

ANÁLISE DE INVESTIMENTOS

SARHPREV PLANO CV

Data-base: 29/02/2024

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	2.343.632.547,90	75,69%			0,95%	2,94%	4,36%	1,82%	10,84%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.				1,18%	3,15%	4,72%	2,19%	9,01%	20,70%	40,45%	
SEGMENTO RENDA FIXA	2.000.321.737,25	64,61%			0,95%							
SARHPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	-511.262,59	-0,02%			0,00%	0,69%	1,93%	0,00%	7,84%			
BB INSTIT. FI RF	226.343.575,47	7,31%	BB	0,01%	0,86%	2,92%	6,02%	1,90%	13,16%	27,49%	35,37%	
FI MULT BTG PACTUAL SARHPREV BELO HORIZON	146.900.968,13	4,74%	BTG PACTUAL		0,85%	2,80%		1,37%				
BRADESCO FI RF SARHPREV BRASÍLIA ALM	1.480.314.191,38	47,81%	BRADESCO		0,00%	1,00%	2,92%	1,92%				
BRADESCO FI MULT SARHPREV SALVADOR	147.924.264,86	4,76%	BRADESCO		0,16%	0,74%	2,74%	1,41%				
Benchmark	INPC + 5% a.a.				1,18%	3,15%	4,72%	2,19%	9,01%	20,70%	40,45%	
SEGMENTO RF CRÉDITO	343.310.810,65	11,09%			0,11%	0,95%						
BRADESCO FI RF CRED PRIV SARHPREV FORTALE	171.388.336,61	5,54%	BRADESCO		0,01%	1,05%	3,40%	2,39%				
SARHPREV RIO DE JANEIRO RF CRED PRIV FI	171.922.474,03	5,55%	ITAU		0,22%	0,85%	2,93%	1,85%				
Benchmark	INPC + 5% a.a.				1,18%	3,15%	4,72%	2,19%	9,01%	20,70%	40,45%	
Renda Variável	281.732.769,75	9,10%			0,86%	2,06%	9,30%	-3,34%	22,91%			
Benchmark	IBOVESPA				0,99%	1,33%	11,47%	-3,85%	22,96%	14,03%	17,25%	
SEGMENTO RENDA VARIÁVEL	281.732.769,75	9,10%			0,86%							
BB SARHPREV MÓDULO RV FIC FIA	281.732.769,75	9,10%	BB	5,61%	0,86%	2,06%	9,31%	-3,33%	22,91%			
Benchmark	IBOVESPA				0,99%	1,33%	11,47%	-3,85%	22,96%	14,03%	17,25%	
Estruturado	192.579.291,33	6,22%			1,12%	2,67%	4,86%	0,93%	7,47%			
Benchmark	CDI + 2% a.a.				0,95%	3,18%	6,70%	2,10%	14,98%	32,51%	42,81%	
SEGMENTO ESTRUTURADO	192.579.291,33	6,22%			1,34%							
BB SARHPREV MÓDULO MULT FIC FI MULT	152.486.585,70	4,92%	BB	0,86%	0,57%	2,77%	5,15%	0,49%	9,06%			
FIPPAÇÕES EM HOTELARIA MULTIEST.	2.865,79	0,00%	POLO CAPITAL									
FUNDO BRASIL DE INTERIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP	6.812.242,01	0,22%	SPX									
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOG.S - FIPPAÇÕES MUL	2.602.407,43	0,08%	BRZ									
OLEO E GAS FIPPAÇÕES MULTIEST.	73,04	0,00%	GENIAL									
FS - FIPPAÇÕES MULTIEST.	487.001,45	0,02%	SPX									
FUNDO BRASIL DE INTERIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP	4.578.267,52	0,15%	SPX									
FIPPAÇÕES MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	2.018.707,07	0,07%	KINEA									
LACAN FLORESTAL- FIPPAÇÕES MULTIEST.	13.301.713,46	0,43%	LACAN		10,11%	9,93%	9,67%	10,02%	-0,57%	-9,15%	-14,95%	
PATRIA INFRA. FIC FIPPAÇÕES	5.770.506,31	0,19%	PATRIA									
PATRIA BRASIL INFRA. III FIC FIPPAÇÕES	4.518.921,56	0,15%	PATRIA									
Benchmark	IPCA + 5% a.a.				1,20%	3,03%	5,07%	2,06%	9,68%	21,58%	41,15%	
Exterior	194.797.452,58	6,29%			3,81%	11,39%	13,23%	7,94%	20,04%			
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)				4,74%	11,44%	13,16%	8,39%	17,64%	8,58%	10,28%	
SEGMENTO INVESTIMENTO NO EXTERIOR	194.797.452,58	6,29%			1,37%	3,82%						
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	77.833.609,12	2,51%	BB	2,33%	5,14%	13,55%	16,35%	9,54%	20,83%	18,03%	21,97%	
BB MULT SCHRODER IE FI	70.600.367,19	2,28%	BB	1,85%	3,77%	11,27%	12,76%	8,53%	17,40%	11,44%	12,06%	
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI	46.363.476,28	1,50%	BB	1,82%	1,70%	8,11%	9,01%	4,51%	22,88%	26,84%	44,86%	
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)				4,74%	11,44%	13,16%	8,39%	17,64%	8,58%	10,28%	
Imobiliário	17.234.586,36	0,56%			0,18%	-13,04%	-12,50%	-12,31%	1,49%			
Benchmark	IFIX				0,79%	5,77%	4,58%	1,47%	19,64%	22,58%	16,40%	
SEGMENTO IMOBILIÁRIO	17.234.586,36	0,56%			2,38%	-0,49%						
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	3.582.000,00	0,12%	BTG PACTUAL		-2,28%	-0,22%	-2,13%	0,67%	12,85%	-13,28%	-31,31%	
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	13.652.586,36	0,44%	VBI		-0,02%	1,97%	-2,04%	-0,23%	20,08%	16,48%	6,01%	
Benchmark	IFIX				0,79%	5,77%	4,58%	1,47%	19,64%	22,58%	16,40%	
Operação com Participantes	66.251.981,05	2,14%			1,16%	2,50%	4,39%	1,62%	15,34%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.				1,18%	3,15%	4,72%	2,19%	9,01%	20,70%	40,45%	
Total	3.096.228.628,98	100,00%			1,13%	3,23%	5,26%	1,54%	12,02%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.				1,18%	3,15%	4,72%	2,19%	9,01%	20,70%	40,45%	

