

PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Julho - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 605.919.714
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	31/12/2018
Data	29/07/2022

Política de Investimento

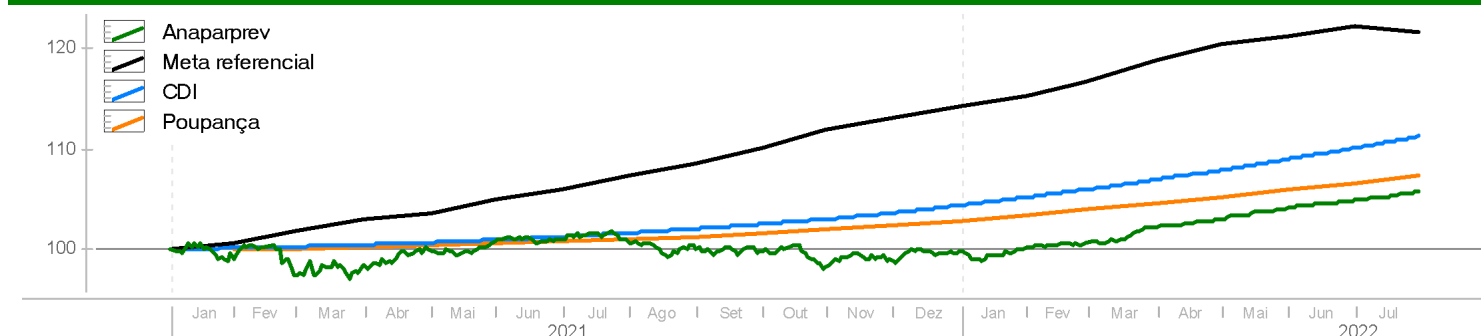
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

Rentabilidades (%) (até 31/07/2022)

	ago 2021	set 2021	out 2021	nov 2021	dez 2021	jan 2022	fev 2022	mar 2022	abr 2022	mai 2022	jun 2022	jul 2022	2020	2021	2022	6m
● Anaparprev	-0,48	-0,34	-1,58	0,68	0,92	0,42	0,50	1,50	0,87	1,01	0,76	0,86	2,75	-0,26	6,07	5,62
● Meta referencial	1,18	1,51	1,47	1,15	1,04	0,87	1,20	1,91	1,24	0,65	0,82	-0,40	9,75	14,27	6,45	5,53
● CDI	0,43	0,44	0,49	0,59	0,77	0,73	0,76	0,93	0,83	1,03	1,02	1,03	2,76	4,42	6,51	5,73
● Poupança	0,24	0,30	0,36	0,44	0,49	0,56	0,50	0,60	0,56	0,67	0,65	0,66	2,11	2,99	4,27	3,69

Obs.: De 01/19 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	9
Meses Negativos	3
Meses Acima do CDI	4
Meses Abaixo do CDI	8
Maior Retorno Mensal (%)	1,50
Menor Retorno Mensal (%)	-1,58
Retorno Acumulado (%)	5,20
Retorno Acumulado (% CDI)	55,20

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	2,88
Sharpe (12 meses)	-1,52
VAR 21 dias	0,20
Máximo Draw down	-1,91
Alfa de Jensen	-4,78

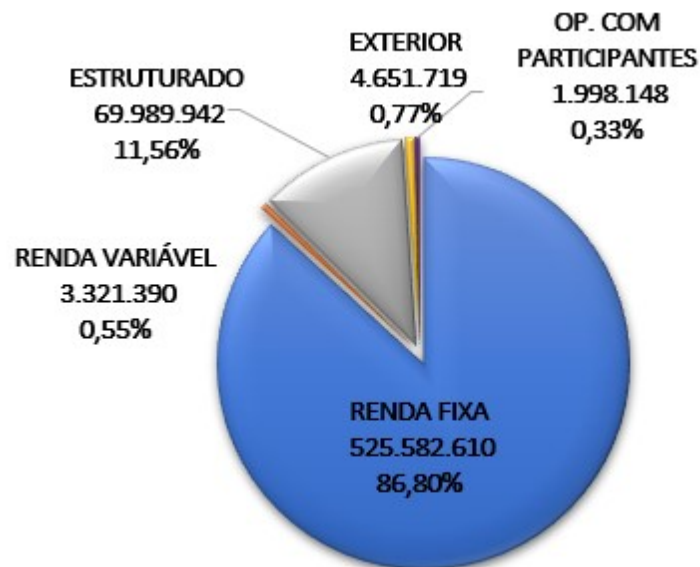
Comentários

O mês foi de recuperação nos mercados financeiros mundiais em decorrência, principalmente, da indicação do movimento de desaceleração suave da economia estadunidense, ante a um cenário de recessão, diante dos bons resultados apresentados pelo mercado de trabalho nos EUA. No Brasil, as revisões altistas para o crescimento em 2022, o fortalecimento do mercado de trabalho e a expectativa de proximidade do fim do ciclo de altas de juros, devido a previsão de queda de inflação no curto prazo justificada pela redução de impostos adotado pelo governo, corroboraram como o cenário mais otimista no mercado doméstico.

