

SARAHPREV PLANO CV

Data-base: 31/07/2024

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	2.459.408.112,30	76,37%				0,85%	2,51%	5,12%	6,04%	9,44%		
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,71%	2,23%	4,87%	5,92%	9,22%	18,71%	37,23%
RENDA FIXA TRADICIONAL	203.506.021,78	6,32%			0,00%							
SARAHPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	-545.266,20	-0,02%			-0,36%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	2,57%		
BB INSTIT. FI RF	204.051.287,98	6,34%	BB		0,00%	1,00%	2,69%	5,43%	6,52%	12,15%	26,91%	39,35%
Benchmark	CDI					0,91%	2,55%	5,16%	6,18%	11,51%	26,66%	38,55%
MULTIMERCADO INSTITUCIONAL	335.800.605,08	10,43%			0,57%							
FI MULT BTG PACTUAL SARAHPREV BELO HORIZON	157.435.013,04	4,89%	BTG PACTUAL		0,95%	1,01%	2,05%	2,34%	2,87%			
BRADESCO FI MULT SARAHPREV SALVADOR	178.365.592,05	5,54%	BRADESCO		0,39%	0,90%	2,20%	4,40%	5,09%			
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.					1,04%	2,94%	5,94%	7,10%	13,17%	30,46%	44,85%
RENDA FIXA ALM	1.553.115.125,73	48,23%			0,00%							
BRADESCO FI RF SARAHPREV BRASÍLIA ALM	1.553.115.125,73	48,23%	BRADESCO		0,00%	0,77%	2,48%	5,29%	6,24%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,71%	2,23%	4,87%	5,92%	9,22%	18,71%	37,23%
RENDA FIXA CRÉDITO CDI	205.369.825,54	6,38%			0,01%							
BRADESCO FI RF CRED PRIV SARAHPREV FORTALE	205.369.825,54	6,38%	BRADESCO		0,01%	1,13%	3,08%	6,48%	7,90%			
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.					1,04%	2,94%	5,94%	7,10%	13,17%	30,46%	44,85%
RENDA FIXA CRÉDITO IPCA	161.616.534,16	5,02%			0,31%							
SARAHPREV RIO DE JANEIRO RF CRED PRIV FI	161.616.534,16	5,02%	ITAU		0,05%	0,92%	2,67%	5,16%	6,20%			
Benchmark	IPCA + 7,5% a.a.					1,04%	2,93%	6,18%	7,31%	12,27%	25,47%	48,42%
Renda Variável	273.333.056,75	8,49%				3,13%	1,01%	-2,15%	-6,22%	0,31%		
Benchmark	IBOVESPA					3,02%	1,37%	-0,08%	-4,87%	4,68%	23,74%	4,80%
RENDA VARIÁVEL ATIVA	273.333.056,75	8,49%			1,58%							
BB SARAHPREV MÓDULO RV FIC FIA	273.333.056,75	8,49%	BB		6,58%	3,13%	1,01%	-2,14%	-6,21%	0,32%		
Benchmark	IBOVESPA + 2% a.a.					3,21%	1,88%	0,91%	-3,76%	6,76%	28,70%	11,18%
Estruturado	196.033.023,56	6,09%				0,49%	2,26%	1,73%	1,54%	5,00%		
Benchmark	CDI + 2% a.a.					1,09%	3,07%	6,20%	7,41%	13,72%	31,74%	46,99%
MULTIMERCADO ESTRUTURADO	155.731.702,50	4,84%			1,37%							
BB SARAHPREV MÓDULO MULT FIC FI MULT	155.731.702,50	4,84%	BB		1,37%	1,67%	2,95%	2,71%	2,62%	7,35%		
Benchmark	CDI + 2% a.a.					1,09%	3,07%	6,20%	7,41%	13,72%	31,74%	46,99%
FIP	40.301.321,05	1,25%			0,00%							
SARAHPREV MACAPÁ II FIC FI MULT	37.798.402,03	1,17%	VINCI		0,73%							
FIP EM HOTELARIA MULTIEST.	5.939,96	0,00%	POLO CAPITAL									
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS - FIP MULTIE	2.496.979,06	0,08%	BRZ									
Benchmark	IPCA					0,38%	1,05%	2,44%	2,87%	4,50%	8,67%	19,61%
Exterior	202.078.474,38	6,28%				0,30%	12,90%	20,14%	24,93%	33,88%		
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)					3,59%	18,30%	27,37%	31,80%	39,18%	41,92%	28,65%
EXTERIOR – RV (SEM HEDGE)	178.521.902,25	5,54%			1,54%							
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	93.403.290,27	2,90%	BB		3,46%	-0,02%	15,31%	26,17%	31,45%	43,29%	53,48%	39,87%
BB MULT SCHRODER IE FI	85.118.611,98	2,64%	BB		3,53%	-0,25%	15,20%	25,11%	30,85%	39,74%	44,57%	28,48%
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)					3,59%	18,30%	27,37%	31,80%	39,18%	41,92%	28,65%
EXTERIOR – RV (COM HEDGE)	23.556.572,13	0,73%			3,11%							
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE FIF	23.556.572,13	0,73%	BB		3,86%	2,66%	5,47%	3,65%	6,51%	11,69%	28,46%	32,28%
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)					3,59%	18,30%	27,37%	31,80%	39,18%	41,92%	28,65%
Imobiliário	15.599.077,80	0,48%				2,15%	-4,10%	-5,87%	-17,61%	-19,23%		
Benchmark	IFIX					0,52%	-0,50%	0,94%	1,61%	5,24%	19,57%	19,14%
FII	15.599.077,80	0,48%			7,60%							
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	2.999.400,00	0,09%	BTG PACTUAL		-2,02%	-2,02%	-9,77%	-18,17%	-15,70%	-26,24%	-12,07%	-38,29%
FII CENESP	90.000,00	0,00%	BTG PACTUAL		-3,23%	-3,23%	-15,25%	-93,88%	-93,38%	-94,73%	-95,38%	-96,21%
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	12.509.677,80	0,39%	VBI		2,27%	2,27%	-5,99%	-8,39%	-8,58%	-8,20%	3,41%	-1,92%
Benchmark	IFIX					0,52%	-0,50%	0,94%	1,61%	5,24%	19,57%	19,14%
Operação com Participantes	73.381.937,87	2,28%				0,80%	2,49%	6,22%	6,70%	10,31%		
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,71%	2,23%	4,87%	5,92%	9,22%	18,71%	37,23%
Caixa / Valores a Pagar / Valores a Receber / Out	473.532,99	0,01%										
Total	3.220.307.215,64	100,00%			0,73%	0,98%	2,99%	5,13%	5,56%	10,15%		
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,71%	2,23%	4,87%	5,92%	9,22%	18,71%	37,23%

