

PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Agosto - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 609.635.312
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	31/12/2018
Data	31/08/2022

Política de Investimento

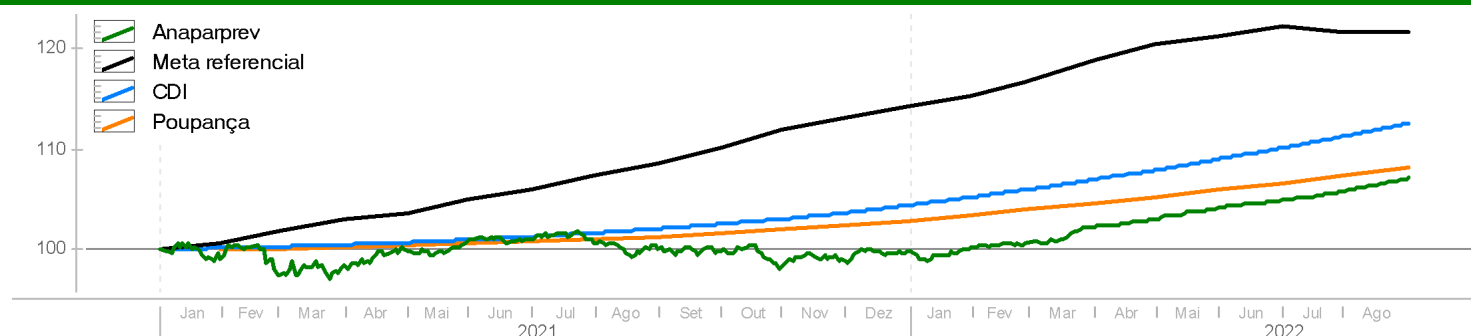
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

Rentabilidades (%) (até 31/08/2022)

	ago 2022	jul 2022	jun 2022	mai 2022	abr 2022	mar 2022	2022	2021	6m
● Anaparprev	1,23	0,86	0,76	1,01	0,87	1,50	7,37	-0,26	6,39
● Meta referencial	-0,11	-0,40	0,82	0,65	1,24	1,91	6,33	14,27	4,16
● CDI	1,17	1,03	1,02	1,03	0,83	0,93	7,75	4,42	6,17
● Poupança	0,74	0,66	0,65	0,67	0,56	0,60	5,04	2,99	3,94

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	10
Meses Negativos	2
Meses Acima do CDI	5
Meses Abaixo do CDI	7
Maior Retorno Mensal (%)	1,50
Menor Retorno Mensal (%)	-1,58
Retorno Acumulado (%)	7,01
Retorno Acumulado (% CDI)	68,48

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	2,59
Sharpe (12 meses)	-1,12
VAR 21 dias	0,13
Máximo Draw down	-1,58
Alfa de Jensen	-3,22

Comentários

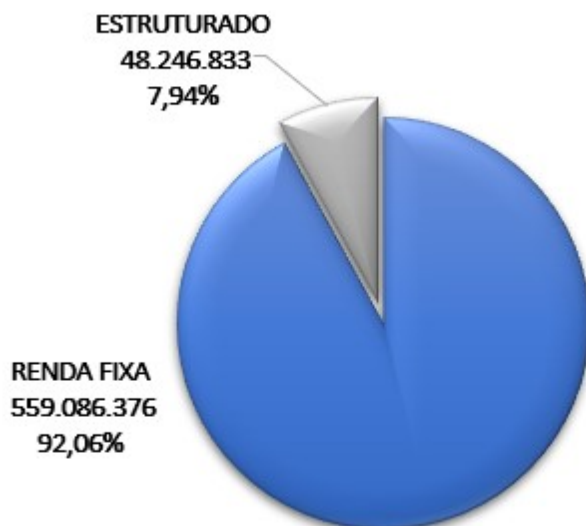
O mês foi marcado por um movimento de aversão a risco no mercado internacional, após a percepção da necessidade de uma postura mais agressiva dos bancos centrais dos países desenvolvidos, na condução da política monetária, após dados mais forte do que o esperado de inflação, especialmente nos Estados Unidos. No Brasil, o mercado descolou dos ativos globais e performou positivamente com a dinâmica favorável na expectativa de encerramento do ciclo de alta na taxa de juros pelo Banco Central, nas revisões da trajetória de inflação para baixo e na recuperação da atividade econômica e, consequentemente, no crescimento do PIB.