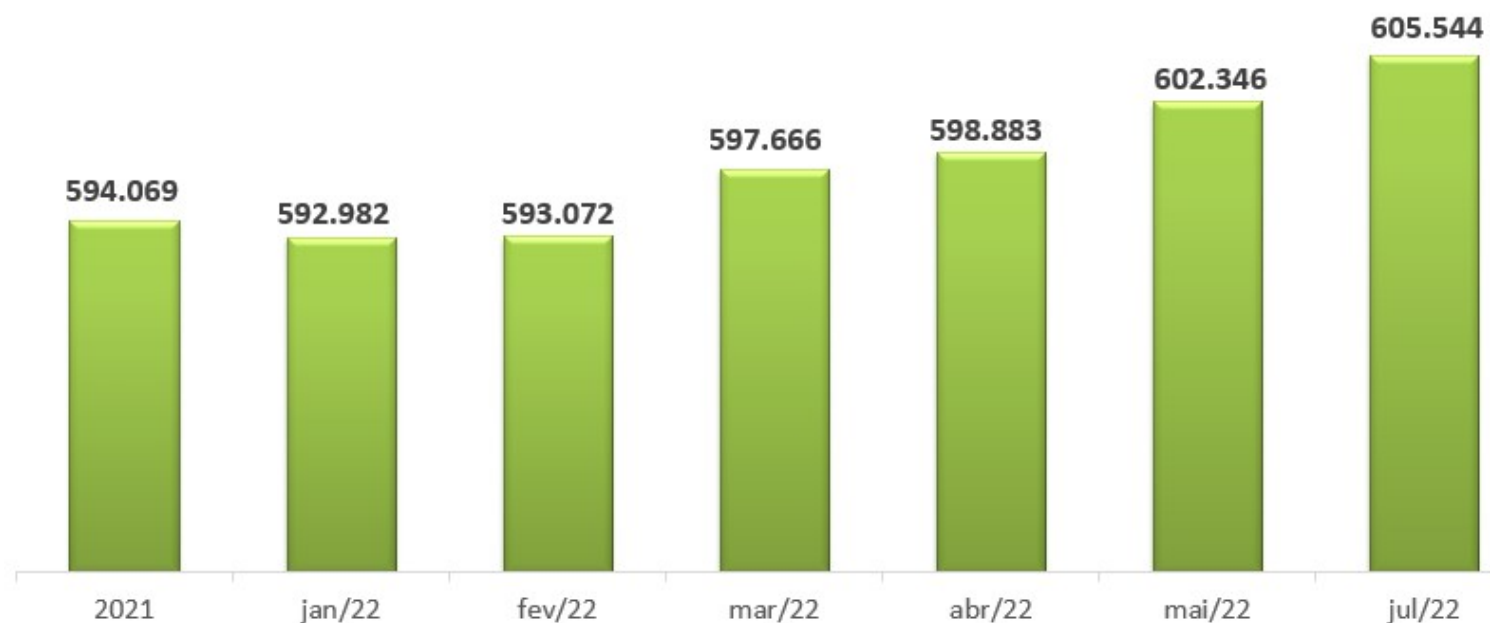
Nesse ambiente de menor aversão a risco global, houve redução dos juros nominais internos, enfraquecimento do dólar ante o Real e valorização dos principais índices acionários. Acompanhando o mercado externo, o IBOVESPA registrou alta de 4,69%. o Dólar americano teve queda ante o Real de -0,96%, fechando o mês cotado a R\$ 5,18, apesar da valorização do Dólar frente as outras principais moedas mundiais. Por fim, a curva de juros prefixada fechou, o que reflete em uma valorização dos títulos indexados a taxa prefixada, sendo que o IRF-M (índice da carteira de títulos públicos prefixados) registrou ganho de 1,15% e superou o CDI, 1,03% no mês, com a expectativa da política monetária mais acomodatória. A curva de juros reais (IPCA) registrou abertura, o que reflete em uma perda dos títulos indexados a esta taxa, principalmente na parte longa, devido as preocupações com a questão fiscal.

O Plano Anaparprev alcançou uma valorização de 0,86%, no mês de julho, superior ao índice referencial, que foi de -0,40%. No acumulado do ano até julho, o Plano registrou ganho de 6,07%, equivalente a 94% CDI e do índice referencial. O segmento de renda fixa pós fixados vinculados ao CDI foi o que mais contribuiu para a performance positiva no mês.

Distribuição por Segmentos



Evolução Patrimonial - 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..