

PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Fevereiro - 2023



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios
Gestão
Patrimônio
Custódia Centralizada
Data do início
Data

2008.0008-18
Viva Previdência
R\$ 613.617.420
Banco BTG Pactual
31/12/2020
28/02/2023

Política de Investimento

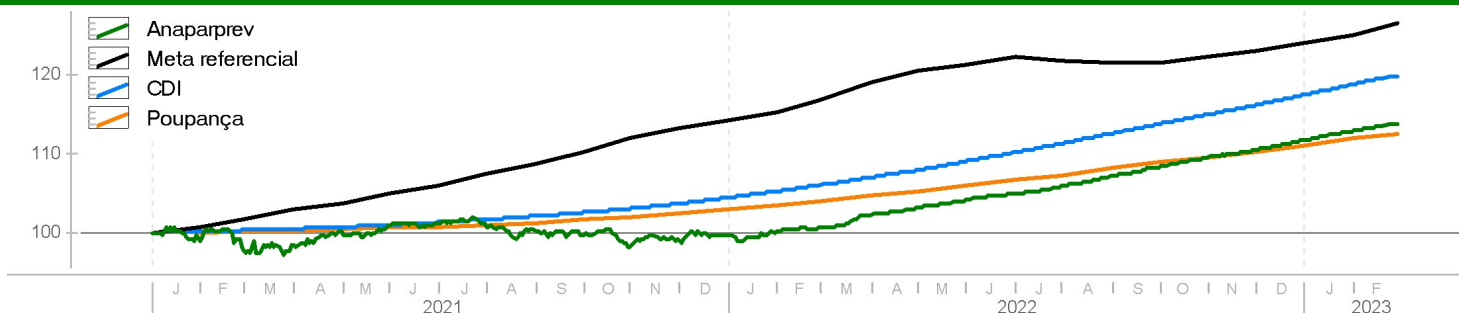
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo. A composição da carteira utiliza-se de alocação diversificada em renda fixa, renda variável, multimercados, imobiliário e exterior.

Rentabilidades (%) (até 28/02/2023)

	fev 2023	jan 2023	dez 2022	nov 2022	out 2022	set 2022	2023	2022	6m
● Anaparprev	0,83	1,05	1,07	0,91	1,04	1,17	1,89	11,93	6,22
Meta referencial	1,15	0,83	0,89	0,58	0,67	-0,12	1,99	8,49	4,06
● CDI	0,92	1,12	1,12	1,02	1,02	1,07	2,05	12,39	6,44
● Poupança	0,61	0,71	0,71	0,65	0,65	0,68	1,33	7,90	4,08

Obs.: De 01/21 a 04/21, os dados de rentabilidade foram fornecidos pela Petros, período em que o plano estava sob sua gestão

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	12
Meses Negativos	0
Meses Acima do CDI	5
Meses Abaixo do CDI	7
Maior Retorno Mensal (%)	1,50
Menor Retorno Mensal (%)	0,76
Retorno Acumulado (%)	13,00
Retorno Acumulado (% CDI)	99,96

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	0,63
Sharpe (12 meses)	-0,00
VAR 21 dias	0,11
Máximo Draw down	0,00
Alfa de Jensen	-0,00

Comentários

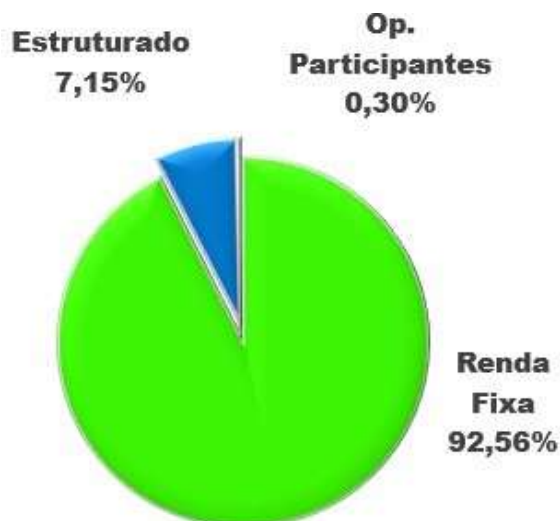
Nos mercados globais, o mês de fevereiro foi marcado pela piora do ambiente macroeconômico e reversão do otimismo do início do ano de 2023. A divulgação de indicadores de inflação acima do esperado e o mercado de trabalho aquecido, sinalizou continuidade do aperto monetário e manutenção dos juros altos por mais tempo nos Estados Unidos e na Europa. Na China, após o anúncio do fim da política de Covid Zero, os primeiros números de atividade já mostram que a economia está retomando o crescimento.