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: 29/02/2024

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\$	3.098.652.325,85
Total de Recursos do XML	R\$	3.098.652.325,85
Diferença	R\$	0,00

INFORMAÇÕES XML

Tipo do Ativo	Carteira Própria + Fundo Exclusivo	
	Quantidade	Valor
Renda Fixa		
Depósitos	-	R\$ 31.229,18
Títulos Públicos	356.738,14	R\$ 1.787.281.263,76
Títulos Privados	26.671,20	R\$ 38.506.830,29
Opções	23,00	R\$ 151.451,40
Operações Compromissadas	0,00	R\$ -
Contratos a Termo	42,00	R\$ 184.779,52
Contratos de Futuro	18.988,41	R\$ 102.690,44
Contratos de Swap	0,00	-R\$ 511.262,59
Valores a Pagar (-) / Receber (+)	-	R\$ 2.785.561,45
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\$ 66.251.981,05
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\$ 46.363.476,28
BB INSTIT. FI RF	02.296.928/0001-90	18.256.492,27	R\$ 226.343.575,47
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	17.413.636/0001-68	12.412.353,42	R\$ 77.833.609,12
BB MULT SCHRODER IE FI	17.431.816/0001-72	12.833.114,65	R\$ 70.600.367,19
BB SARAHPREV MÓDULO MULT FIC FI MULT	46.685.249/0001-89	136.715.072,10	R\$ 152.486.585,70
BB SARAHPREV MÓDULO RV FIC FIA	46.685.235/0001-65	226.866.105,15	R\$ 281.732.769,75
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS - FIP MULTIEST.	14.737.553/0001-36	2.829,00	R\$ 2.602.407,43
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	08.924.783/0001-01	60.000,00	R\$ 3.582.000,00

! 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: 29/02/2024
CNPB: 1996003747

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1º NÍVEL)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	35.652.102/0001-76	132.588,00	R\$ 13.652.586,36
FIP EM HOTELARIA MULTIEST.	14.067.624/0001-30	494,95	R\$ 2.865,79
FIP MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	15.039.162/0001-00	8.870,00	R\$ 2.018.707,07
FS - FIP MULTIEST.	16.465.811/0001-06	1,99	R\$ 487.001,45
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP MULTIEST.	11.760.191/0001-06	9.668,61	R\$ 4.578.267,52
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP MULTIEST.	19.837.544/0001-30	4.565,57	R\$ 6.812.242,01
LACAN FLORESTAL- FIP MULTIEST.	13.812.224/0001-40	997,62	R\$ 13.301.713,46
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\$ 4.518.921,56
PATRIA INFRA. FIC FIP	12.517.924/0001-49	9.508,03	R\$ 5.770.506,31

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (ATRAVÉS DOS EXCLUSIVOS)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
BRAM FI RF CRED PRIV BANCOS	15.675.415/0001-32	6.530.924,85	R\$ 17.037.949,90
BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV	38.653.941/0001-05	108.275.836,30	R\$ 154.439.758,83
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTIT. FIQ DE FIA	11.977.794/0001-64	2.941.611,72	R\$ 10.819.063,17
ITAÚ FIDELIDADE T - FI RF	11.419.811/0001-48	1.406.677,20	R\$ 47.907.022,38
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	20.355.007/0001-33	1.853.293,41	R\$ 41.245.096,74
ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	07.928.916/0001-55	3.927.242,35	R\$ 20.515.796,23

! 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.