

PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Dezembro - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 617.384.544
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início	31/12/2020
Data	30/12/2022

Política de Investimento

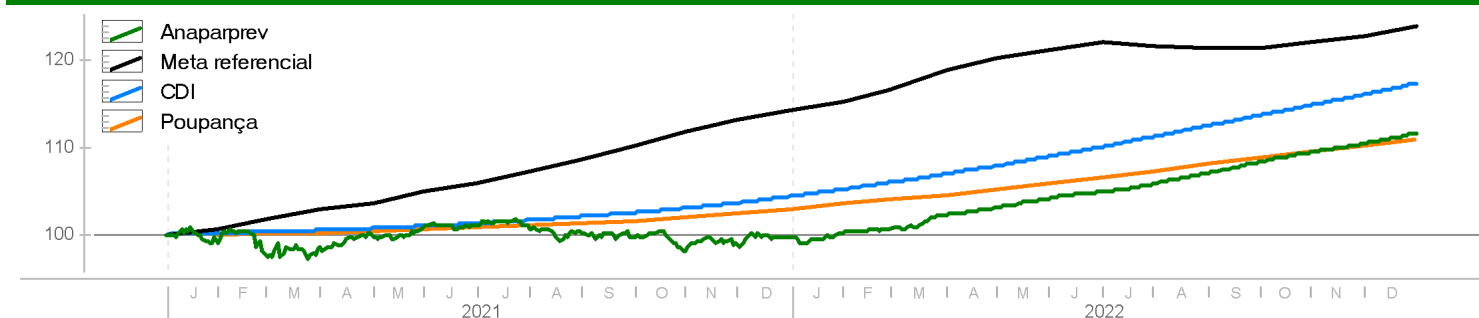
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

Rentabilidades (%) (até 31/12/2022)

	dez 2022	nov 2022	out 2022	set 2022	ago 2022	jul 2022	2022	2021	6m
● Anaparprev	1,07	0,91	1,04	1,17	1,23	0,86	11,93	-0,26	6,43
● Meta referencial	0,89	0,58	0,67	-0,12	-0,11	-0,40	8,49	14,27	1,51
● CDI	1,12	1,02	1,02	1,07	1,17	1,03	12,39	4,42	6,62
● Poupança	0,71	0,65	0,65	0,68	0,74	0,66	7,90	2,99	4,17

Obs.: De 01/21 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	5
Meses Abaixo do CDI	7
Maior Retorno Mensal (%)	1,50
Menor Retorno Mensal (%)	0,42
Retorno Acumulado (%)	11,93
Retorno Acumulado (% CDI)	96,30

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	1,09
Sharpe (12 meses)	-0,39
VAR 21 dias	0,06
Máximo Draw down	0,00
Alfa de Jensen	-0,47

Comentários

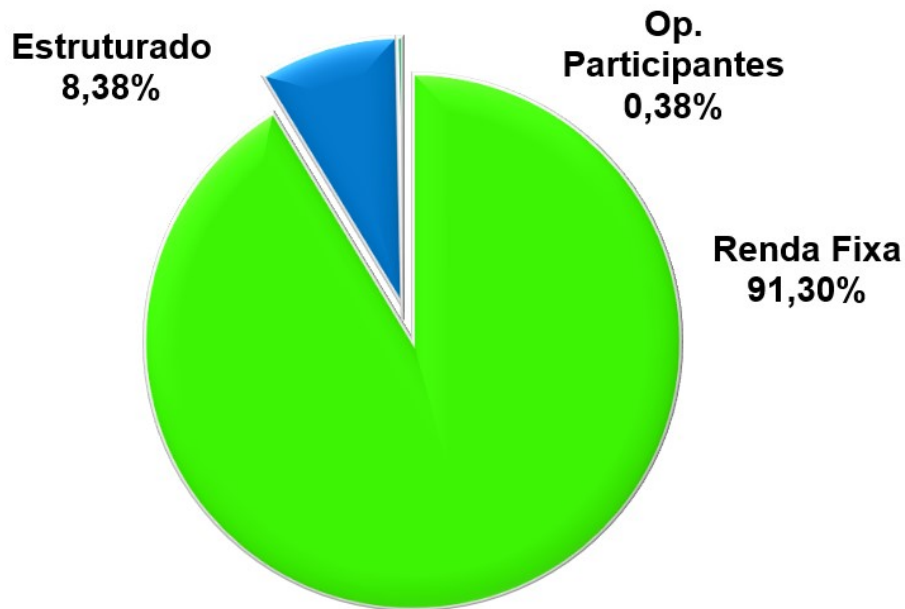
O mês de dezembro foi negativo para os ativos de riscos globais com os principais índices acionários fechando em queda. Esse movimento desfavorável foi impactado pelos comunicados mais hawkish do que o esperado do FED e do BCE, indicando que a taxa de juros pode permanecer em patamares elevados por mais tempo, apesar da melhora observada no ambiente inflacionário. Na China, na contramão dos mercados externos, os ativos locais e as commodities performaram positivamente impulsionados pela abertura da economia relacionadas as novas medidas de alívio às restrições da Covid-19.

