PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Junho - 2021

Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Custodiante Centralizado	Banco BTG Pactual
Patrimônio última cotação	R$ 614.820.131
Data do início da cota	31/12/2018
Data da última cota	30/06/2021

Política de Investimento

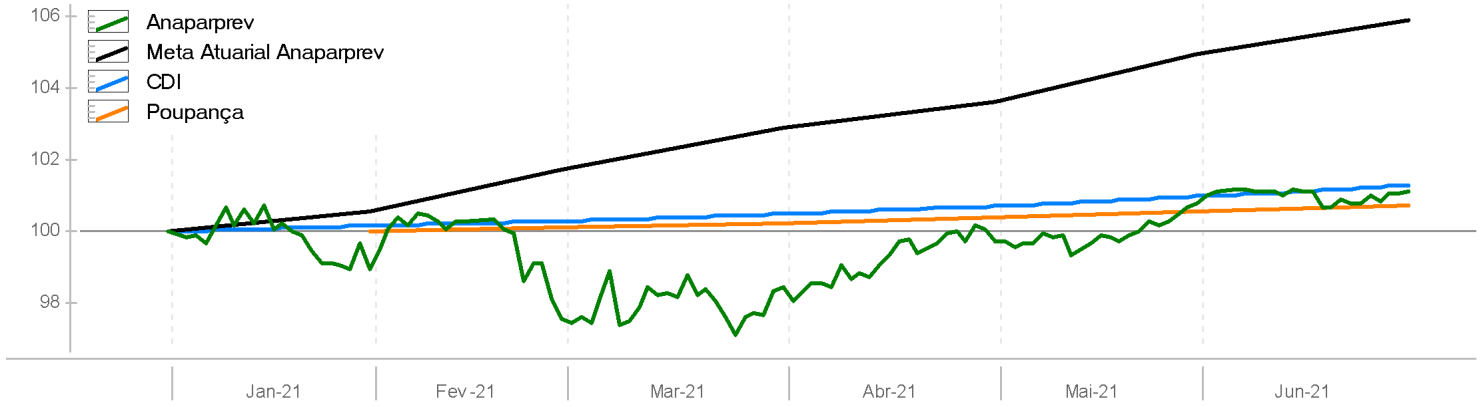
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente,focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

Rentabilidades (%) (até 30/06/2021)

	jan 2021	fev 2021	mar 2021	abr 2021	mai 2021	jun 2021	2021	6m
Anaparprev	-1,04	-1,44	0,96	1,28	1,06	0,29	1,08	1,08
Meta Atuarial Anaparprev	0,58	1,13	1,17	0,69	1,27	0,91	5,87	5,87
CDI	0,15	0,13	0,20	0,21	0,27	0,31	1,28	1,28
Poupança	0,12	0,12	0,12	0,16	0,16	0,16	0,83	0,83

Obs.: De 01/19 a 04/21, os dados de rentabilidade foram fornecidos pela Petros, periodo em que o plano estava sob sua gestão .

Retorno Acumulado



Perfil de Retornos (Últ. 12 meses)

Meses Positivos	7
Meses Negativos	5
Meses Acima do CDI	6
Meses Abaixo do CDI	6
Maior Retorno Mensal (%)	3,98
Menor Retorno Mensal (%)	-1,92
Retorno Acumulado (%)	8,42
Retorno Acumulado (% CDI)	369,97

Perfil de Risco (desde início - dados diários)

Volatilidade	6,53
Sharpe	0,93
Sharpe - 24 meses	0,19
VAR de 1 mês - 95% (%)	3,13
VAR de 12 meses - 95% (%)	10,83
Perda Máxima (%)	-14,32
Máximo Drawdown	-14,32
Alfa vs. CDI	1,73

