

# PLANO ANAPARPREV

## Informativo mensal de rentabilidade

### Setembro - 2022



#### Características

CNPB - Cadastro Nacional de Plano de Benefícios	2008.0008-18
Gestão	Viva Previdência
Patrimônio	R\$ 614.350.688
Custódia Centralizada	Banco BTG Pactual
Data do início da cota	31/12/2018
Data	30/09/2022

#### Política de Investimento

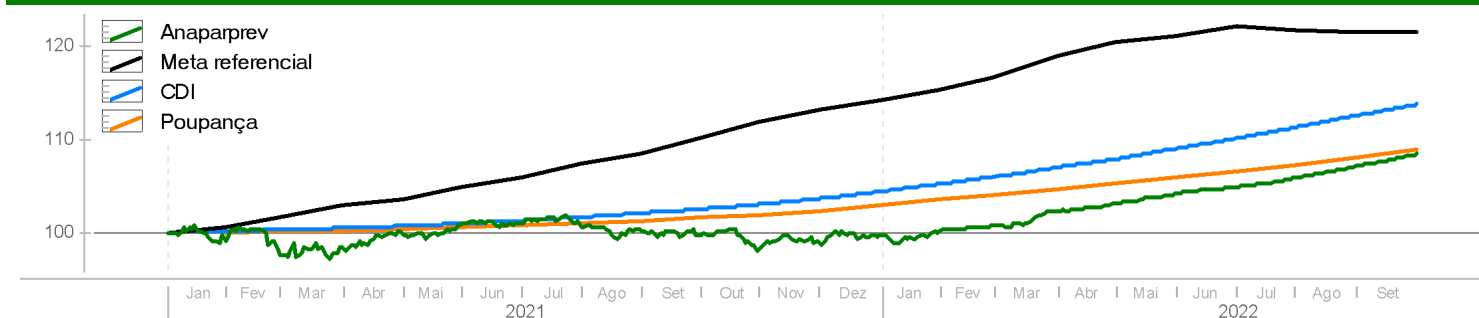
Para a modalidade do Plano, o modelo adotado de gestão é de fronteira eficiente, focado na superação de metas e referenciais de mercado. Para a consecução do seu objetivo, aplicará seus recursos em cotas de fundos de investimentos com perfis diferenciados e estratégia com horizonte de médio e longo prazo.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

#### Rentabilidades (%) (até 30/09/2022)

	set 2022	ago 2022	jul 2022	jun 2022	mai 2022	abr 2022	2022	2021	6m
● Anaparprev	1,17	1,23	0,86	0,76	1,01	0,87	8,62	-0,26	6,04
● Meta referencial	-0,12	-0,11	-0,40	0,82	0,65	1,24	6,20	14,27	2,09
● CDI	1,07	1,17	1,03	1,02	1,03	0,83	8,91	4,42	6,32
● Poupança	0,68	0,74	0,66	0,65	0,67	0,56	5,76	2,99	4,03

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	11
Meses Negativos	1
Meses Acima do CDI	6
Meses Abaixo do CDI	6
Maior Retorno Mensal (%)	1,50
Menor Retorno Mensal (%)	-1,58
Retorno Acumulado (%)	8,62
Retorno Acumulado (% CDI)	78,90

#### Perfil de Risco

Volatilidade Anual	2,28
Sharpe (12 meses)	-0,91
VAR 21 dias	0,15
Máximo Draw down	0,00
Alfa de Jensen	-2,28

#### Comentários

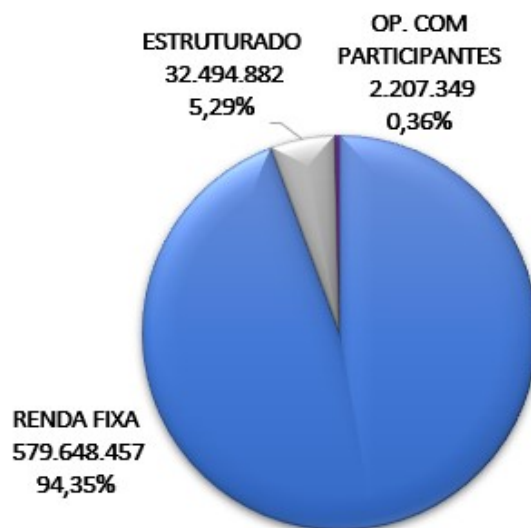
O mês de setembro foi marcado pela forte aversão a risco nos mercados internacionais devido aos seguintes fatores: (I) continuidade do movimento de desaceleração da economia global, (II) novos dados negativos de inflação vindos dos EUA e Europa, e (III) anúncio de novo plano econômico no Reino Unido. Os efeitos sobre os mercados financeiros foram a queda acentuada nas principais bolsas de valores mundiais, maior volatilidade no preço dos ativos e aumento das taxas de juros globais.

