 | 39.032 | 37.693 | -3,43 | 0,97 | 0,49 | 7,75 | -1.759 | 1.066 | 1.257 | 357,31 | 50,59 | 355,50 |
| Previdência RF Duração Alta Soberano | 2.128.073 | 2.131.206 | 0,15 | 0,93 | -1,37 | 8,53 | -13.310 | -250.869 | 206.735 | 342,19 | -141,92 | 391,55 |
| Previdência RF Data Alto | 10.639.323 | 9.819.416 | -7,71 | 0,79 | -1,56 | 7,72 | -886.435 | -1.355.005 | -2.829.077 | 292,06 | -161,52 | 354,07 |
| Previdência RF Indexados | 120.396.397 | 123.058.998 | 2,21 | 0,67 | -1,33 | 7,28 | 1.765.416 | 24.392.303 | 23.199.219 | 247,02 | -137,65 | 333,87 |
| Previdência RF Duração Alta Grau de Inv. | 45.861.449 | 44.845.177 | -2,22 | 0,55 | -0,81 | 3,24 | -1.214.622 | -4.950.367 | -243.291 | 201,80 | -83,97 | 148,47 |
| Previdência RF Duração Baixa Grau de Inv | 47.785.942 | 50.626.692 | 5,94 | 0,42 | 1,29 | 3,39 | 2.654.601 | 8.370.235 | 9.186.696 | 153,70 | 133,45 | 155,52 |
| Previdência RF Duração Livre Grau de Inv | 223.397.895 | 222.477.351 | -0,41 | 0,40 | 0,98 | 3,41 | -2.047.353 | -8.237.981 | 12.299.544 | 147,23 | 101,47 | 156,41 |
| Previdência RF Duração Livre Crédito Liv | 23.802.653 | 24.432.964 | 2,65 | 0,39 | 1,44 | 6,04 | 512.318 | 3.134.993 | 3.359.408 | 143,82 | 148,91 | 277,24 |
| Previdência RF Duração Baixa Crédito Liv | 1.458.501 | 1.478.728 | 1,39 | 0,37 | 0,96 | 2,67 | 14.294 | 65.338 | 65.121 | 138,06 | 99,76 | 122,75 |
| Previdência RF Duração Média Grau de Inv | 145.293.175 | 142.442.338 | -1,96 | 0,35 | 0,74 | 2,33 | -3.399.605 | -12.909.269 | -28.698.603 | 128,09 | 76,41 | 106,75 |
| Previdência RF Duração Baixa Soberano | 130.835.466 | 129.036.329 | -1,38 | 0,29 | 0,83 | 1,89 | -2.213.550 | -26.763.531 | -28.129.021 | 107,68 | 85,93 | 86,75 |
| Previdência RF Duração Livre Soberano | 59.057.429 | 57.993.333 | -1,80 | 0,29 | 0,58 | 1,68 | -1.269.783 | -12.771.541 | -7.338.738 | 106,41 | 60,48 | 76,91 |
| Previdência RF Duração Média Soberano | 487.458 | 493.435 | 1,23 | 0,26 | 0,94 | 2,05 | 4.720 | 60.168 | 214.388 | 94,32 | 96,87 | 93,93 |
| Previdência Multimercados Juros e Moedas | 555.806 | 614.927 | 10,64 | 0,20 | 0,94 | 1,57 | 71.612 | 173.799 | 355.907 | 75,36 | 96,95 | 71,92 |

O Patrimônio Líquido, a captação líquida e a rentabilidade de cada tipo exclui os Fundos em Cotas (FC) e Fundos de investimento em cotas master (FM), evitando assim a dupla contagem.
Fundos de Investimento regidos pela ICVM 555/14, ICVM 141/91 e ICVM 359/02
A mediana da rentabilidade e do prêmio por classificação considera todos os fundos com dados disponíveis até 5 dias anteriores à data de corte
Fonte Economática.com

Fundos ETF's e Cambial

Em maio, os fundos de ETF's registram crescimento de patrimônio de 7,58% e os cambiais crescimento de 3,21%.

A captação líquida em maio dos fundos cambiais é de R\$ 489,5 milhões e os fundos de ETF's têm captação R\$ 1,06 bilhão.

