

## SARAHPREV PLANO CV

Data-base: 31/01/2024

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     |  |
| <b>Renda Fixa</b>                             | <b>2.323.717.787,07</b> | <b>75,87%</b>  |              |                  | <b>0,87%</b>   | <b>3,01%</b>   | <b>4,10%</b>   | <b>0,87%</b>   | <b>10,84%</b> |               |         |  |
| Benchmark                                     | INPC + 5% a.a.          |                |              |                  | 1,00%          | 2,45%          | 4,17%          | 1,00%          | 8,95%         | 20,93%        | 40,43%  |  |
| <b>SEGMENTO RENDA FIXA</b>                    | <b>1.988.121.150,26</b> | <b>64,91%</b>  |              | <b>0,15%</b>     | <b>0,82%</b>   |                |                |                |               |               |         |  |
| SARAHPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF        | -508.286,52             | -0,02%         |              |                  | 0,00%          | 1,65%          | 2,57%          | 0,00%          | 8,87%         |               |         |  |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI                  | 69.202.088,67           | 2,26%          | BB           | 0,75%            | 0,66%          | 3,94%          | 4,32%          | 0,66%          | 11,14%        | 23,30%        | 28,53%  |  |
| BB INSTIT. FI RF                              | 224.645.371,10          | 7,33%          | BB           | 0,01%            | 1,03%          | 3,02%          | 6,37%          | 1,03%          | 12,98%        | 27,41%        | 34,38%  |  |
| BB PREV RF IMA-B5+ TIT PUB FI                 | 52.408.335,51           | 1,71%          | BB           | 3,71%            | -1,51%         | 5,82%          | 1,40%          | -1,51%         | 18,57%        | 22,51%        | 14,29%  |  |
| FI MULT BTG PACTUAL SARAHPREV BELO HORIZON    | 83.109.434,50           | 2,71%          | BTG PACTUAL  | 0,65%            | 0,52%          | 3,73%          |                | 0,52%          |               |               |         |  |
| BRADESCO FI RF SARAHPREV BRASÍLIA ALM         | 1.475.659.967,32        | 48,18%         | BRADESCO     | 0,00%            | 0,91%          | 2,76%          |                | 0,91%          |               |               |         |  |
| BRADESCO FI MULT SARAHPREV SALVADOR           | 83.604.239,68           | 2,73%          | BRADESCO     | 0,34%            | 0,68%          | 3,31%          |                | 0,66%          |               |               |         |  |
| Benchmark                                     | INPC + 5% a.a.          |                |              |                  | 1,00%          | 2,45%          | 4,17%          | 1,00%          | 8,95%         | 20,93%        | 40,43%  |  |
| <b>SEGMENTO RF CRÉDITO</b>                    | <b>335.596.636,82</b>   | <b>10,96%</b>  |              | <b>0,11%</b>     | <b>1,16%</b>   |                |                |                |               |               |         |  |
| BRADESCO FI RF CRED PRIV SARAHPREV FORTALE    | 165.130.047,86          | 5,39%          | BRADESCO     | 0,01%            | 1,33%          | 3,44%          |                | 1,33%          |               |               |         |  |
| SARAHPREV RIO DE JANEIRO RF CRED PRIV FI      | 170.466.588,95          | 5,57%          | ITAU         | 0,20%            | 0,99%          | 3,18%          |                | 0,99%          |               |               |         |  |
| Benchmark                                     | INPC + 5% a.a.          |                |              |                  | 1,00%          | 2,45%          | 4,17%          | 1,00%          | 8,95%         | 20,93%        | 40,43%  |  |
