

PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Outubro - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 619.990.900
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	31/12/2018
Data	31/10/2022

Política de Investimento

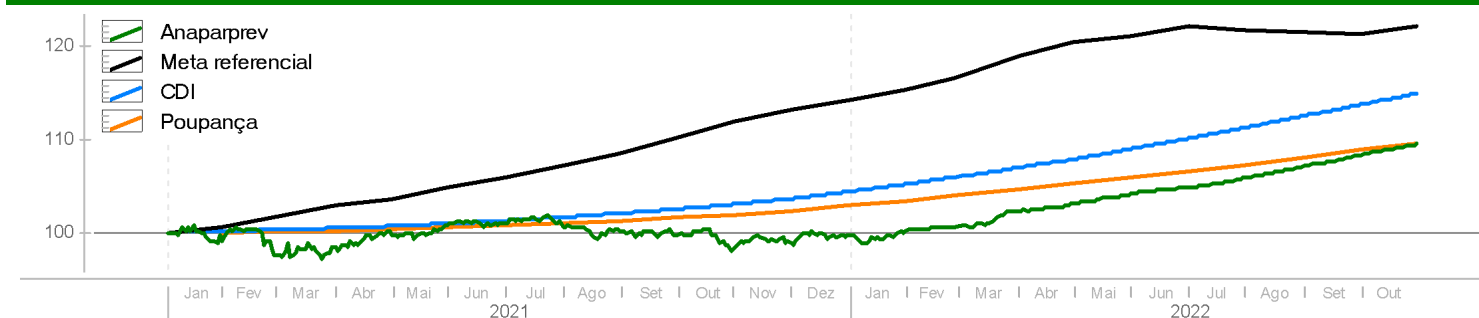
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

Rentabilidades (%) (até 31/10/2022)

	out 2022	set 2022	ago 2022	jul 2022	jun 2022	mai 2022	2022	2021	6m
● Anaparprev	1,04	1,17	1,23	0,86	0,76	1,01	9,75	-0,26	6,21
● Meta referencial	0,67	-0,12	-0,11	-0,40	0,82	0,65	6,91	14,27	1,51
● CDI	1,02	1,07	1,17	1,03	1,02	1,03	10,02	4,42	6,52
● Poupança	0,65	0,68	0,74	0,66	0,65	0,67	6,45	2,99	4,12

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	12
Meses Negativos	0
Meses Acima do CDI	7
Meses Abaixo do CDI	5
Maior Retorno Mensal (%)	1,50
Menor Retorno Mensal (%)	0,42
Retorno Acumulado (%)	11,51
Retorno Acumulado (% CDI)	99,96

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	1,91
Sharpe (12 meses)	0,01
VAR 21 dias	0,12
Máximo Draw down	0,00
Alfa de Jensen	0,02

Comentários

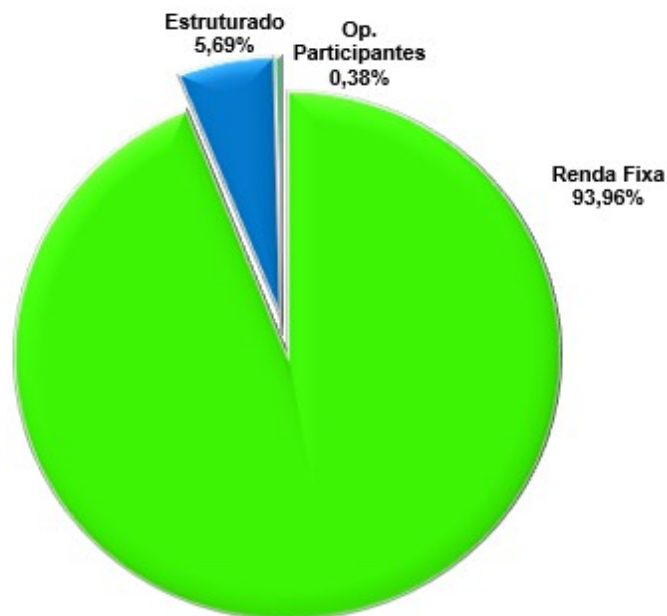
Outubro foi um mês de recuperação para ativos de risco nos mercados internacionais. A expectativa de uma trajetória mais suave de altas de juros para os principais bancos centrais globais e o arrefecimento da turbulência política no Reino Unido foram os principais fatores responsáveis pela melhora dos mercados. Por outro, a continuação de políticas de Zero Covid na China impactou negativamente os mercados.

