

ANÁLISE DE INVESTIMENTOS

SARAHPREV PLANO CV

Data-base: 28/03/2024

O Relatório de Análise de Investimentos (RAI) apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e retorno. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações apresentadas foram extraídas dos relatórios de risco de mercado já produzidos pela ADITUS. A seguir, uma fotografia da alocação segregada por mandatos ou segmentos, de acordo com as especificações da Política de Investimentos.

VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	2.365.584.961,71	75,86%			0,95%	2,79%	5,62%	2,79%	10,20%		
Benchmark	INPC + 5% a.a.				0,58%	2,78%	4,81%	2,78%	8,46%	18,85%	39,43%
RENDA FIXA TRADICIONAL	218.868.456,35	7,00%		0,01%	0,94%						
SARAHPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	-517.545,19	-0,02%		-1,53%	0,00%	0,00%	2,47%	0,00%	6,15%		
BB INSTIT. FI RF	219.386.001,54	7,02%	BB	0,01%	0,94%	2,86%	5,96%	2,86%	12,95%	27,46%	36,30%
Benchmark	CDI				0,83%	2,62%	5,54%	2,62%	12,36%	27,28%	35,44%
MULTIMERCADO INSTITUCIONAL	304.647.228,24	9,74%		0,27%	0,73%						
FI MULT BTG PACTUAL SARAHPREV BELO HORIZON	152.064.344,08	4,86%	BTG PACTUAL	0,42%	0,69%	2,07%	5,53%	2,07%			
BRADESCO FI MULT SARAHPREV SALVADOR	152.582.884,16	4,88%	BRADESCO	0,16%	0,78%	2,20%	5,91%	2,20%			
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.				0,95%	3,00%	6,30%	3,00%	14,01%	31,09%	41,59%
RENDA FIXA ALM	1.494.981.975,94	47,82%		0,00%	0,99%						
BRADESCO FI RF SARAHPREV BRASILIA ALM	1.494.981.975,94	47,82%	BRADESCO	0,00%	0,99%	2,93%	5,48%	2,93%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.				0,58%	2,78%	4,81%	2,78%	8,46%	18,85%	39,43%
RENDA FIXA CRÉDITO CDI	173.694.950,99	5,56%		0,00%	1,13%						
BRADESCO FI RF CRED PRIV SARAHPREV FORTALE	173.694.950,99	5,56%	BRADESCO	0,00%	1,13%	3,55%	6,93%	3,55%			
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.				0,95%	3,00%	6,30%	3,00%	14,01%	31,09%	41,59%
RENDA FIXA CRÉDITO IPCA	173.392.350,19	5,55%		0,41%	0,85%						
SARAHPREV RIO DE JANEIRO RF CRED PRIV FI	173.392.350,19	5,55%	ITAU	0,11%	0,85%	2,72%	5,80%	2,72%			
Benchmark	IPCA + 7,5% a.a.				0,74%	3,21%	6,17%	3,21%	11,56%	25,50%	50,16%
Renda Variável	282.848.184,18	9,05%		0,40%	-2,96%	10,18%	-2,96%	28,63%			
Benchmark	IBOVESPA				-0,71%	-4,53%	9,90%	-4,53%	25,74%	6,76%	9,84%
RENDA VARIÁVEL ATIVA	282.848.184,18	9,05%		1,58%	0,40%						
BB SARAHPREV MÓDULO RV FIC FIA	282.848.184,18	9,05%	BB	5,30%	0,40%	-2,95%	10,19%	-2,95%	28,64%		
Benchmark	IBOVESPA + 2% a.a.				-0,55%	-4,07%	10,96%	-4,07%	28,20%	11,03%	16,51%
Estruturado	192.610.521,43	6,16%		0,02%	0,94%	4,27%	0,94%	7,82%			
Benchmark	CDI + 2% a.a.				0,99%	3,12%	6,55%	3,12%	14,56%	32,37%	43,68%
MULTIMERCADO ESTRUTURADO	154.573.457,88	4,94%		0,86%	1,37%						
BB SARAHPREV MÓDULO MULT FIC FI MULT	154.573.457,88	4,94%	BB	0,86%	1,37%	1,86%	6,05%	1,86%	10,48%		
Benchmark	CDI + 2% a.a.				0,99%	3,12%	6,55%	3,12%	14,56%	32,37%	43,68%
FIP	38.037.063,55	1,22%		0,00%	-0,08%						
FIPPAÇÕES EM HOTELARIA MULTIEST.	18,01	0,00%	POLO CAPITAL								
FUNDO BRASIL DE INTERIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP	6.150.994,70	0,20%	SPX								
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOG.S - FIPPAÇÕES MUL'	2.494.908,15	0,08%	BRZ								
OLEO E GAS FIPPAcoes MULTIEST.	73,04	0,00%	GENIAL								
FS - FIPPAÇÕES MULTIEST.	160.190,70	0,01%	SPX								
FUNDO BRASIL DE INTERIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP	3.606.019,39	0,12%	SPX								
FIPPAÇÕES MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	2.034.417,71	0,07%	KINEA								
LACAN FLORESTAL- FIPPAÇÕES MULTIEST.	13.291.112,22	0,43%	LACAN								
PATRIA INFRA. FIC FIPPAÇÕES	6.066.171,74	0,19%	PATRIA								
PATRIA BRASIL INFRA. III FIC FIPPAÇÕES	4.233.157,88	0,14%	PATRIA								
Benchmark	IPCA				0,16%	1,42%	2,51%	1,42%	3,93%	8,76%	21,05%
Exterior	200.774.816,43	6,42%		3,07%	11,25%	19,54%	11,25%	23,54%			
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)				3,25%	11,91%	20,18%	11,91%	21,08%	18,71%	7,19%
EXTERIOR – RV (SEM HEDGE)	154.297.776,53	4,94%		0,67%	3,95%						
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	80.683.843,81	2,58%	BB	1,95%	3,66%	13,55%	22,89%	13,55%	25,66%	28,77%	21,74%
BB MULT SCHRODER IE FI	73.613.932,72	2,35%	BB	1,22%	4,27%	13,16%	19,92%	13,16%	24,88%	22,27%	12,68%
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)				3,25%	11,91%	20,18%	11,91%	21,08%	18,71%	7,19%
EXTERIOR – RV (COM HEDGE)	46.477.039,89	1,49%		2,29%	0,24%						
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI	46.477.039,89	1,49%	BB	3,29%	0,24%	4,76%	13,58%	4,76%	18,08%	24,66%	41,84%
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)				3,25%	11,91%	20,18%	11,91%	21,08%	18,71%	7,19%
Imobiliário	16.929.911,40	0,54%		-1,13%	-13,30%	-13,29%	-13,30%	2,62%			
Benchmark	IFIX				1,43%	2,92%	5,87%	2,92%	23,44%	22,60%	19,72%
FII	16.929.911,40	0,54%		2,27%	-1,76%						
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	3.465.600,00	0,11%	BTG PACTUAL								
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	13.464.311,40	0,43%	VBI								
Benchmark	IFIX				1,43%	2,92%	5,87%	2,92%	23,44%	22,60%	19,72%
Operação com Participantes	67.794.559,81	2,17%		0,97%	2,60%	4,84%	2,60%	11,60%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.				0,58%	2,78%	4,81%	2,78%	8,46%	18,85%	39,43%
Total	3.126.542.954,96	100,00%		0,60%	0,97%	2,53%	6,69%	2,53%	12,94%		
Benchmark	INPC + 5% a.a.				0,58%	2,78%	4,81%	2,78%	8,46%	18,85%	39,43%

Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados. A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.