

PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Março - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 597.665.737
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	31/12/2018
Data	31/03/2022

Política de Investimento

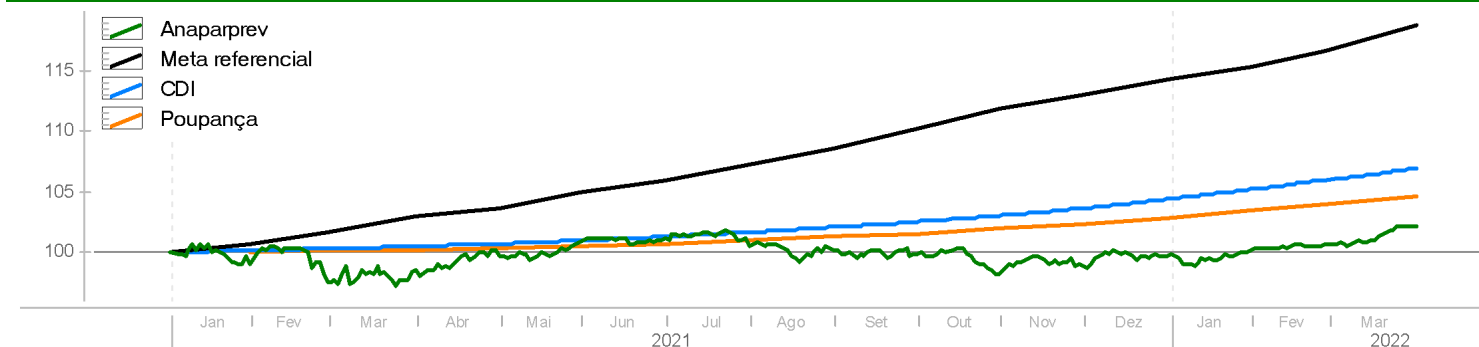
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

Rentabilidades (%) (até 31/03/2022)

	abr 2021	mai 2021	jun 2021	jul 2021	ago 2021	set 2021	out 2021	nov 2021	dez 2021	jan 2022	fev 2022	mar 2022	2020	2021	2022	6m
● Anaparprev	1,28	1,06	0,29	-0,51	-0,48	-0,34	-1,58	0,68	0,92	0,42	0,50	1,50	2,75	-0,26	2,44	2,44
● Meta referencial	0,69	1,27	0,91	1,34	1,18	1,51	1,47	1,15	1,04	0,87	1,20	1,91	9,75	14,27	4,03	7,88
● CDI	0,21	0,27	0,31	0,36	0,43	0,44	0,49	0,59	0,77	0,73	0,76	0,93	2,76	4,42	2,43	4,33
● Poupança	0,16	0,16	0,16	0,29	0,24	0,30	0,36	0,44	0,49	0,56	0,50	0,60	2,11	2,99	1,67	2,98

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 (%)	1,50
Menor Retorno Mensal (%)	-1,58
Retorno Acumulado (%)	3,77
Retorno Acumulado (% CDI)	58,40

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	2,23
Sharpe	2,82
VAR 21 dias	0,76
Máximo Draw down	-2,88
Alfa de Jensen	-2,62

