

ANÁLISE DE INVESTIMENTOS

SARAHPREV PLANO CV

Data-base: 30/04/2024

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	2.378.570.771,98	76,13%				0,63%	2,55%	5,63%	3,44%	9,72%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,80%	2,58%	5,09%	3,60%	8,37%	18,13%	39,47%	
RENDA FIXA TRADICIONAL	210.718.609,20	6,74%			0,01%	0,85%							
SARAHPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	-520.788,91	-0,02%			-0,87%	0,00%	0,00%	1,65%	0,00%	5,03%			
BB INSTIT. FI RF	211.239.398,11	6,76%	BB		0,01%	0,85%	2,67%	5,78%	3,73%	12,94%	27,49%	37,02%	
Benchmark	CDI					0,89%	2,54%	5,42%	3,54%	12,33%	27,35%	36,36%	
MULTIMERCADO INSTITUCIONAL	303.706.324,00	9,72%			0,39%	-0,30%							
FI MULT BTG PACTUAL SARAHPREV BELO HORIZON	150.184.547,43	4,81%	BTG PACTUAL		0,67%	-1,24%	0,29%	4,03%	0,81%				
BRADESCO FI MULT SARAHPREV SALVADOR	153.521.776,56	4,91%	BRADESCO		0,16%	0,62%	2,16%	5,54%	2,83%				
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.					1,02%	2,91%	6,19%	4,04%	14,01%	31,18%	42,57%	
RENDA FIXA ALM	1.505.770.572,82	48,19%			0,00%	0,72%							
BRADESCO FI RF SARAHPREV BRASILIA ALM	1.505.770.572,82	48,19%	BRADESCO		0,00%	0,72%	2,74%	5,57%	3,67%				
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,80%	2,58%	5,09%	3,60%	8,37%	18,13%	39,47%	
RENDA FIXA CRÉDITO CDI	183.773.989,42	5,88%			0,01%	1,08%							
BRADESCO FI RF CRED PRIV SARAHPREV FORTALE	183.773.989,42	5,88%	BRADESCO		0,01%	1,08%	3,30%	6,85%	4,67%				
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.					1,02%	2,91%	6,19%	4,04%	14,01%	31,18%	42,57%	
RENDA FIXA CRÉDITO IPCA	174.601.276,55	5,59%			0,24%	0,70%							
SARAHPREV RIO DE JANEIRO RF CRED PRIV FI	174.601.276,55	5,59%	ITAU		0,13%	0,70%	2,43%	5,68%	3,44%				
Benchmark	IPCA + 7,5% a.a.					1,02%	3,17%	6,35%	4,25%	11,43%	24,77%	50,35%	
Renda Variável	270.599.184,06	8,66%					-4,33%	-3,13%	10,19%	-7,16%	20,16%		
Benchmark	IBOVESPA						-1,70%	-1,43%	11,30%	-6,16%	20,58%	16,73%	5,91%
RENDA VARIÁVEL ATIVA	270.599.184,06	8,66%			1,99%	-4,33%							
BB SARAHPREV MÓDULO RV FIC FIA	270.599.184,06	8,66%	BB		5,72%	-4,33%	-3,12%	10,20%	-7,15%	20,17%			
Benchmark	IBOVESPA + 2% a.a.					-1,53%	-0,96%	12,38%	-5,54%	22,98%	21,43%	12,37%	
Estruturado	189.463.732,12	6,06%					-1,63%	-0,52%	3,11%	-0,71%	5,70%		
Benchmark	CDI + 2% a.a.						1,06%	3,04%	6,45%	4,21%	14,57%	32,47%	44,68%
MULTIMERCADO ESTRUTURADO	151.266.945,08	4,84%			1,51%	-2,14%							
BB SARAHPREV MÓDULO MULT FIC FI MULT	151.266.945,08	4,84%	BB		1,51%	-2,14%	-0,23%	4,18%	-0,32%	7,82%			
Benchmark	CDI + 2% a.a.					1,06%	3,04%	6,45%	4,21%	14,57%	32,47%	44,68%	
FIP	38.196.787,04	1,22%			0,00%	-0,09%							