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.

EFPC: SARAHPREV

Plano: PLANO CV

Data-Base: 31/07/2024

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\$	3.224.223.321,89
Total de Recursos do XML	R\$	3.224.223.321,97
Diferença	-R\$	0,08

INFORMAÇÕES XML

Tipo do Ativo	Carteira Própria + Fundo Exclusivo	
	Quantidade	Valor
Renda Fixa		
Depósitos	-	R\$ 377.380,65
Títulos Públicos	456.485,01	R\$ 1.918.022.607,11
Títulos Privados	7.861,02	R\$ 11.524.274,84
Opções	54,65	R\$ 548.982,54
Operações Compromissadas	0,00	R\$ -
Contratos a Termo	0,00	R\$ -
Contratos de Futuro	11.376,96	R\$ 13.772,66
Contratos de Swap	0,00	R\$ -
Valores a Pagar (-) / Receber (+)	-	R\$ 4.152.817,95
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\$ 73.381.937,87
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	16.095.526,09	R\$ 23.556.572,13
BB INSTIT. FI RF	02.296.928/0001-90	15.744.481,62	R\$ 204.051.287,98
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	17.413.636/0001-68	12.412.353,42	R\$ 93.403.290,27
BB MULT SCHRODER IE FI	17.431.816/0001-72	12.833.114,65	R\$ 85.118.611,98
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS - FIP MULTIEST.	14.737.553/0001-36	2.829,00	R\$ 2.496.979,06
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	08.924.783/0001-01	60.000,00	R\$ 2.999.400,00
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	35.652.102/0001-76	132.588,00	R\$ 12.509.677,80
FII CENESP	13.551.286/0001-45	60.000,00	R\$ 90.000,00

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: 31/07/2024
CNPB: 1996003747

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1º NÍVEL)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
FIP EM HOTELARIA MULTIEST.	14.067.624/0001-30	497,93	R\$ 5.939,96