| <b>Renda Variável</b>                         | <b>279.320.951,65</b>   | <b>9,12%</b>   |              |                  | <b>-4,16%</b>  | <b>13,75%</b>  | <b>2,52%</b>   | <b>-4,16%</b>  | <b>12,85%</b> |               |         |  |
| Benchmark                                     | IBOVESPA                |                |              |                  | -4,79%         | 12,91%         | 4,76%          | -4,79%         | 12,63%        | 13,92%        | 11,02%  |  |
| <b>SEGMENTO RENDA VARIÁVEL</b>                | <b>279.320.951,65</b>   | <b>9,12%</b>   |              | <b>6,52%</b>     | <b>-4,16%</b>  |                |                |                |               |               |         |  |
| BB SARAHPREV MÓDULO RV FIC FIA                | 279.320.951,65          | 9,12%          | BB           | 6,52%            | -4,16%         | 13,75%         | 2,52%          | -4,16%         | 12,85%        |               |         |  |
| Benchmark                                     | IBOVESPA                |                |              |                  | -4,79%         | 12,91%         | 4,76%          | -4,79%         | 12,63%        | 13,92%        | 11,02%  |  |
| <b>Estruturado</b>                            | <b>190.453.652,49</b>   | <b>6,22%</b>   |              |                  | <b>-0,19%</b>  | <b>3,65%</b>   | <b>3,21%</b>   | <b>-0,19%</b>  | <b>6,58%</b>  |               |         |  |
| Benchmark                                     | CDI + 2% a.a.           |                |              |                  | 1,14%          | 3,31%          | 7,09%          | 1,14%          | 15,10%        | 32,44%        | 41,85%  |  |
| <b>SEGMENTO ESTRUTURADO</b>                   | <b>190.453.652,49</b>   | <b>6,22%</b>   |              | <b>0,80%</b>     | <b>-0,09%</b>  |                |                |                |               |               |         |  |
| BB SARAHPREV MÓDULO MULT FIC FI MULT          | 151.620.680,29          | 4,95%          | BB           | 1,00%            | -0,09%         | 4,42%          | 4,52%          | -0,09%         | 8,87%         |               |         |  |
| FIPPAÇÕES EM HOTELARIA MULTIEST.              | 9.182,81                | 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' | 2.603.031,69            | 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   | 2.033.366,19            | 0,07%          | KINEA        |                  |                |                |                |                |               |               |         |  |
| LACAN FLORESTAL- FIPPAÇÕES MULTIEST.          | 12.079.931,75           | 0,39%          | LACAN        |                  |                |                |                |                |               |               |         |  |
| PATRIA INFRA. FIC FIPPAÇÕES                   | 5.737.308,64            | 0,19%          | PATRIA       |                  | -0,09%         | -0,24%         | -0,50%         | -0,09%         | -0,61%        | -6,73%        | -19,08% |  |
| PATRIA BRASIL INFRA. III FIC FIPPAÇÕES        | 4.492.567,10            | 0,15%          | PATRIA       |                  |                |                |                |                |               |               |         |  |
| Benchmark                                     | IPCA + 5% a.a.          |                |              |                  | 0,85%          | 2,49%          | 4,53%          | 0,85%          | 9,67%         | 21,80%        | 41,17%  |  |
| <b>Exterior</b>                               | <b>187.653.907,05</b>   | <b>6,13%</b>   |              |                  | <b>3,98%</b>   | <b>13,89%</b>  | <b>11,43%</b>  | <b>3,98%</b>   | <b>16,93%</b> |               |         |  |