No ambiente doméstico, além dos fatores externos, os principais vetores que influenciaram a trajetória dos mercados no mês foram a incerteza quanto a nova política fiscal, as discussões a respeito de uma possível revisão da meta de inflação e as revisões para cima das projeções de inflação no boletim Focus do Banco Central, que refletiram em retornos negativos, principalmente, para os ativos de maior risco.

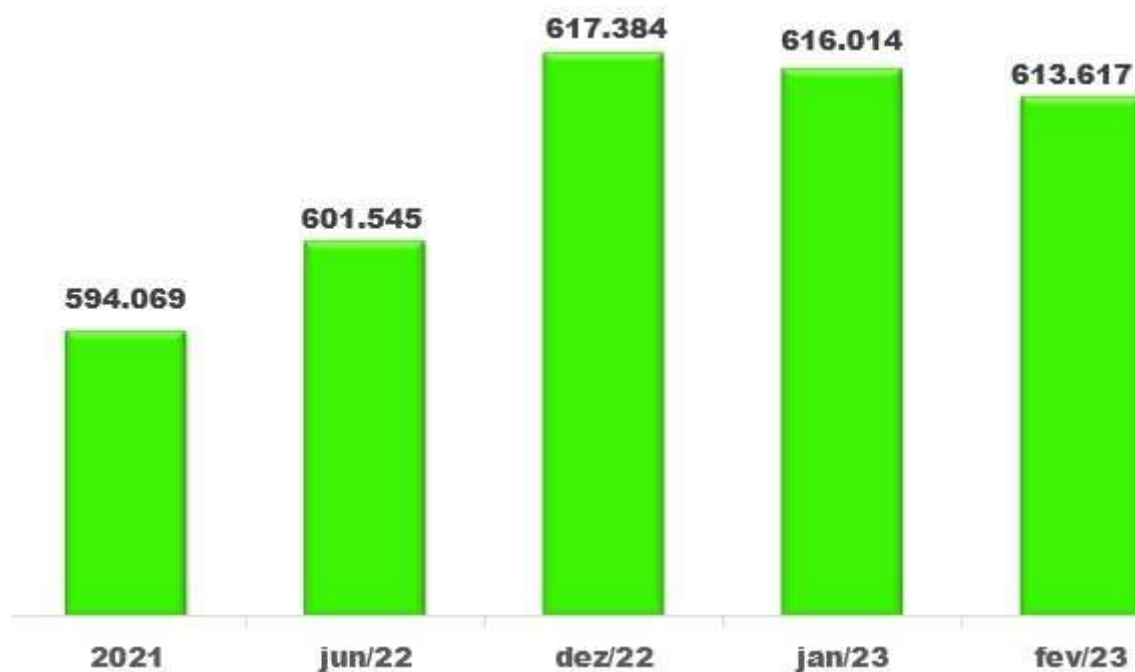
Diante desse cenário desafiador, o Ibovespa seguiu os mercados externos e encerrou o mês de fevereiro com desvalorização de 7,49%, revertendo a alta do mês anterior. No mercado de renda fixa, refletindo a perspectiva de aumento de inflação, os títulos públicos atrelados à inflação de curto prazo (NTN-B) voltaram a apresentar performance positiva, superior ao CDI, enquanto os títulos de longo prazo registraram retorno positivo, porém abaixo do CDI, em decorrência das incertezas com a proposta a ser apresentada da nova política fiscal. Os ativos atrelados ao CDI renderam 0,92% no mês. O Real desvalorizou frente ao Dólar na esteira de menor aversão a risco global no mês.

O Plano Anaparprev obteve uma valorização das cotas em 0,83%, no mês de fevereiro, inferior ao índice de referência, que foi de 1,15%. No ano, o Plano obteve ganho de 1,89%, o que representou 95% da meta referencial e equivalente a 92% CDI.

No mês, os destaques positivos da carteira foram os fundos de investimentos que alocaram em títulos públicos atrelados à inflação de curto prazo (NTN-B) e os ativos de renda fixa vinculados à taxa de juros pós-fixada (títulos públicos remunerados pela Selic – LFT).



Evolução Patrimonial - Valores em mil (R\$)



Disclaimer

As informações contidas nesta Lamina são de caráter exclusivamente informativo.

Os investimentos do Plano tem horizonte de retorno de médio e longo prazo, podendo apresentar flutuações nos valores das cotas no curto prazo.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de resultados futuros.

A Fundação VIVA de Previdência, administradora do Plano, adota normas e melhores práticas emanadas pela certificação do Selo de Autorregulação em Governança e Investimentos (ABRAPP/ICSS/SINDAPP).

Maiores informações sobre o Plano, estarão contidas no RAI - Relatório Anual de Informações.

A meta referencial em 2021 é de INPC+3,72% a.a.

A meta referencial em 2022 é de INPC+2,42% a.a.

A meta referencial em 2023 é de IPCA + 3,70% a.a.