

# PLANO ANAPARPREV

## Informativo mensal de rentabilidade

### Fevereiro - 2022



#### Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 593.071.878
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	31/12/2018
Data	25/02/2022

#### Política de Investimento

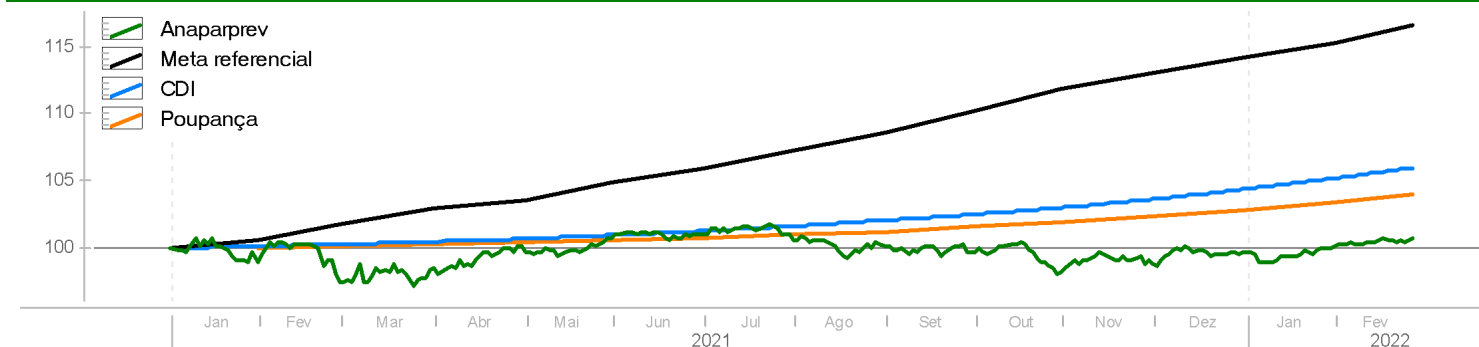
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

#### Rentabilidades (%) (até 28/02/2022)

	mar 2021	abr 2021	mai 2021	jun 2021	jul 2021	ago 2021	set 2021	out 2021	nov 2021	dez 2021	jan 2022	fev 2022	2020	2021	2022	6m
● Anaparprev	0,96	1,28	1,06	0,29	-0,51	-0,48	-0,34	-1,58	0,68	0,92	0,42	0,50	2,75	-0,26	0,93	0,59
● Meta referencial	1,17	0,69	1,27	0,91	1,34	1,18	1,51	1,47	1,15	1,04	0,87	1,20	9,75	14,27	2,08	7,46
● CDI	0,20	0,21	0,27	0,31	0,36	0,43	0,44	0,49	0,59	0,77	0,73	0,76	2,76	4,42	1,49	3,83
● Poupança	0,12	0,16	0,16	0,16	0,29	0,24	0,30	0,36	0,44	0,49	0,56	0,50	2,11	2,99	1,06	2,68

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	5
Meses Abaixo do CDI	7
Maior Retorno Mensal (%)	1,28
Menor Retorno Mensal (%)	-1,58
Retorno Acumulado (%)	3,21
Retorno Acumulado (% CDI)	56,55

#### Perfil de Risco

Volatilidade Anual	2,58
Sharpe	-1,20
VAR 21 dias	0,53
Máximo Draw down	-2,88
Alfa de Jensen	-2,37