| Benchmark                                     | MSCI WORLD (BRL)        |                |              |                  | 3,48%          | 13,39%         | 9,28%          | 3,48%          | 11,80%        | -3,12%        | 8,94%   |  |
| <b>SEGMENTO INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>      | <b>187.653.907,05</b>   | <b>6,13%</b>   |              | <b>1,46%</b>     | <b>3,98%</b>   |                |                |                |               |               |         |  |
| BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI            | 74.030.246,07           | 2,42%          | BB           | 2,30%            | 4,18%          | 14,69%         | 13,57%         | 4,18%          | 17,84%        | 7,21%         | 23,15%  |  |
| BB MULT SCHRODER IE FI                        | 68.036.965,88           | 2,22%          | BB           | 2,01%            | 4,59%          | 13,59%         | 11,70%         | 4,59%          | 14,68%        | 1,47%         | 13,75%  |  |
| BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI   | 45.586.695,10           | 1,49%          | BB           | 2,64%            | 2,75%          | 13,06%         | 7,76%          | 2,75%          | 18,93%        | 23,09%        |         |  |
| Benchmark                                     | MSCI WORLD (BRL)        |                |              |                  | 3,48%          | 13,39%         | 9,28%          | 3,48%          | 11,80%        | -3,12%        | 8,94%   |  |
| <b>Imobiliário</b>                            | <b>17.320.638,12</b>    | <b>0,57%</b>   |              |                  | <b>-12,47%</b> | <b>-10,70%</b> | <b>-14,20%</b> | <b>-12,47%</b> | <b>0,74%</b>  |               |         |  |
| Benchmark                                     | IFIX                    |                |              |                  | 0,67%          | 5,63%          | 4,26%          | 0,67%          | 18,16%        | 20,04%        | 15,77%  |  |
| <b>SEGMENTO IMOBILIÁRIO</b>                   | <b>17.320.638,12</b>    | <b>0,57%</b>   |              | <b>3,50%</b>     | <b>0,47%</b>   |                |                |                |               |               |         |  |
| FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND   | 3.665.400,00            | 0,12%          | BTG PACTUAL  |                  | 3,02%          | 13,44%         | -9,86%         | 3,02%          | 6,99%         | -14,04%       | -32,05% |  |
| FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES               | 13.655.238,12           | 0,45%          | VBI          |                  | -0,21%         | -0,36%         | 0,20%          | -0,21%         | 22,04%        | 16,37%        |         |  |
| Benchmark                                     | IFIX                    |                |              |                  | 0,67%          | 5,63%          | 4,26%          | 0,67%          | 18,16%        | 20,04%        | 15,77%  |  |
| <b>Operação com Participantes</b>             | <b>64.249.452,54</b>    | <b>2,10%</b>   |              |                  | <b>0,46%</b>   | <b>1,73%</b>   | <b>3,85%</b>   | <b>0,46%</b>   | <b>15,19%</b> |               |         |  |
| Benchmark                                     | INPC + 5% a.a.          |                |              |                  | 1,00%          | 2,45%          | 4,17%          | 1,00%          | 8,95%         | 20,93%        | 40,43%  |  |
| <b>Total</b>                                  | <b>3.062.716.388,93</b> | <b>100,00%</b> |              |                  | <b>0,73%</b>   | <b>0,42%</b>   | <b>4,49%</b>   | <b>4,16%</b>   | <b>0,42%</b>  | <b>10,90%</b> |         |  |
| Benchmark                                     | INPC + 5% a.a.          |                |              |                  | 1,00%          | 2,45%          | 4,17%          | 1,00%          | 8,95%         | 20,93%        | 40,43%  |  |

