

PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Junho - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 601.545.573
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	31/12/2018
Data	30/06/2022

Política de Investimento

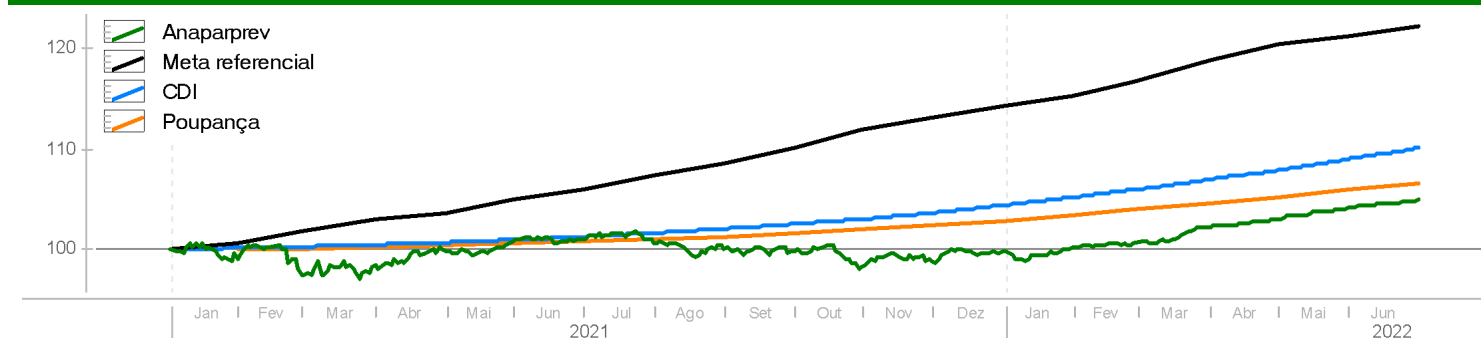
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

Rentabilidades (%) (até 30/06/2022)

	jul 2021	ago 2021	set 2021	out 2021	nov 2021	dez 2021	jan 2022	fev 2022	mar 2022	abr 2022	mai 2022	jun 2022	2020	2021	2022	6m
● Anaparprev	-0,51	-0,48	-0,34	-1,58	0,68	0,92	0,42	0,50	1,50	0,87	1,01	0,76	2,75	-0,26	5,17	5,17
● Meta referencial	1,34	1,18	1,51	1,47	1,15	1,04	0,87	1,20	1,91	1,24	0,65	0,82	9,75	14,27	6,87	6,87
● CDI	0,36	0,43	0,44	0,49	0,59	0,77	0,73	0,76	0,93	0,83	1,03	1,02	2,76	4,42	5,42	5,42
● Poupança	0,29	0,24	0,30	0,36	0,44	0,49	0,56	0,50	0,60	0,56	0,67	0,65	2,11	2,99	3,58	3,58

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 (%)	3,78
Retorno Acumulado (% CDI)	43,45

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	3,01
Sharpe	-1,50
VAR 21 dias	0,17
Máximo Drawdown	-2,39
Alfa de Jensen	-4,88

Comentários

Em junho ocorreu uma deterioração do cenário econômico devido às preocupações relacionadas às pressões inflacionárias, especialmente nos EUA e na Europa. Como resultado, os principais bancos centrais sinalizaram a perspectiva de política monetária ainda mais restritiva, que aliados à política de Covid zero na China, vem fazendo com que sejam revistas para baixo as projeções de crescimento e aumentaram o receio de uma recessão nos EUA.

Diante desse cenário de incertezas para inflação e juros, a maioria dos índices globais de bolsas internacionais fecharam o mês com variação negativa. Além disso, observou-se maior volatilidade e abertura das taxas de juros de curto prazo e apreciação do dólar. No mercado doméstico, como a inflação continua pressionada e sem sinais de arrefecimento, os ativos de risco seguiram dinâmicas similares à observada nos mercados internacionais.

Nesse ambiente adverso, no mês, o Ibovespa registrou perdas de 11,50%, também afetado negativamente pelo recuo nas cotações das commodities. O Real depreciou 9,95%, frente ao Dólar, em linha com o fortalecimento global da moeda americana dentro do ambiente de maiores incertezas. Por fim, no mercado de juros, a persistência de pressões inflacionárias e os subsequentes desdobramentos de política monetária, continua exercendo pressão de alta nas taxas de juros locais. Além disso, o risco fiscal aumentou com a aprovação, pelo Senado Federal, de medidas para mitigar o efeito da alta dos preços dos combustíveis e concessões de novos auxílios sociais, que não estava previsto na lei de responsabilidade fiscal e no limite do teto de gastos.

O Plano Anaparprev alcançou uma valorização de 0,76%, no mês de junho, equivalente a 75% CDI e 93% da meta referencial. No fechamento do 1º semestre de 2022, o Plano registrou ganho de 5,17%, equivalente a 96% CDI, que representou 75% da meta referencial. O segmento de renda fixa pós fixados vinculado ao CDI, foi o que mais contribuiu 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..