

PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Novembro - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 616.657.502
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	31/12/2018
Data	30/11/2022

Política de Investimento

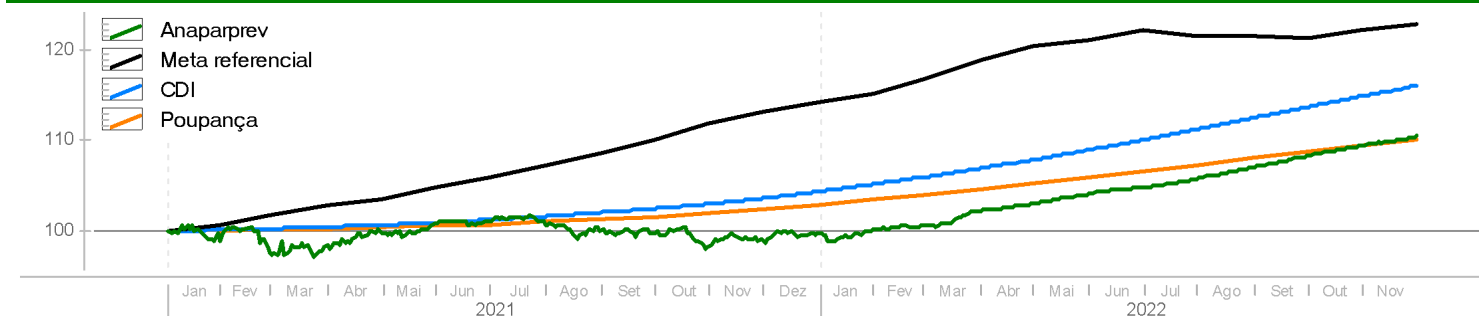
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

Rentabilidades (%) (até 30/11/2022)

	nov 2022	out 2022	set 2022	ago 2022	jul 2022	jun 2022	2022	2021	6m
● Anaparprev	0,91	1,04	1,17	1,23	0,86	0,76	10,75	-0,26	6,10
● Meta referencial	0,58	0,67	-0,12	-0,11	-0,40	0,82	7,53	14,27	1,44
● CDI	1,02	1,02	1,07	1,17	1,03	1,02	11,14	4,42	6,50
● Poupança	0,65	0,65	0,68	0,74	0,66	0,65	7,14	2,99	4,11

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	12
Meses Negativos	0
Meses Acima do CDI	6
Meses Abaixo do CDI	6
Maior Retorno Mensal (%)	1,50
Menor Retorno Mensal (%)	0,42
Retorno Acumulado (%)	11,76
Retorno Acumulado (% CDI)	98,05

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	1,48
Sharpe (12 meses)	-0,13
VAR 21 dias	0,13
Máximo Draw down	0,00
Alfa de Jensen	-0,22

Comentários

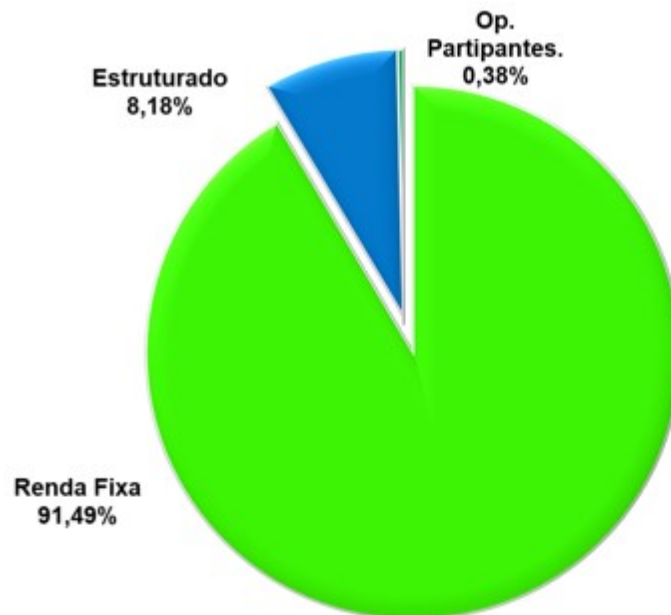
Novembro foi o segundo mês de recuperação para ativos de risco nos mercados globais. A divulgação da inflação ao consumidor (CPI) americano de outubro, abaixo do esperado, trouxe otimismo aos mercados que passaram a precificar um aperto monetário menos rigoroso por parte do Banco Central dos Estados Unidos (FED). Além disso, o anúncio de algumas medidas de afrouxamento com relação à política de Covid Zero sinalizou uma possível reabertura da China em 2023, o que também impulsionou os ativos de risco no mês.

No Brasil, na contramão do mercado internacional, o mês foi de queda para os ativos de risco, com as incertezas em relação à PEC da transição e ao arcabouço fiscal. Diante desse cenário, ocorreu uma desvalorização do índice IBOVESPA, alta expressiva das taxas de juros e queda do Real frente ao Dólar.

No mês, os destaques positivos das aplicações em renda fixa foram os ativos vinculados à taxa de juros pós-fixada (títulos públicos remunerados pela Selic - LFT) e ativos de crédito privado.

O Plano Anaparprev obteve uma valorização das cotas em 0,91% no mês de outubro, equivalente a 89% CDI e superior ao índice de referência, que foi de 0,58%. No acumulado do ano, até novembro, o Plano registrou ganho de 10,75%, equivalente a 97% CDI e acima do índice de referência, de 7,54%, que representou 143%.

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..