

SARAHPREV PLANO CV

Data-base: 28/06/2024

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	2.416.458.010,94	75,82%				0,79%	2,28%	5,14%	5,14%	9,23%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,64%	2,32%	5,17%	5,17%	8,80%	17,64%	38,25%	
RENDA FIXA TRADICIONAL	203.877.594,65	6,40%			0,01%								
SARAHPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	-539.200,58	-0,02%			-0,75%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	3,09%			
BB INSTIT. FI RF	204.416.795,23	6,41%	BB		0,01%	0,82%	2,54%	5,47%	5,47%	12,24%	26,97%	38,51%	
Benchmark	CDI					0,79%	2,53%	5,22%	5,22%	11,69%	26,82%	37,79%	
MULTIMERCADO INSTITUCIONAL	320.617.125,71	10,06%			0,47%								
FI MULT BTG PACTUAL SARAHPREV BELO HORIZON	155.868.376,15	4,89%	BTG PACTUAL		0,80%	0,35%	-0,22%	1,85%	1,85%				
BRADESCO FI MULT SARAHPREV SALVADOR	164.748.749,56	5,17%	BRADESCO		0,24%	0,54%	1,91%	4,15%	4,15%				
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.					0,91%	2,91%	5,99%	5,99%	13,34%	30,61%	44,05%	
RENDA FIXA ALM	1.531.411.333,56	48,05%			0,00%								
BRADESCO FI RF SARAHPREV BRASÍLIA ALM	1.531.411.333,56	48,05%	BRADESCO		0,00%	0,83%	2,44%	5,43%	5,43%				
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,64%	2,32%	5,17%	5,17%	8,80%	17,64%	38,25%	
RENDA FIXA CRÉDITO CDI	191.645.131,15	6,01%			0,00%								
BRADESCO FI RF CRED PRIV SARAHPREV FORTALE	191.645.131,15	6,01%	BRADESCO		0,00%	0,93%	3,04%	6,69%	6,69%				
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.					0,91%	2,91%	5,99%	5,99%	13,34%	30,61%	44,05%	
RENDA FIXA CRÉDITO IPCA	168.906.825,86	5,30%			0,30%								
SARAHPREV RIO DE JANEIRO RF CRED PRIV FI	168.906.825,86	5,30%	ITAU		0,04%	0,85%	2,44%	5,23%	5,23%				
Benchmark	IPCA + 7,5% a.a.					0,79%	2,90%	6,20%	6,20%	11,92%	24,08%	49,24%	
Renda Variável	265.030.803,15	8,32%				0,88%	-6,30%	-9,07%	-9,07%	0,86%			
Benchmark	IBOVESPA					1,48%	-3,28%	-7,66%	-7,66%	4,93%	25,74%	-2,28%	
RENDA VARIÁVEL ATIVA	265.030.803,15	8,32%			1,66%								
BB SARAHPREV MÓDULO RV FIC FIA	265.030.803,15	8,32%	BB		4,77%	0,88%	-6,30%	-9,06%	-9,06%	0,86%			
Benchmark	IBOVESPA + 2% a.a.					1,64%	-2,80%	-6,76%	-6,76%	6,99%	30,77%	3,66%	
Estruturado	192.800.227,22	6,05%				1,47%	0,10%	1,04%	1,04%	5,63%			
Benchmark	CDI + 2% a.a.					0,95%	3,04%	6,25%	6,25%	13,89%	31,89%	46,17%	
MULTIMERCADO ESTRUTURADO	153.180.751,01	4,81%			1,46%								
BB SARAHPREV MÓDULO MULT FIC FI MULT	153.180.751,01	4,81%	BB		1,46%	0,86%	-0,90%	0,94%	0,94%	7,15%			
Benchmark	CDI + 2% a.a.					0,95%	3,04%	6,25%	6,25%	13,89%	31,89%	46,17%	
FIP	39.619.476,21	1,24%			0,00%								
FIP EM HOTELARIA MULTIEST.	10.362,96	0,00%	POLO CAPITAL										
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPI	5.610.947,39	0,18%	SPX										
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS - FIP MULTIE	2.497.746,36	0,08%	BRZ									89,43%	
OLEO E GAS FIP MULTIEST.	73,54	0,00%	GENIAL										