Em maio os fundos cambiais na mediana têm valorização de 3,21% e os fundos de ETF's na mediana valorização de 7,58%.

| ETF's e Cambial | | | | | | | | | | | | |
|--------------------------------|------------------------------|-------------------|-------------|---------------------------|-------------|--------------|------------------------------|-----------------|-------------------|-------------------------|--------------|----------------|
| Data base 31 de Maio de 2021 | | | | | | | | | | | | |
| Classificação ANBIMA | Patrimônio Líquido (R\$ 000) | | | Mediana Rentabilidade (%) | | | Captação Líquida (R\$ - 000) | | | Mediana Premio vs CDI % | | |
| | 30/04/2021 | 31/05/2021 | Variação % | Mês | Ano | 12 Meses | Mês | Ano | 12 Meses | Mês | Ano | 12 Meses |
| Fundos de índices - ETF | 32.192.516 | 34.633.157 | 7,58 | 5,74 | 6,02 | 44,32 | 1.067.084 | -738.572 | -4.696.161 | 2.124,8 | 622,4 | 2.034,0 |
| Cambial | 7.192.911 | 7.424.033 | 3,21 | -3,65 | 0,85 | -2,72 | 489.512 | 748.994 | 498.519 | -1.351,2 | 87,6 | -124,9 |

O Patrimônio Líquido, a captação líquida e a rentabilidade de cada tipo exclui os Fundos em Cotas (FC) e Fundos de investimento em cotas master (FM), evitando assim a dupla contagem.
Fundos de Investimento regidos pela ICVM 555/14, ICVM 141/91 e ICVM 359/02
A mediana da rentabilidade e do prêmio por classificação considera todos os fundos com dados disponíveis até 5 dias anteriores à data de corte
Fonte Economática.com

Fundos Investimento consolidado

Em maio o patrimônio líquido consolidado da indústria tem crescimento de 1,77%. Os fundos de índices ETF's têm o maior crescimento com 7,58%, seguidos pelos fundos de ações com 4,77%. Os fundos de previdência registram o menor crescimento com 0,81%.

A captação líquida consolidada em maio é de R\$ 37,22 bilhões. Os fundos de renda fixa têm a maior captação líquida com R\$ 22,48 bilhões, seguidos pelos fundos de ações com R\$ 6,39 bilhões e os fundos multimercados com captação de R\$ 6,30 bilhões. Os fundos cambiais têm a menor captação líquida com R\$ 489,5 milhões e os fundos de previdência com R\$ 491,2 bilhões.

Em 12 meses os fundos de índices ETF's são os únicos a registrar captação líquida negativa com R\$ -4,69 bilhões. Todas as demais categorias têm captação líquida positiva, os fundos de renda fixa lideram com R\$ 202,9 bilhões, seguidos pelos fundos multimercados com R\$ 161,32 bilhões, ações com R\$ 57,8 bilhões e previdência com R\$ 43,9 bilhões.

| Fundos de Investimento - Não considera Fundos estruturados e Off Shore | | | | | | |
|--|------------------------------|----------------------|-------------|------------------------------|--------------------|--------------------|
| Classificação ANBIMA | Patrimônio Líquido (R\$ 000) | | | Captação Líquida (R\$ - 000) | | |
| | 30/04/2021 | 31/05/2021 | Variação % | Mês | Ano | 12 Meses |
| Fundos de índices - ETF | 32.192.516 | 34.633.157 | 7,58 | 1.067.084 | -738.572 | -4.696.161 |
| Ações | 668.740.026 | 700.658.783 | 4,77 | 6.393.165 | 33.184.157 | 57.811.425 |
| Cambial | 7.192.911 | 7.424.033 | 3,21 | 489.512 | 748.994 | 498.519 |
| Renda fixa | 2.287.239.610 | 2.321.209.053 | 1,49 | 22.480.119 | 100.478.614 | 202.940.010 |
| Multimercados | 1.512.778.737 | 1.533.726.422 | 1,38 | 6.304.628 | 63.322.525 | 161.320.897 |
| Previdência | 1.008.499.931 | 1.016.704.935 | 0,81 | 491.222 | 5.831.700 | 43.961.795 |
| Total Fundos de Investimento | 5.516.643.731 | 5.614.356.383 | 1,77 | 37.225.730 | 202.827.418 | 461.836.485 |

Fonte Economatica.com

Caso deseje personalizar o estudo e seja usuário da nossa solução, entre em contato com nosso suporte pelo telefone 011 40813800 ou pelo e-mail info@economica.com.br para que possamos lhe auxiliar na elaboração do levantamento. Se ainda não for usuário da nossa plataforma solicite um trial.

SAIBA MAIS



Receba nossos estudos pelas redes sociais.



Caso você queira sair da lista de e-mails [clique aqui](#).