O mercado doméstico, na contramão dos mercados externos, pelo segundo mês consecutivo performou positivamente. Os vetores determinantes foram: (I) a queda nas projeções de inflação, (II) as revisões altistas do crescimento econômico, (III) a melhora da taxa de desemprego e (III) o encerramento do ciclo de alta da taxa de juros pelo BACEN.

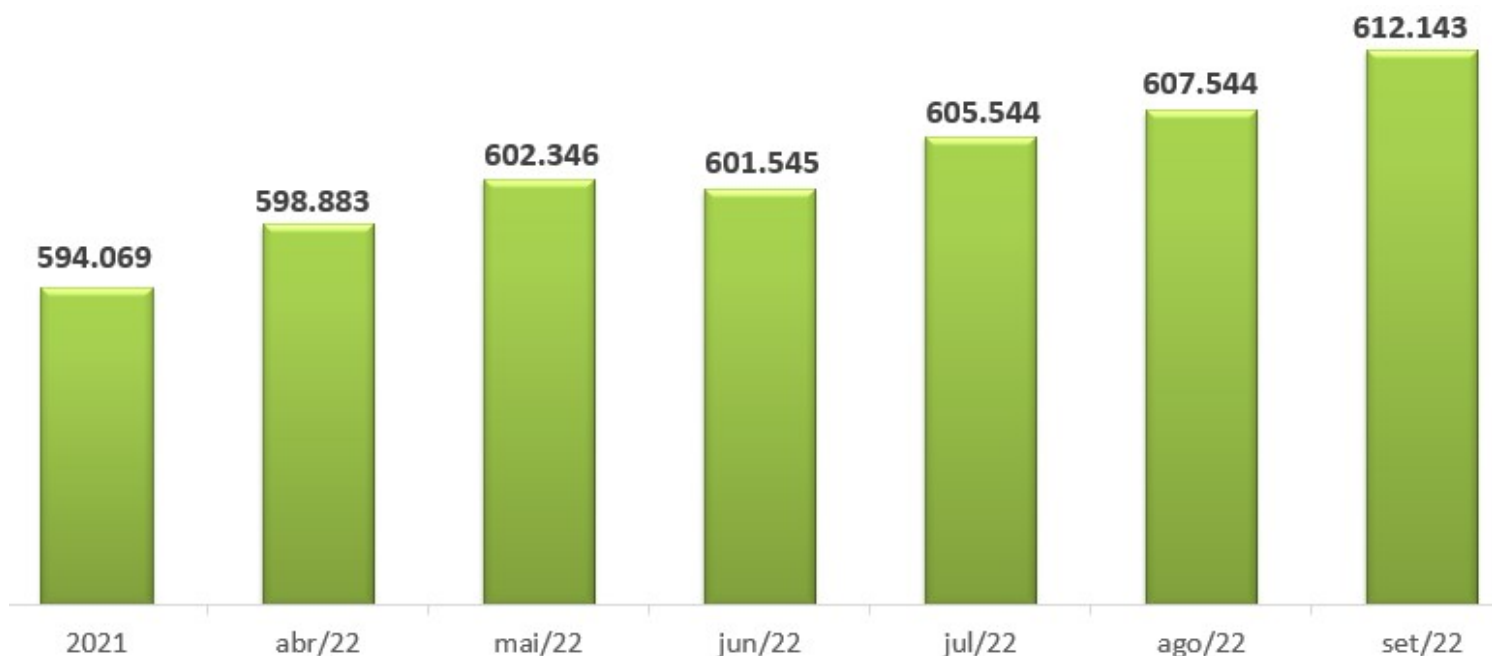
No mês, os destaques positivos das aplicações em renda fixa foram os ativos vinculados à taxa de juros nominal (LTN) e real de médio e longo prazo (NTN-B). Os ativos atrelados ao CDI/Selic apresentaram ganhos de 1,07%. Em linha com o ambiente interno favorável, o Ibovespa (principal índice da bolsa brasileira) fechou em alta de 0,47%, enquanto o IHFA (índice de fundos multimercados) subiu 1,49%, no mês. Por fim, o Dólar americano fechou setembro com valorização de 4,39% frente ao Real, no mês em que a moeda americana voltou a se fortalecer globalmente com o aumento de taxas de juros americanas.

O Plano Anaparprev alcançou uma valorização de 1,17% no mês de setembro, equivalente a 109% CDI e superior ao índice de referência, que foi de -0,12%. No acumulado do ano até setembro, o Plano registrou ganho de 8,62%, equivalente a 97% CDI e acima do índice de referência em 139%. Os segmentos de renda fixa 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..