No Brasil, os ativos de risco acompanharam o avanço dos mercados mundiais, com valorização da bolsa de valores e boa performance do Real frente ao Dólar, diante de um ambiente doméstico de elevada volatilidade em função das eleições.

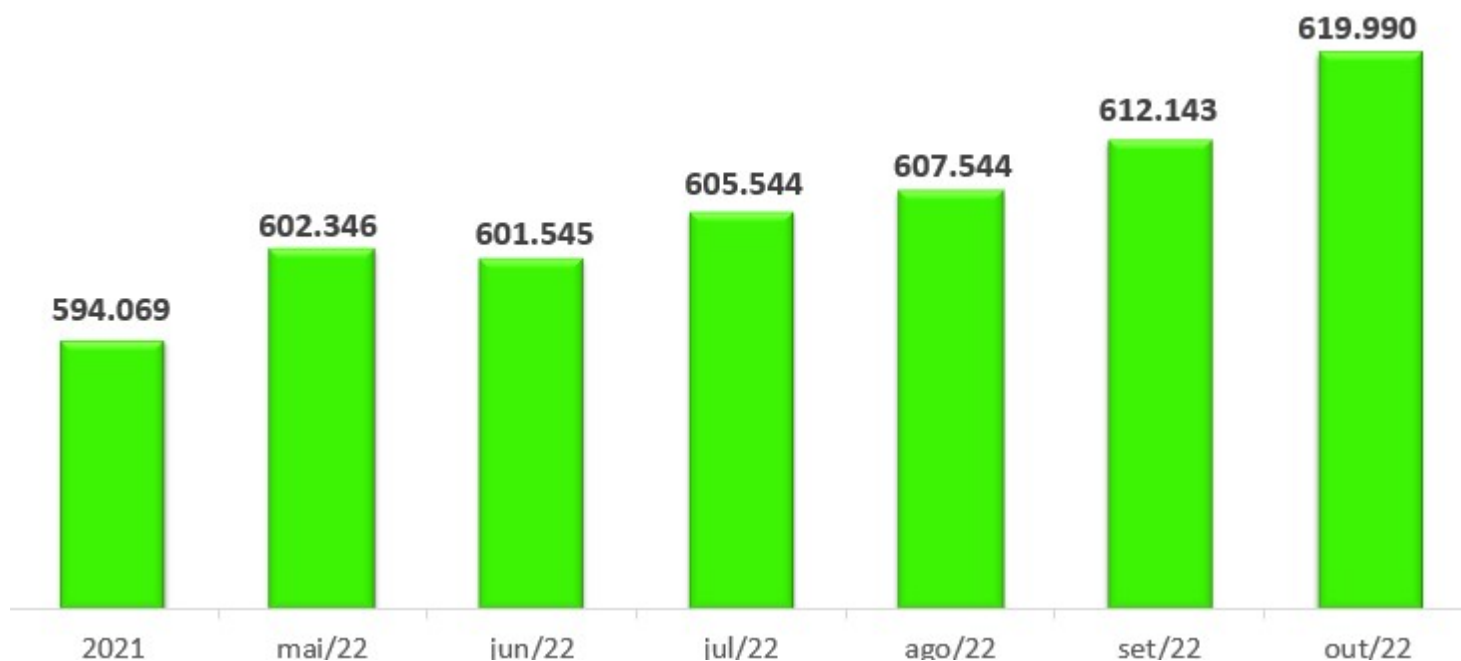
No mês, os destaques positivos das aplicações em renda fixa foram os ativos atrelados a taxa de juros e vinculados à inflação de curto prazo (NTN -B). O destaque dos ativos de risco no mercado local foi o Ibovespa (principal índice da bolsa brasileira) que fechou em alta de 5,45%. O IHFA (Índice de Fundos Multimercados da Anbima) subiu 1,34% no mês. Por fim, o Dólar americano fechou outubro com desvalorização de 2,77% frente ao Real.

O Plano Anaparprev obteve uma valorização das cotas em 1,04% no mês de outubro, equivalente a 102% CDI e superior ao índice de referência, que foi de 0,67%. No acumulado do ano até outubro, o Plano registrou ganho de 9,75%, equivalente a 97% CDI e acima do índice de referência de 6,91%, em 141%. Os segmentos de renda fixa (fundos ativos) e estruturado (fundos multimercado) foram os que mais contribuíram 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..