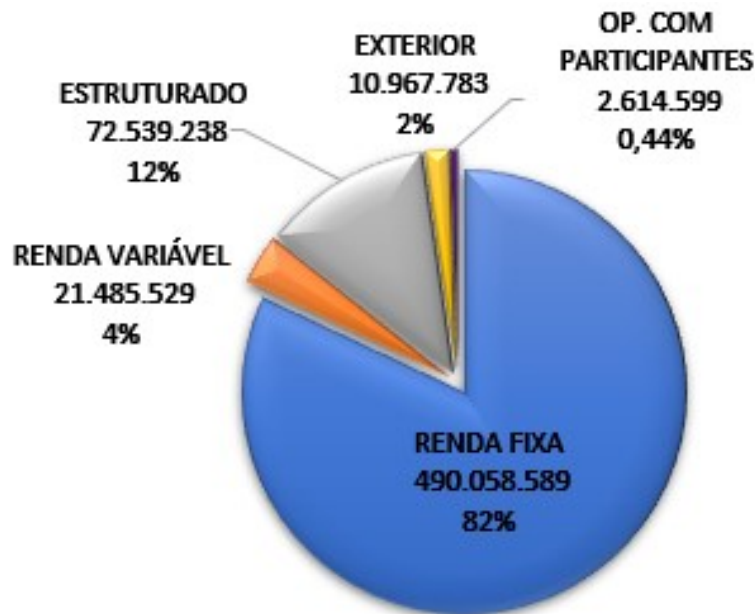
Comentários

Os temas que dominaram as discussões no mercado financeiro no mês de março foram a evolução do conflito bélico entre Rússia e Ucrânia e a mudança da postura do Fed (Banco Central dos EUA). O Fed indicou, na reunião de março, a necessidade de um aperto monetário maior e mais longo, devido (i) inflação elevada, decorrente das ondas de choque dos preços de commodities originadas no conflito entre Rússia e Ucrânia e (ii) mercado de trabalho próximo ao pleno emprego, com alta dos salários e taxa de desemprego baixa, iniciando assim o ciclo de altas de juros em março e indicando altas em todas as reuniões a partir de agora, incluindo alta de 0,50% na reunião de maio. A atividade global foi forte no 1º trimestre do ano, mas deve desacelerar nos próximos meses pelos efeitos (i) do conflito bélico entre Rússia e Ucrânia e (ii) política chinesa de "zeroCovid", com o surgimento de novos casos, levou a nova onda de lockdowns, colocando mais pressão nas cadeias globais de suprimentos, o que está levando a um choque prolongado de oferta. No Brasil, o aumento da taxa SELIC, de 10,75% a.a. para 11,75% a.a. e a valorização dos preços das commodities, continuaram atraindo maior fluxo de capital estrangeiro para os mercados de renda fixa e bolsa de valores, especificamente para as empresas produtoras de commodities.

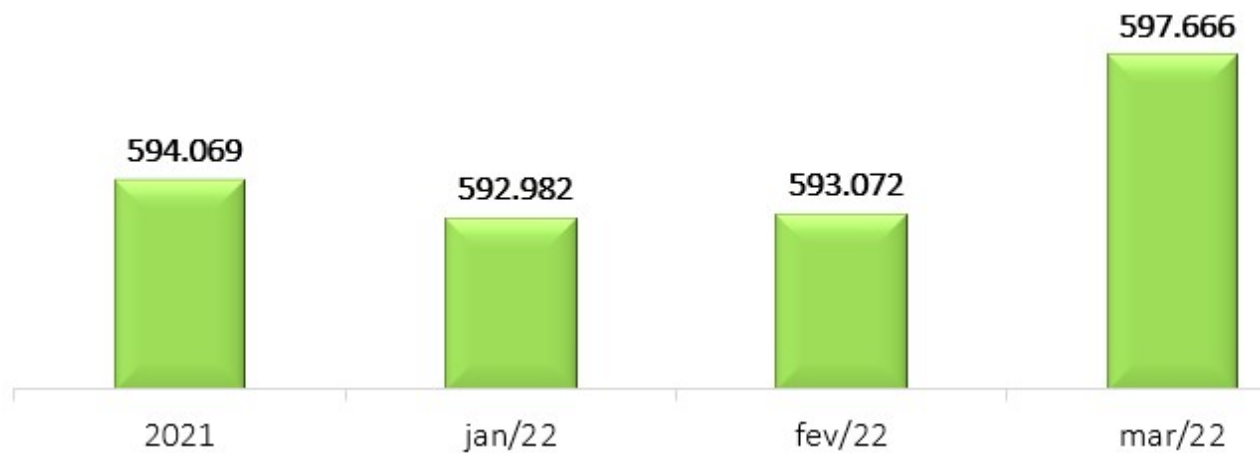
Diante desse contexto, o Ibovespa encerrou o mês de março em alta de 6,06%, e no acumulado do ano registra valorização de 14,4%. Na renda fixa, todos os segmentos da curva de juros no médio e longo prazo tiveram fechamento das taxas (rentabilidade positiva).

O Plano Anaparprev alcançou uma valorização de 1,50%, no mês de março, equivalente a 162% CDI. No ano, o Plano registrou ganho de 2,44%, equivalente a 100% CDI, que representou 61% da meta referencial. Os segmentos de renda fixa, renda variável 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..