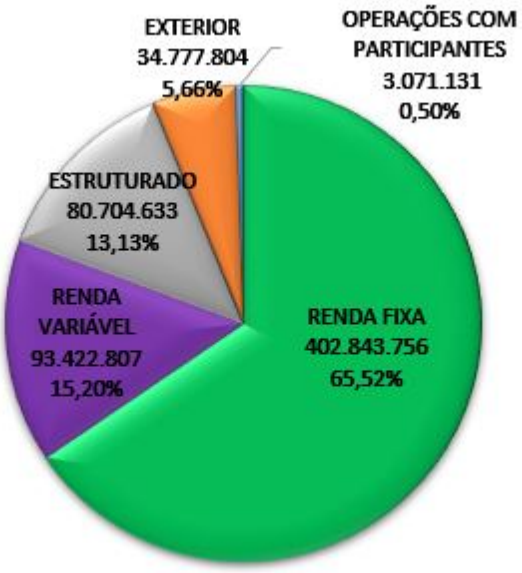
Comentários

Em junho, o aumento do ritmo de vacinação global e a manutenção dos estímulos monetários e fiscais continuaram a refletir de forma positiva nos indicadores de atividades, sustentando o apetite ao risco. No entanto, o mês foi marcado pelas mudanças de tom do FED (EUA) e do BC do Brasil, que em suas reuniões de política monetária demostraram preocupação com os números de inflação persistente. No Brasil, os indicadores de atividade apresentam-se robustos e vem desencadeando revisões de novas altas do crescimento do PIB para esse ano.

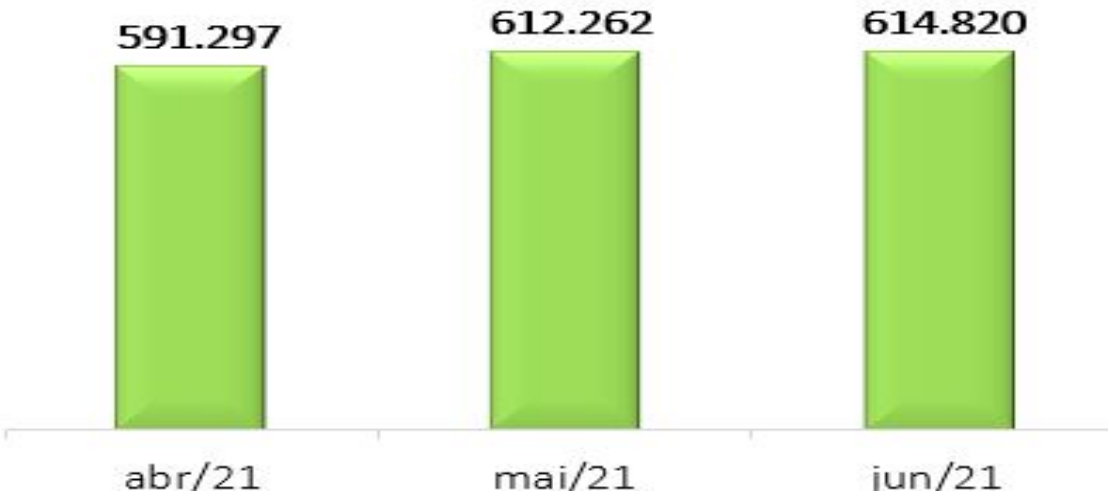
O mercado de ações encerrou o mês de junho em alta de 0,48%. O mercado de renda fixa apresentou movimentos diferentes na curva de juros. Houve alta das taxas no curto e médio prazo e estabilidade nas taxas longas. Nesse contexto, todos os planos da Viva registraram resultados positivos no mês.

A carteira do plano Anaparprev registrou em junho valorização de 0,29%, equivalente a 95% CDI. No 1° semestre do ano, a rentabilidade acumulada ficou em 1,08%, equivalente a 84% CDI. Os segmentos de renda fixa - inflação e renda variável foram os que mais contribuíram para a performance positiva no mês.

Distribuição por Segmentos



Evolução Patrimonial



Disclaimer

As informações contidas nesta Lamina são de caráter exclusivamente informativo;
Os investimentos do Plano tem horizonte de retorno de longo prazo,podendo apresentar flutuações nos valores das cotas no curto prazo;
A rentabilidade obtida no passado nao representa garantia de resultados futuros;
A Fundação VIVA de Previdência ,administradora do Plano,adota normas e melhores práticas emanadas pela certificação do ICSS ABRAPP - Selo de Autorregulação em Governança e Investimentos;
Maiores informações sobre o Plano, estarão contidas no RAI - Relatório Anual de Informações.