

PLANO ANAPARPREV

Informativo mensal de rentabilidade

Janeiro - 2022



Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 592.982.028
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	31/12/2018
Data	31/01/2022

Política de Investimento

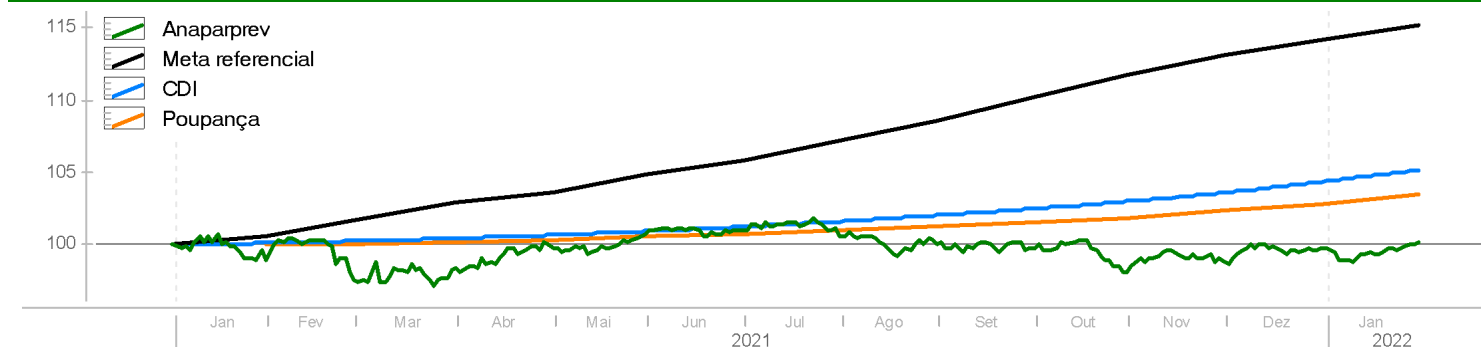
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

Rentabilidades (%) (até 31/01/2022)

	fev 2021	mar 2021	abr 2021	mai 2021	jun 2021	jul 2021	ago 2021	set 2021	out 2021	nov 2021	dez 2021	jan 2022	2020	2021	2022	6m
● Anaparprev	-1,44	0,96	1,28	1,06	0,29	-0,51	-0,48	-0,34	-1,58	0,68	0,92	0,42	2,75	-0,26	0,42	-0,40
● Meta referencial	1,13	1,17	0,69	1,27	0,91	1,34	1,18	1,51	1,47	1,15	1,04	0,87	9,75	14,27	0,87	7,44
● CDI	0,13	0,20	0,21	0,27	0,31	0,36	0,43	0,44	0,49	0,59	0,77	0,73	2,76	4,42	0,73	3,49
● Poupança	0,12	0,12	0,16	0,16	0,16	0,29	0,24	0,30	0,36	0,44	0,49	0,56	2,11	2,99	0,56	2,42

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	7
Meses Negativos	5
Meses Acima do CDI	5
Meses Abaixo do CDI	7
Maior Retorno Mensal (%)	1,28
Menor Retorno Mensal (%)	-1,58
Retorno Acumulado (%)	1,22
Retorno Acumulado (% CDI)	24,26

Perfil de Risco

Volatilidade Anual	3,30
Sharpe	0,20
VAR 21 dias	1,37
Máximo Draw down	-2,88
Alfa de Jensen	-3,70