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (ATRAVÉS DOS EXCLUSIVOS)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
ABSOLUTE VERTEX 30 BB FIC FI MULT	32.892.954/0001-42	7.327.830,72	R\$ 12.766.654,77
BB TOP PRINCIPAL RF REF. DI LP FI	03.504.023/0001-21	80.136,37	R\$ 1.315.837,42
BB TOP RF CP FI	01.608.573/0001-65	63.013,80	R\$ 1.324.816,95
OLEO E GAS FIPACOES MULTIEST.	11.083.096/0001-15	7.354,05	-R\$ 192.502,56
FUNDO BRASIL DE INTERIZACAO DE EMPRESAS FIP MULTIEST.	11.760.191/0001-06	9.668,61	R\$ 3.732.902,94
FUNDO BRASIL DE INTERIZACAO DE EMPRESAS FIP MULTIEST. II	19.837.544/0001-30	4.565,57	R\$ 5.642.579,56
FS - FIPACOES MULTIEST.	16.465.811/0001-06	1,99	R\$ 159.728,79
BRAM FI RF CRED PRIV BANCOS	15.675.415/0001-32	15.265.186,21	R\$ 41.749.316,46
BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV	38.653.941/0001-05	108.750.761,20	R\$ 163.644.121,67
BRASIL CAPITAL BB 30 FIC FIA	35.704.405/0001-95	12.762.269,41	R\$ 18.876.589,85
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTIT. FIQ DE FIA	11.977.794/0001-64	1.955.452,17	R\$ 6.699.755,56
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REF. DI	09.215.250/0001-13	552.255,23	R\$ 2.400.925,14
CLARITAS ARBITRAGEM BB FIC FI MULT	27.793.086/0001-03	5.777.619,09	R\$ 8.533.893,29
DAHLIA AÇÕES FIC FIA	30.858.733/0001-22	11.064.313,84	R\$ 13.693.585,16
DAHLIA TOTAL RETURN BB FIC FI MULT	42.402.544/0001-20	4.027.603,40	R\$ 4.595.658,79
FIP MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	15.039.162/0001-00	8.870,00	R\$ 1.977.955,56
GENOA CAPITAL VESTAS B FIC FI MULT	49.240.295/0001-62	11.349.444,62	R\$ 13.319.704,81
IBIUNA HEDGE STC FIC FI MULT	38.195.760/0001-74	57.745,18	R\$ 8.061.301,53
ITAÚ DISTRIBUIDORES OPTIMUS EXTREME MULT FICFI	40.616.164/0001-62	269.082,20	R\$ 4.843.298,31
ITAÚ FIDELIDADE T - FI RF	11.419.811/0001-48	1.591.588,73	R\$ 56.571.413,83
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	20.355.007/0001-33	1.409.865,89	R\$ 32.925.078,81
ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	07.928.916/0001-55	4.510.909,95	R\$ 24.361.466,92
JGP STRATEGY FIC FI MULT - FEEDER VI	24.688.398/0001-69	71.180,68	R\$ 13.944.493,67
KAPITALO ZETA BB FIC FI MULT	30.507.672/0001-59	7.687.949,43	R\$ 13.103.023,49
KINEA ZEUS FI FINANC. DA EM COTAS MULT	42.556.631/0001-31	9.052.195,20	R\$ 12.343.096,33
LACAN FLORESTAL- FIP MULTIEST.	13.812.224/0001-40	997,62	R\$ 13.242.142,98
LEBLON AÇÕES II INSTIT. FIC FIA	26.768.800/0001-40	110.516,12	R\$ 18.694.725,52
LEGACY CAPITAL BB FIC FI MULT	35.343.900/0001-16	8.209.820,03	R\$ 12.772.420,95
NAVI INSTIT. II FIC FIA	34.659.901/0001-01	29.254.568,51	R\$ 35.436.430,36
NAVI LS BB FIC FI MULT	34.081.172/0001-59	7.221.071,93	R\$ 10.584.717,28
NEO PROPECTUS II FIC FI MULT	24.140.338/0001-07	2.640.647,82	R\$ 5.951.847,76
OCEANA VALOR 30 DBB FIC FIA	32.386.727/0001-45	23.378.128,99	R\$ 35.645.655,37
PATRIA BRASIL INFRA. III FIC FIP	17.870.798/0001-25	6.096,38	R\$ 4.100.158,00
PATRIA INFRA. FIC FIP	12.517.924/0001-49	9.508,03	R\$ 6.734.668,26
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	11.403.850/0001-57	3.191.800,37	R\$ 13.689.303,34
REAL INVESTOR INSTIT. FIC FIA	52.070.019/0001-08	27.197.296,49	R\$ 30.044.169,42
RPS TOTAL RETURN BB D30 FIC FI MULT	42.500.804/0001-08	5.396.791,04	R\$ 6.031.870,30
SHARP IBRX ATIVO BB FIA	50.676.647/0001-06	33.324.335,29	R\$ 39.014.944,08
SPACEX FIC FI MULT	29.994.389/0001-10	9.298.566,71	R\$ 14.596.612,92

SPX APACHE FIC FIA	16.565.056/0001-23	9.816.236,57	R\$	32.782.654,08
TORK LONG ONLY INSTIT. FIC FIA	31.533.145/0001-81	9.807.026,86	R\$	17.481.402,75

! 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: 31/07/2024
CNPB: 1996003747

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (ATRAVÉS DOS EXCLUSIVOS)

Nome	CNPJ	Quantidade		Valor
VERDE AM BB60 FIC FI MULT	34.808.989/0001-86	9.007.818,69	R\$	12.825.142,19
VINCI MOSAICO INSTIT. FIA	28.470.587/0001-11	2.189.294,46	R\$	16.502.490,94

! 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.