No Brasil, além do sentimento de maior aversão ao risco vindo dos mercados desenvolvidos, os ativos apresentaram alta volatilidade devido às incertezas fiscais com a aprovação da PEC da transição. Diante desse cenário, o índice IBOVESPA apresentou queda, o Real desvalorizou frente ao Dólar e as taxas de juros nominais e reais de curto prazo recuaram, mas as taxas de juros reais de longo prazo subiram.

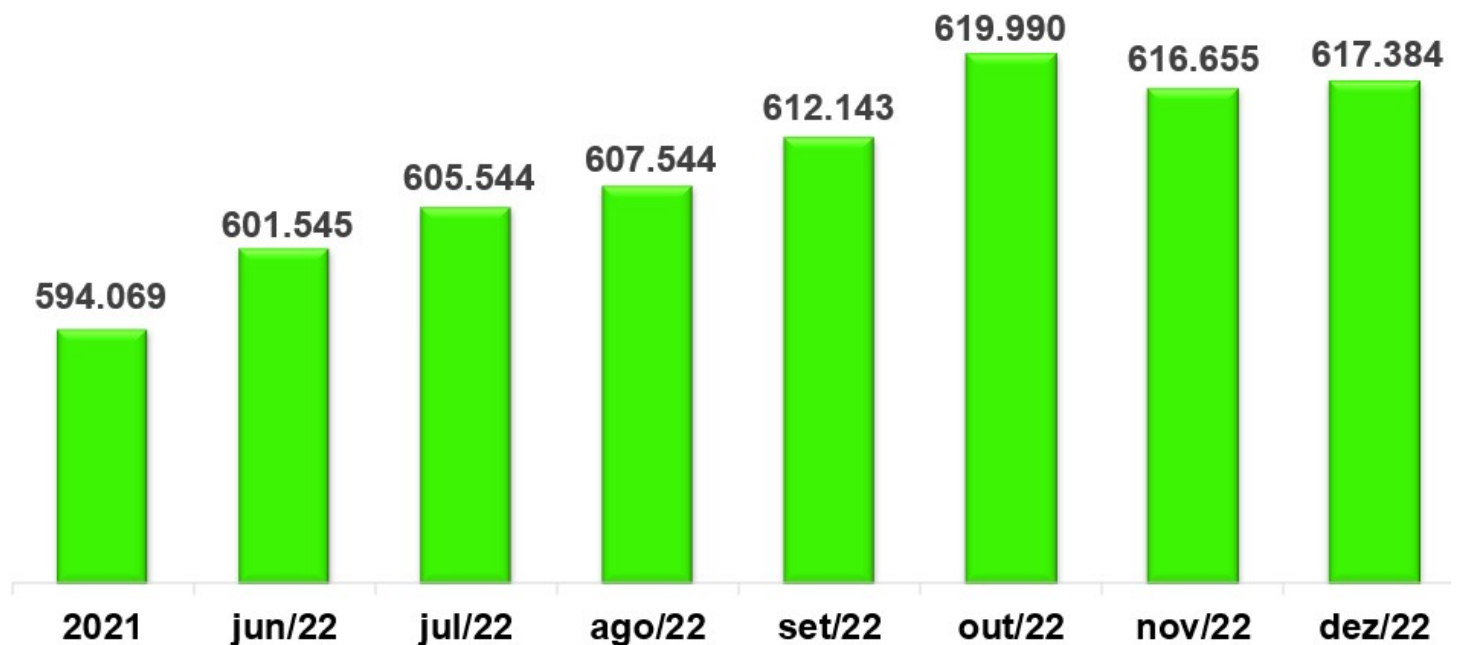
No mês, os destaques positivos ficaram com os ativos de renda fixa vinculados à taxa de juros pós-fixada (títulos públicos remunerados pela Selic - LFT), além dos ativos de crédito privado.

O Plano Anaparprev obteve uma valorização das cotas em 1,07% no mês de dezembro, equivalente a 96% CDI e superior ao índice de referência, que foi de 0,89%. No ano de 2022, o Plano registrou ganho de 11,93%, equivalente a 96% CDI e acima do índice de referência, de 8,49%, que representou 140%. Os segmentos de renda fixa e estruturados (fundos multimercado) foram os que mais contribuíram para a performance positiva no ano.

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..