

PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Abril - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 598.882.950
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	31/12/2018
Data	29/04/2022

Política de Investimento

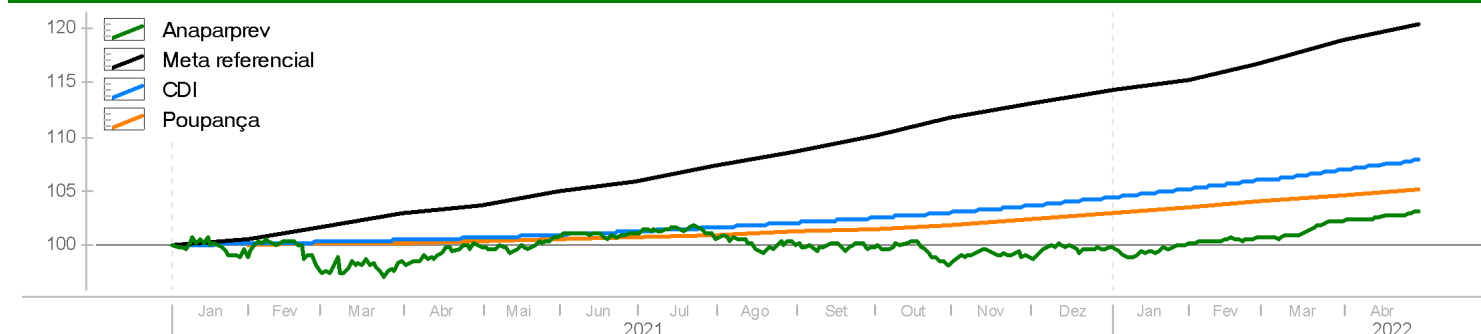
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

Rentabilidades (%) (até 30/04/2022)

	mai 2021	jun 2021	jul 2021	ago 2021	set 2021	out 2021	nov 2021	dez 2021	jan 2022	fev 2022	mar 2022	abr 2022	2020	2021	2022	6m
● Anaparprev	1,06	0,29	-0,51	-0,48	-0,34	-1,58	0,68	0,92	0,42	0,50	1,50	0,87	2,75	-0,26	3,33	4,99
● Meta referencial	1,27	0,91	1,34	1,18	1,51	1,47	1,15	1,04	0,87	1,20	1,91	1,24	9,75	14,27	5,32	7,64
● CDI	0,27	0,31	0,36	0,43	0,44	0,49	0,59	0,77	0,73	0,76	0,93	0,83	2,76	4,42	3,29	4,69
● Poupança	0,16	0,16	0,29	0,24	0,30	0,36	0,44	0,49	0,56	0,50	0,60	0,56	2,11	2,99	2,23	3,19

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 (%)	3,35
Retorno Acumulado (% CDI)	47,03

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	3,21
Sharpe	-1,19
VAR 21 dias	0,39
Máximo Drawdown	-2,88
Alfa de Jensen	-4,08

Comentários

Após um primeiro trimestre positivo, o mês de abril foi de aversão ao risco nos mercados financeiros. Além do atual conflito entre Rússia e Ucrânia no leste Europeu, os lockdowns nas maiores cidades chinesas devido as restrições contra a Covid-19, adicionaram incerteza na perspectiva de crescimento global. Os patamares elevados da inflação continuaram a ser manchetes no mês. Na Zona do Euro, a inflação ao consumidor atingiu o recorde de +7.5%, e nos EUA atingiu +8.3%. Isso aumentou a preocupação com a possibilidade de os bancos centrais não conseguirem fugir de um "pouso forçado", sendo obrigados a causar uma recessão na sua luta contra a inflação. Com relação as taxas de juros dos EUA, os comentários bastantes incisivos de membros do comitê de política monetária do país fizeram disparar o receio de investidores com o ciclo de alta de taxas de juros, fazendo com que o mercado quase que de forma consensual precisasse um aumento de +0,5% para maio. Ativos de risco sofreram um grande movimento de venda em abril. O S&P 500 (índice acionário da bolsa americana) caiu -8.7% - o pior desempenho desde março de 2020.

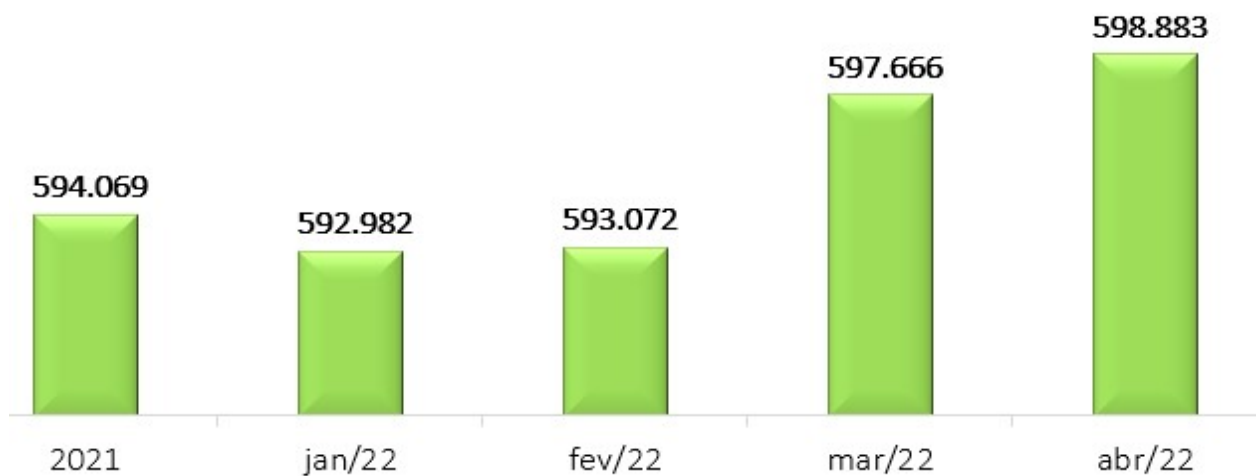
No Brasil, os ativos de risco reverteram o movimento positivo que vinha sendo observado nos meses anteriores. Além dos fatores externos, os resultados acima do esperado para a inflação e as dúvidas sobre o futuro do arcabouço fiscal do país elevaram a aversão a risco. Diante da elevada incerteza da atual conjuntura, o Copom elevou a taxa SELIC, de 11,75% a.a. para 12,75% a.a. O índice Ibovespa apresentou queda de 10,1% interrompendo uma sequência de quatro meses consecutivos de alta. No ano, a bolsa brasileira ainda acumula um resultado positivo de 2,9%. A taxa de câmbio, por sua vez, também apresentou um resultado negativo no período, apresentando uma desvalorização de 3,8% e fechando a R\$ 4,92 no final do mês. O mercado de juros não foi exceção deste movimento negativo e encerrou novamente em alta ao longo do último período. A entrada do investidor estrangeiro, que foi um dos principais vetores positivos nos últimos meses, acabou perdendo força em abril, uma saída de R\$ 7,7 bilhões e contribuindo para o resultado negativo nos mercados brasileiros.

O Plano Anaparprev alcançou uma valorização de 0,87%, no mês de março, equivalente a 105% CDI. No ano, o Plano registrou ganho de 3,33%, equivalente a 102% CDI, que representou 62% da meta referencial. 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..