FS - FIP MULTIEST.	159.850,96	0,01%	SPX										
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPI	3.711.609,12	0,12%	SPX										
FIP MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	1.961.264,09	0,06%	KINEA										
LACAN FLORESTAL- FIP MULTIEST.	13.254.272,68	0,42%	LACAN										
PATRIA INFRA. FIC FIP	8.284.619,08	0,26%	PATRIA										
PATRIA BRASIL INFRA. III FIC FIP	4.128.730,03	0,13%	PATRIA										
Benchmark	IPCA					0,21%	1,05%	2,48%	2,48%	4,23%	7,52%	20,30%	
Exterior	224.777.938,66	7,05%				8,65%	11,96%	24,55%	24,55%	35,98%			
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)					8,10%	13,69%	27,24%	27,24%	36,54%	46,37%	29,34%	
EXTERIOR – RV (SEM HEDGE)	178.750.594,85	5,61%			3,46%								
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	93.417.529,97	2,93%	BB		4,38%	10,57%	15,78%	31,47%	31,47%	46,24%	65,37%	49,33%	
BB MULT SCHRODER IE FI	85.333.064,87	2,68%	BB		4,26%	10,44%	15,92%	31,18%	31,18%	42,73%	51,86%	35,33%	
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)					8,10%	13,69%	27,24%	27,24%	36,54%	46,37%	29,34%	
EXTERIOR – RV (COM HEDGE)	46.027.343,81	1,44%			2,71%								
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE FIF	46.027.343,81	1,44%	BB		3,47%	2,01%	-0,97%	3,75%	3,75%	10,52%	32,50%	32,21%	
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)					8,10%	13,69%	27,24%	27,24%	36,54%	46,37%	29,34%	
Imobiliário	15.386.768,88	0,48%				-3,69%	-6,97%	-19,34%	-19,34%	-19,94%			
Benchmark	IFIX					-1,04%	-1,78%	1,08%	1,08%	6,09%	19,73%	21,51%	
FII	15.386.768,88	0,48%			3,69%								
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	3.061.200,00	0,10%	BTG PACTUAL			-7,57%	-11,67%	-13,96%	-13,96%	-23,61%	-17,56%	-37,01%	
FII CENESP	93.000,00	0,00%	BTG PACTUAL			-5,49%	-46,92%	-93,16%	-93,16%	-94,57%	-95,33%	-96,27%	
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	12.232.568,88	0,38%	VBI			-3,55%	-9,15%	-10,61%	-10,61%	-6,48%	0,50%	-2,20%	
Benchmark	IFIX					-1,04%	-1,78%	1,08%	1,08%	6,09%	19,73%	21,51%	
Operação com Participantes	72.672.693,37	2,28%				0,38%	3,18%	5,86%	5,86%	11,67%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,64%	2,32%	5,17%	5,17%	8,80%	17,64%	38,25%	
Total	3.187.126.442,23	100,00%				0,47%	1,32%	1,97%	4,54%	4,54%	10,29%		
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,64%	2,32%	5,17%	5,17%	8,80%	17,64%	38,25%	

Observações:

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas foram obtidas através dos valores de suas cotas divulgadas publicamente. A partir desses valores, os retornos dos mandatos no mês são estimados. Em ambos os casos, eventuais movimentações feitas pela EFPC não são refletidas nos valores calculados.

O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do plano.

Os retornos dos mandatos foram calculados através da ponderação da alocação pela rentabilidade de cada mês ao longo dos períodos apresentados.

Este 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.