

PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Maio - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 602.345.782
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	31/12/2018
Data	31/05/2022

Política de Investimento

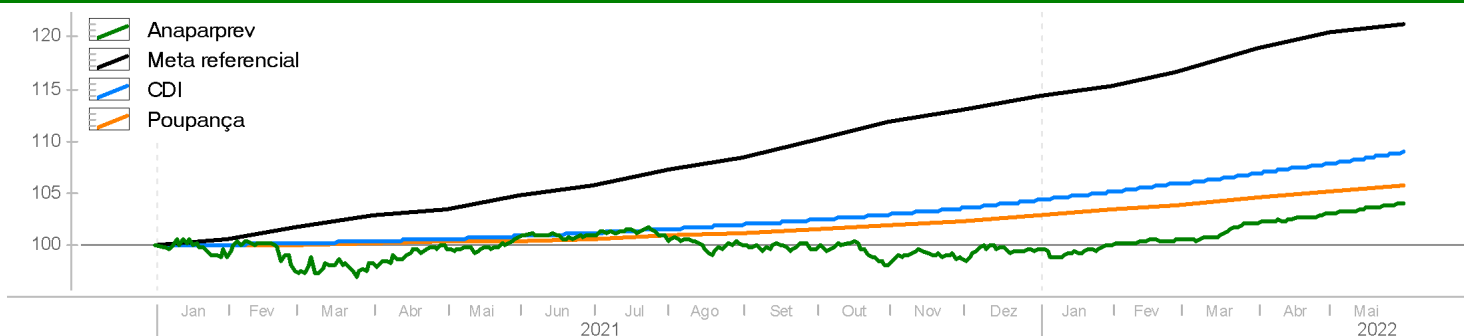
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

Rentabilidades (%) (até 31/05/2022)

	jun 2021	jul 2021	ago 2021	set 2021	out 2021	nov 2021	dez 2021	jan 2022	fev 2022	mar 2022	abr 2022	mai 2022	2020	2021	2022	6m
● Anaparprev	0,29	-0,51	-0,48	-0,34	-1,58	0,68	0,92	0,42	0,50	1,50	0,87	1,01	2,75	-0,26	4,38	5,34
● Meta referencial	0,91	1,34	1,18	1,51	1,47	1,15	1,04	0,87	1,20	1,91	1,24	0,65	9,75	14,27	6,00	7,11
● CDI	0,31	0,36	0,43	0,44	0,49	0,59	0,77	0,73	0,76	0,93	0,83	1,03	2,76	4,42	4,36	5,16
● Poupança	0,16	0,29	0,24	0,30	0,36	0,44	0,49	0,56	0,50	0,60	0,56	0,67	2,11	2,99	2,91	3,42

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	8
Meses Negativos	4
Meses Acima do CDI	4
Meses Abaixo do CDI	8
Maior Retorno Mensal (%)	1,50
Menor Retorno Mensal (%)	-1,58
Retorno Acumulado (%)	3,29
Retorno Acumulado (% CDI)	41,55

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	3,07
Sharpe	-1,39
VAR 21 dias	0,37
Máximo Draw down	-2,88
Alfa de Jensen	-4,59

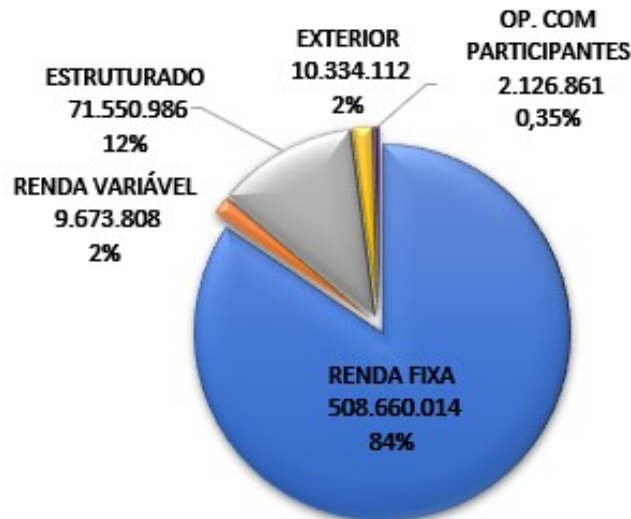
Comentários

No mês de maio, o mercado financeiro aumentou a probabilidade de maior aperto monetário por parte dos bancos centrais mundiais, ou seja, pelo aumento das taxas de juros, para combater os níveis elevados de inflação, aumentando o grau de incertezas e preocupações com a desaceleração do crescimento global. Isso decorre do cenário desafiador enfrentado com o prolongamento do conflito entre Rússia e Ucrânia, que leva a escassez de produtos como trigo, milho, fertilizantes e petróleo, bem como a reabertura econômica na China, após os lockdowns devidos às restrições do Covid-19, aumentando assim as pressões sobre os preços.

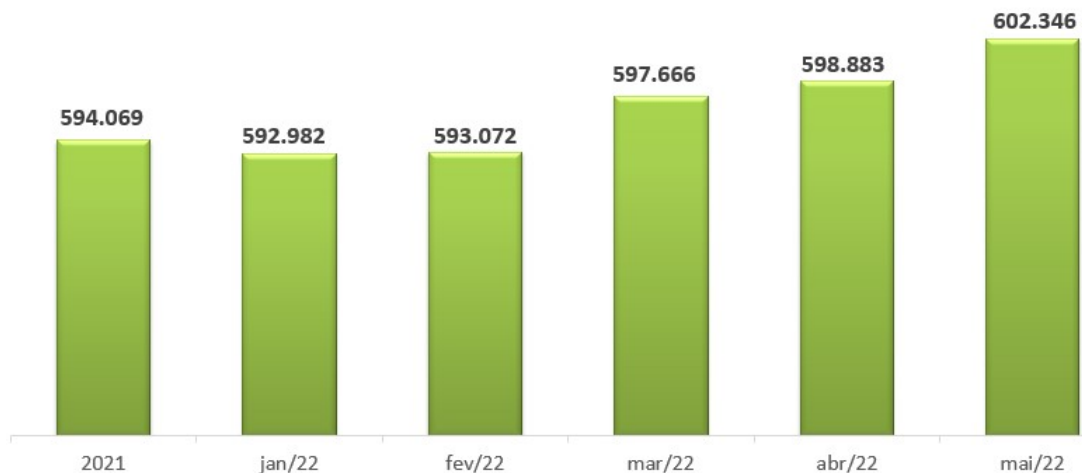
No Brasil, os últimos indicadores de atividade econômica e do nível de emprego divulgados têm influenciado nas perspectivas de melhora do crescimento econômico no curto prazo, porém as preocupações com a evolução da economia mundial e a dinâmica da inflação têm apontado para um cenário de indefinição quanto ao fim do ciclo de elevação das taxas de juros.

O Plano Anaparprev alcançou uma valorização de 1,01%, no mês de maio, equivalente a 98% CDI e 155% da meta referencial. No ano, o Plano registrou ganho de 4,38%, equivalente a 101% CDI, que representou 73% da meta referencial. Os segmentos de renda fixa e estruturado (fundos multimercados) 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..