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.

EFPC: SARAHPREV

Plano: PLANO CV

Data-Base: 31/01/2024

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\$         | 3.062.067.581,08 |
| Total de Recursos do XML                      | R\$         | 3.062.067.581,08 |
| <b>Diferença</b>                              | <b>-R\$</b> | <b>0,00</b>      |

## INFORMAÇÕES XML

| Tipo do Ativo  | Carteira Própria + Fundo Exclusivo |                      |
|--|------------------------------------|----------------------|
|  | Quantidade                         | Valor                |
| <b>Renda Fixa</b>                                    |                                    |                      |
| Depósitos  | -                                  | R\$ 639.129,12       |
| Títulos Públicos                                     | 362.050,12                         | R\$ 1.660.391.448,89 |
| Títulos Privados                                     | 25.970,45                          | R\$ 37.462.381,83    |
| Opções   | 10,00                              | R\$ 28.782,16        |
| Operações Compromissadas                             | 0,00                               | R\$ -                |
| Contratos a Termo                                    | 313,00                             | R\$ 4.130.088,67     |
| Contratos de Futuro                                  | 5.147,63                           | R\$ 36.935,29        |
| Contratos de Swap                                    | 0,00                               | R\$ -                |
| Valores a Pagar (-) / Receber (+)                    | -                                  | -R\$ 1.277.247,13    |
| Exigível Contingencial                               | -                                  | R\$ -                |
| <b>Renda Variável</b>                                |                                    |                      |
| Ações  | 0,00                               | R\$ -                |
| Opções   | 0,00                               | R\$ -                |
| Outros   | 0,00                               | R\$ -                |
| <b>Imobiliário</b>                                   |                                    |                      |
| Títulos Privados                                     | 0,00                               | R\$ -                |
| Imóveis  | -                                  | R\$ -                |
| <b>Estruturado</b>                                   |                                    |                      |
| COE  | 0,00                               | R\$ -                |
| <b>Operações com Participantes</b>                   |                                    |                      |
| Empréstimos/Financiamentos (Valor Total - Provisões) | -                                  | R\$ 64.249.452,54    |
| <b>Exterior</b>                                      |                                    |                      |
| 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\$ 45.586.695,10  |
| BB INSTIT. FI RF                     | 02.296.928/0001-90 | 18.275.534,65  | R\$ 224.645.371,10 |
| BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI   | 17.413.636/0001-68 | 12.412.353,42  | R\$ 74.030.246,07  |
| BB MULT SCHRODER IE FI               | 17.431.816/0001-72 | 12.833.114,65  | R\$ 68.036.965,88  |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI         | 03.543.447/0001-03 | 2.605.300,48   | R\$ 69.202.088,67  |
| BB PREV RF IMA-B5+ TIT PUB FI        | 13.327.340/0001-73 | 13.064.744,19  | R\$ 52.408.335,51  |
| BB SARAHPREV MÓDULO MULT FIC FI MULT | 46.685.249/0001-89 | 136.715.072,10 | R\$ 151.620.680,29 |
| BB SARAHPREV MÓDULO RV FIC FIA       | 46.685.235/0001-65 | 226.866.105,15 | R\$ 279.320.951,65 |

! 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: 31/01/2024  
CNPB: 1996003747

### ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1º NÍVEL)

| Nome  | CNPJ               | Quantidade | Valor             |
|---|--------------------|------------|-------------------|
| BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS - FIP MULTIEST.             | 14.737.553/0001-36 | 2.829,00   | R\$ 2.603.031,69  |
| FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND                   | 08.924.783/0001-01 | 60.000,00  | R\$ 3.665.400,00  |
| FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES                               | 35.652.102/0001-76 | 132.588,00 | R\$ 13.655.238,12 |
| FIP EM HOTELARIA MULTIEST.                                    | 14.067.624/0001-30 | 494,95     | R\$ 9.182,81      |
| FIP MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II                         | 15.039.162/0001-00 | 8.870,00   | R\$ 2.033.366,19  |
| 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\$ 12.079.931,75 |
| 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\$ 4.492.567,10  |
| PATRIA INFRA. FIC FIP   | 12.517.924/0001-49 | 9.508,03   | R\$ 5.737.308,64  |

### ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (ATRAVÉS DOS EXCLUSIVOS)

| Nome                                    | CNPJ               | Quantidade     | Valor              |
|---|--------------------|----------------|--------------------|
| BRAM FI RF CRED PRIV BANCOS             | 15.675.415/0001-32 | 6.363.188,91   | R\$ 16.449.562,37  |
| BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV            | 38.653.941/0001-05 | 105.421.514,98 | R\$ 148.785.917,21 |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTIT. FIQ DE FIA | 11.977.794/0001-64 | 1.731.192,28   | R\$ 6.216.169,62   |
| ITAÚ FIDELIDADE T - FI RF               | 11.419.811/0001-48 | 1.406.677,42   | R\$ 47.527.305,94  |
| ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI            | 20.355.007/0001-33 | 1.853.293,71   | R\$ 40.850.972,66  |
| ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI       | 07.928.916/0001-55 | 3.927.242,98   | R\$ 20.407.969,21  |

! 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.