Na contramão dos mercados externos, o Ibovespa (principal índice do mercado de ações brasileiro) fechou o mês de agosto com alta de 6,16%, impulsionado com a entrada de recursos de investidores estrangeiros no valor aproximado de R\$ 14 bilhões, apesar da queda das cotações dos preços das commodities. Na renda fixa, com a expectativa do mercado de que o Banco Central poderia encerrar o ciclo de alta da taxa de juros, as aplicações vinculadas aos índices ligados a taxa de juros nominal IRF-M (índice da carteira de títulos públicos prefixados) e os títulos públicos federais atrelados à inflação longa (IMA-B 5+) tiveram bons resultados no mês de agosto, 2,05% e 2,49%, respectivamente. Os ativos vinculados ao CDI registraram ganhos de 1,17% no mês.

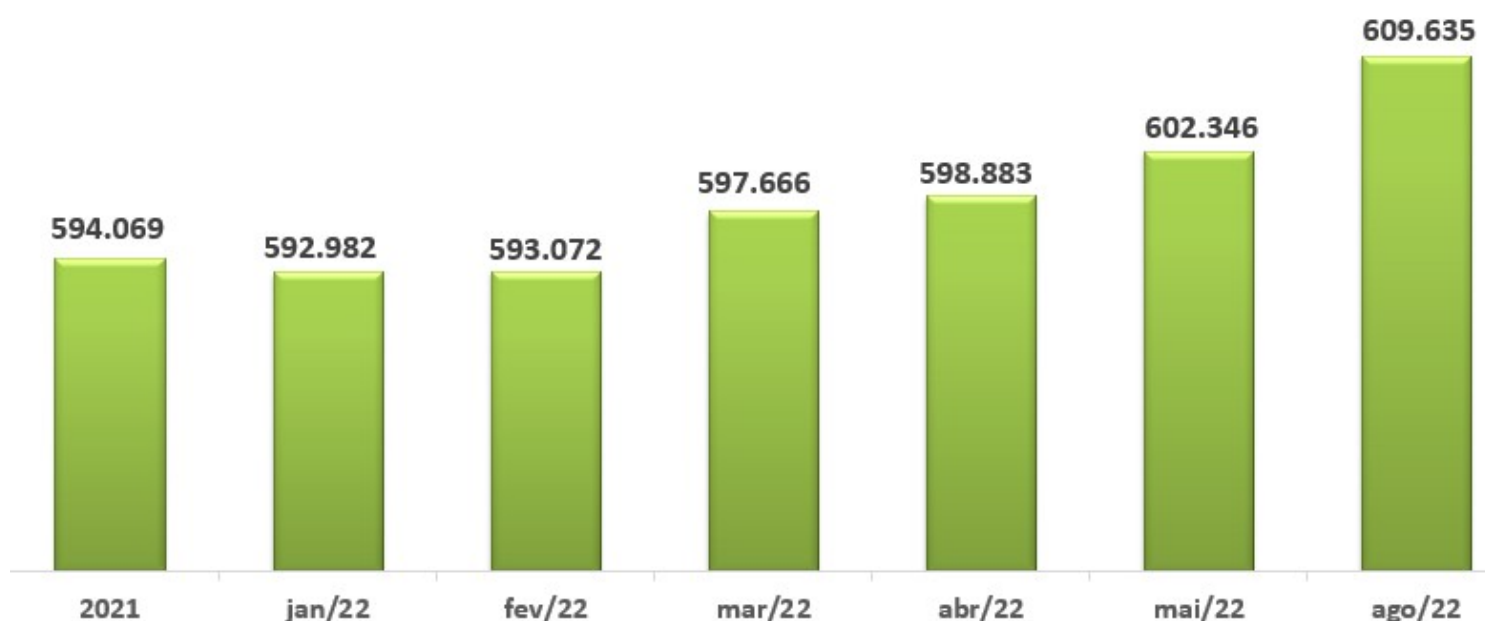
Em linha com o restante do mercado, o IHFA (índice de fundos multimercado) registrou ganhos de 2,44% no mês de agosto. Por fim, o Dólar americano fechou o mês cotado a R\$ 5,17, estável frente ao Real, mas na posição contrária dos mercados globais, onde o Dólar obteve valorização frente às outras moedas.

O Plano Anaparprev alcançou uma valorização de 1,23%, no mês de agosto, superior ao índice de referência, que foi de -0,11% e equivalente a 105% CDI. No acumulado do ano até agosto, o Plano registrou ganho de 7,37%, equivalente a 95% CDI e superou o índice de referência em 116%.

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..