#### Comentários

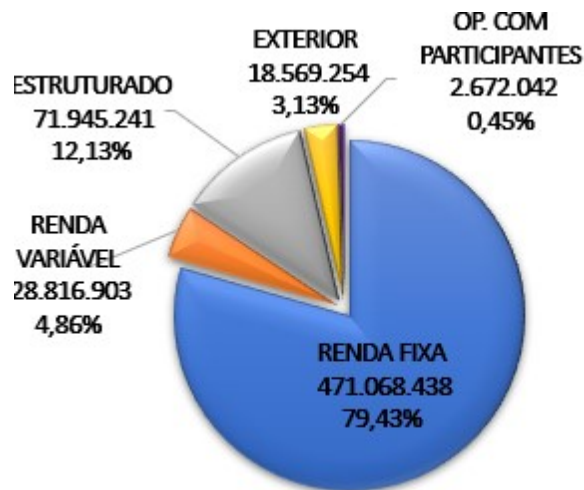
O mês de fevereiro foi marcado nos mercados internacionais pela forte aversão a risco, devido aos seguintes fatores: (i) início do conflito bélico entre Rússia e Ucrânia; (ii) o aumento significativo nos preços das commodities, principalmente energia e alimentos, e (iii) a deterioração dos dados de inflação nos EUA e na Europa, que exigiram dos BCs dos países desenvolvidos um tom mais duro, sinalizando política monetária mais conservadora para o ano de 2022, com aumento nas taxas de juros. Os efeitos sobre os mercados financeiros foram a queda acentuada nas principais bolsas de valores mundiais e maior volatilidade dos juros globais.

O mercado acompanhou os desdobramentos do conflito bélico entre Rússia e Ucrânia e seus possíveis impactos sobre a inflação global e a redução do ritmo da atividade econômica mundial. No Brasil, apesar dos impactos negativos da crise geopolítica, na contramão do mercado financeiro externo, o índice Ibovespa fechou em alta, beneficiado principalmente pela entrada de fluxo financeiro de investidor estrangeiro, e pelo momento positivo no preço das commodities, que beneficiou as empresas como Petrobras. O Comitê de Política Monetária, no mês de fevereiro, apesar da política monetária contracionista, sinalizou, para a próxima reunião, expectativa de redução do ritmo da alta de juros.

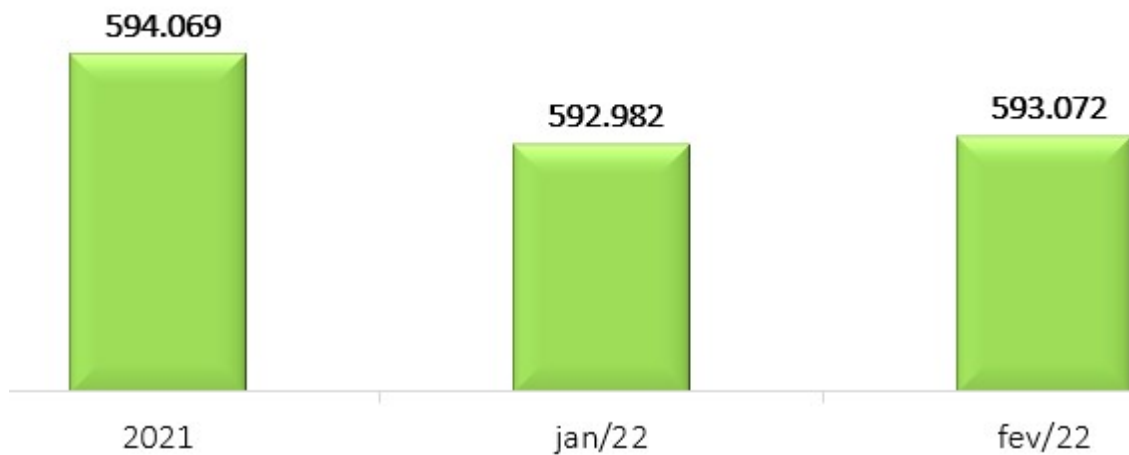
Diante desse contexto, o Ibovespa encerrou o mês de fevereiro com valorização de 0,89%, e no acumulado do ano registra ganho de 7,94%. No mercado de renda fixa, a curva de juros voltou a subir em todos os vértices (vencimentos) devido a expectativa de aumento nos índices de inflação.

O Plano Anaparprev alcançou uma valorização de 0,50%, no mês de fevereiro, equivalente a 66% CDI. No ano, o Plano registrou ganho de 0,93%, equivalente a 62% CDI. Os segmentos de renda fixa e 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..