FIP EM HOTELARIA MULTIEST.	12.934,72	0,00%	POLO CAPITAL										
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPI	6.225.939,61	0,20%	SPX										
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS - FIP MULTIE	2.493.578,73	0,08%	BRZ								28,10%		
OLEO E GAS FIP MULTIEST.	73,04	0,00%	GENIAL										
FS - FIP MULTIEST.	160.073,62	0,01%	SPX										
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPI	3.647.670,81	0,12%	SPX										
FIP MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	2.048.953,02	0,07%	KINEA										
LACAN FLORESTAL - FIP MULTIEST.	13.279.690,74	0,43%	LACAN										
PATRIA INFRA. FIC FIP	6.093.028,74	0,20%	PATRIA										
PATRIA BRASIL INFRA. III FIC FIP	4.234.844,01	0,14%	PATRIA										
Benchmark	IPCA					0,38%	1,38%	2,66%	1,80%	3,69%	8,03%	21,13%	
Exterior	199.691.240,66	6,39%					-0,54%	6,41%	21,20%	10,65%	22,83%		
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)						-0,45%	7,66%	22,08%	11,41%	20,54%	24,31%	7,65%
EXTERIOR – RV (SEM HEDGE)	154.889.746,79	4,96%			2,77%	0,38%							
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	81.001.160,91	2,59%	BB		6,00%	0,39%	9,42%	25,49%	14,00%	27,72%	33,20%	21,03%	
BB MULT SCHRODER IE FI	73.888.585,89	2,36%	BB		5,08%	0,37%	8,60%	23,36%	13,59%	25,60%	26,68%	11,45%	
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)						-0,45%	7,66%	22,08%	11,41%	20,54%	24,31%	7,65%
EXTERIOR – RV (COM HEDGE)	44.801.493,86	1,43%			4,31%	-3,61%							
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI	44.801.493,86	1,43%	BB		2,96%	-3,61%	-1,72%	11,12%	0,98%	11,10%	22,61%	31,46%	
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)						-0,45%	7,66%	22,08%	11,41%	20,54%	24,31%	7,65%
Imobiliário	16.736.731,68	0,54%					-0,91%	-1,85%	-12,35%	-14,09%	-3,64%		
Benchmark	IFIX						-0,77%	1,45%	7,16%	2,12%	18,32%	20,22%	18,20%
FII	16.736.731,68	0,54%			1,54%	-1,99%							
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	3.324.000,00	0,11%	BTG PACTUAL			-4,09%	-9,31%	2,88%	-6,58%	-0,81%	-20,52%	-35,17%	
FII CENESP	106.200,00	0,00%	BTG PACTUAL			-39,38%	-92,78%	-92,07%	-92,19%	-93,42%	-94,61%	-95,86%	
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	13.306.531,68	0,43%	VBI			-1,17%	-2,55%	-2,90%	-2,76%	4,38%	5,86%	3,84%	
Benchmark	IFIX					-0,77%	1,45%	7,16%	2,12%	18,32%	20,22%	18,20%	
Operação com Participantes	69.319.063,66	2,22%					1,47%	3,63%	5,42%	4,11%	12,11%		
Benchmark	INPC + 5% a.a.						0,80%	2,58%	5,09%	3,60%	8,37%	18,13%	39,47%
Total	3.124.380.724,16	100,00%					0,79%	-0,03%	2,08%	6,74%	2,50%	11,73%	
Benchmark	INPC + 5% a.a.						0,80%	2,58%	5,09%	3,60%	8,37%	18,13%	39,47%