Comentários

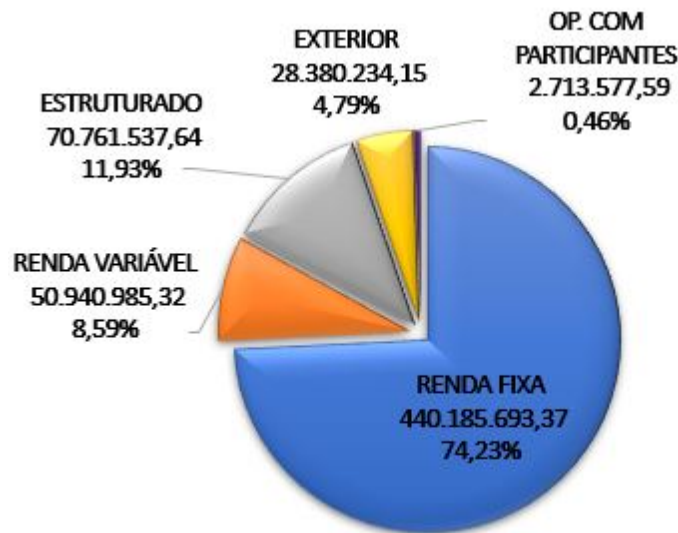
O mês de janeiro foi pautado pelo aumento do risco nos países desenvolvidos devido à mudança de expectativa quanto ao ritmo de normalização da política monetária nos EUA, com estimativas de mais altas nas taxas de juros ao longo de 2022, impactando negativamente o desempenho das principais bolsas de valores mundiais. Além disso, o mercado acompanhou com preocupação a tensão entre Rússia e Ucrânia, que também refletiu de forma negativa nos agentes econômicos. Por outro lado, o mercado reagiu, positivamente, à divulgação dos balanços corporativos do 4º trimestre de 2021 nos EUA, que apresentaram resultados acima do esperado.

No Brasil, diferentemente do mercado financeiro externo, a bolsa de valores foi beneficiada pelo forte fluxo de entrada de capital estrangeiro no mês, apesar do Comitê de Política Monetária - Copom, ter sinalizado no comunicado a continuidade da política monetária mais contracionista para combater a inflação persistente e em patamares elevados.

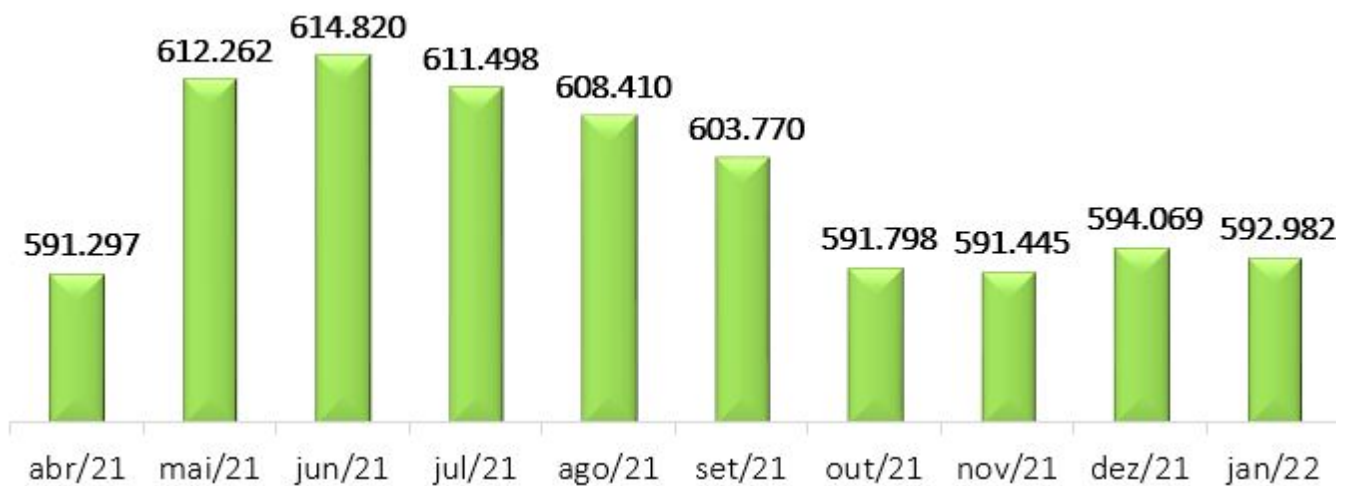
Diante desse contexto, o Ibovespa encerrou o mês de janeiro com valorização de 6,98%. No mercado de renda fixa, a curva de juros voltou a ganhar inclinação positiva com abertura em todos os vértices (vencimentos), principalmente, em decorrência dos ajustes das expectativas com relação à condução da política monetária e aumento de juros globais, com a inflação mais pressionada.

O Plano Anaparprev alcançou uma valorização de 0,42% no mês de janeiro, equivalente a 57% CDI e abaixo da meta referencial, 0,87%. Os segmentos de renda variável 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..