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.

EFPC: SARAHPREV

Plano: PLANO CV

Data-Base: 30/04/2024

CNPB: 1996003747

O Relatório de Demonstrativo de Investimentos tem como objetivo acompanhar os investimentos de acordo com o Art. 6º da Resolução CNPC nº 32, de 04 de dezembro de 2019. Para fins do disposto nesse artigo, cada ativo pertencente à carteira própria e aos fundos de investimentos exclusivos da EFPC deve ser especificado com, no mínimo, tipo de ativo, segmento de aplicação, bem como a quantidade e valor.

CONSOLIDAÇÃO DE DADOS

Total de Recursos do Plano (fonte: balancete)	R\$	3.128.902.173,35
Total de Recursos do XML	R\$	3.128.902.173,32
Diferença	R\$	0,03

INFORMAÇÕES XML

Tipo do Ativo	Carteira Própria + Fundo Exclusivo	
	Quantidade	Valor
Renda Fixa		
Depósitos	-	R\$ 529.142,93
Títulos Públicos	493.168,74	R\$ 1.830.584.071,67
Títulos Privados	24.955,55	R\$ 35.740.467,68
Opções	-41,74	-R\$ 7.416,91
Operações Compromissadas	0,00	R\$ -
Contratos a Termo	0,00	R\$ -
Contratos de Futuro	6.863,52	-R\$ 144.364,57
Contratos de Swap	0,00	R\$ -
Valores a Pagar (-) / Receber (+)	-	R\$ 4.047.371,23
Exigível Contingencial	-	R\$ -
Renda Variável		
Ações	0,00	R\$ -
Opções	0,00	R\$ -
Outros	0,00	R\$ -
Imobiliário		
Títulos Privados	0,00	R\$ -
Imóveis	-	R\$ -
Estruturado		
COE	0,00	R\$ -
Operações com Participantes		
Empréstimos/Financiamentos (Valor Total - Provisões)	-	R\$ 69.319.063,66
Exterior		
Ações	0,00	R\$ -

ALOCAÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1º NÍVEL)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE FIF	38.110.528/0001-96	32.285.504,88	R\$ 44.801.493,86
BB INSTIT. FI RF	02.296.928/0001-90	16.737.413,72	R\$ 211.239.398,11
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	17.413.636/0001-68	12.412.353,42	R\$ 81.001.160,91
BB MULT SCHRODER IE FI	17.431.816/0001-72	12.833.114,65	R\$ 73.888.585,89
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS - FIP MULTIEST.	14.737.553/0001-36	2.829,00	R\$ 2.493.578,73
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	08.924.783/0001-01	60.000,00	R\$ 3.324.000,00
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	35.652.102/0001-76	132.588,00	R\$ 13.306.531,68
FII CENESP	13.551.286/0001-45	60.001,00	R\$ 106.201,77

Os dados utilizados para a confecção desse relatório foram obtidos junto à Instituição à qual se refere tal relatório. Os valores aqui apresentados decorrem da utilização desses dados, de dados obtidos junto a fontes públicas e da interpretação da legislação aplicável. A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.



RELATÓRIO DE DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS

EFPC: SARAHPREV
Plano: PLANO CV

Data-base: 30/04/2024
CNPB: 1996003747

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1º NÍVEL)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
FIP EM HOTELARIA MULTIEST.	14.067.624/0001-30	496,95	R\$ 12.934,72
FIP MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	15.039.162/0001-00	8.870,00	R\$ 2.048.953,02
FS - FIP MULTIEST.	16.465.811/0001-06	1,99	R\$ 160.073,62
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP MULTIEST.	11.760.191/0001-06	9.668,61	R\$ 3.647.670,81
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP MULTIEST.	19.837.544/0001-30	4.565,57	R\$ 6.225.939,61
LACAN FLORESTAL- FIP MULTIEST.	13.812.224/0001-40	997,62	R\$ 13.279.690,74
OLEO E GAS FIP MULTIEST.	11.083.096/0001-15	7.304,05	R\$ 73,04
PATRIA BRASIL INFRA. III FIC FIP	17.870.798/0001-25	6.096,38	R\$ 4.234.844,01
PATRIA INFRA. FIC FIP	12.517.924/0001-49	9.508,03	R\$ 6.093.028,74

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (ATRAVÉS DOS EXCLUSIVOS)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
ABSOLUTE VERTEX 30 BB FIC FI MULT	32.892.954/0001-42	7.327.830,74	R\$ 12.209.577,79
APEX AÇÕES 30 FIC FIA	15.862.830/0001-03	4.557.161,53	R\$ 10.765.794,92
BB TOP PRINCIPAL RF REF. DI LP FI	03.504.023/0001-21	88.524,34	R\$ 1.417.242,79
BB TOP RF CP FI	01.608.573/0001-65	64.191,17	R\$ 1.316.491,37
BRAM FI RF CRED PRIV BANCOS	15.675.415/0001-32	9.628.364,43	R\$ 25.601.768,08
BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV	38.653.941/0001-05	108.479.034,79	R\$ 158.267.093,29
BRASIL CAPITAL BB 30 FIC FIA	35.704.405/0001-95	11.739.485,15	R\$ 16.732.040,13
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTIT. FIQ DE FIA	11.977.794/0001-64	1.955.111,83	R\$ 6.681.900,66
CLARITAS ARBITRAGEM BB FIC FI MULT	27.793.086/0001-03	5.777.619,10	R\$ 8.437.701,09
DAHLIA AÇÕES FIC FIA	30.858.733/0001-22	10.047.052,13	R\$ 12.197.192,52
DAHLIA TOTAL RETURN BB FIC FI MULT	42.402.544/0001-20	4.027.603,40	R\$ 4.411.326,19
GENOA CAPITAL VESTAS B FIC FI MULT	49.240.295/0001-62	11.349.444,65	R\$ 13.357.730,01
IBIUNA HEDGE STC FIC FI MULT	38.195.760/0001-74	57.745,18	R\$ 7.945.290,48
ITAU DISTRIBUIDORES OPTIMUS EXTREME MULT FICFI	40.616.164/0001-62	269.082,20	R\$ 4.733.665,61
ITAÚ FIDELIDADE T - FI RF	11.419.811/0001-48	1.402.317,19	R\$ 48.587.216,71
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	20.355.007/0001-33	1.847.549,11	R\$ 41.936.604,63
ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	07.928.916/0001-55	3.915.069,83	R\$ 20.640.541,80
JGP STRATEGY FIC FI MULT - FEEDER VI	24.688.398/0001-69	71.180,68	R\$ 13.154.412,41
KAPITALO ZETA BB FIC FI MULT	30.507.672/0001-59	7.992.959,04	R\$ 12.914.398,16
KINEA ZEUS FI FINANC. DA EM COTAS MULT	42.556.631/0001-31	8.553.388,32	R\$ 11.150.850,49
LEBLON AÇÕES II INSTIT. FIC FIA	26.768.800/0001-40	104.951,23	R\$ 18.431.434,65
LEGACY CAPITAL BB FIC FI MULT	35.343.900/0001-16	7.980.003,01	R\$ 12.183.351,49
MILES BB VIRTUS LONG ONLY FIC FIA	39.611.548/0001-03	10.923.880,85	R\$ 10.380.852,76
NAVI INSTIT. II FIC FIA	34.659.901/0001-01	29.254.568,50	R\$ 34.688.519,77
NAVI LS BB FIC FI MULT	34.081.172/0001-59	7.221.071,95	R\$ 10.408.245,86
NEO PROPECTUS II FIC FI MULT	24.140.338/0001-07	2.640.647,83	R\$ 6.212.810,06
OCEANA VALOR 30 DBB FIC FIA	32.386.727/0001-45	23.378.128,99	R\$ 35.423.277,69
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	11.403.850/0001-57	3.024.314,14	R\$ 12.728.644,05
REAL INVESTOR INSTIT. FIC FIA	52.070.019/0001-08	21.719.036,37	R\$ 23.906.819,45
RPS TOTAL RETURN BB D30 FIC FI MULT	42.500.804/0001-08	5.396.791,05	R\$ 5.894.650,96
SHARP IBRX ATIVO BB FIA	50.676.647/0001-06	33.324.335,29	R\$ 38.553.233,41

SPACEX FIC FI MULT	29.994.389/0001-10	9.298.566,73	R\$	14.077.943,55
SPX APACHE FIC FIA	16.565.056/0001-23	7.469.604,16	R\$	24.461.320,03

! Os dados utilizados para a confecção desse relatório foram obtidos junto à Instituição à qual se refere tal relatório. Os valores aqui apresentados decorrem da utilização desses dados, de dados obtidos junto a fontes públicas e da interpretação da legislação aplicável. A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.



RELATÓRIO DE DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS

EFPC: SARAHPREV
Plano: PLANO CV

Data-base: 30/04/2024
CNPB: 1996003747

ALOCAÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (ATRAVÉS DOS EXCLUSIVOS)

Nome	CNPJ	Quantidade		Valor
TORK LONG ONLY INSTIT. FIC FIA	31.533.145/0001-81	8.829.575,94	R\$	15.678.213,21
VERDE AM BB60 FIC FI MULT	34.808.989/0001-86	9.372.380,77	R\$	12.637.491,42
VINCI MOSAICO INSTIT. FIA	28.470.587/0001-11	2.034.952,25	R\$	15.203.654,30

! Os dados utilizados para a confecção desse relatório foram obtidos junto à Instituição à qual se refere tal relatório. Os valores aqui apresentados decorrem da utilização desses dados, de dados obtidos junto a fontes públicas e da interpretação da legislação aplicável. A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.