

ANÁLISE DE INVESTIMENTOS

SARHPREV PLANO CV

Data-base: 31/05/2024

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	2.397.368.572,62	76,26%				0,86%	2,46%	5,47%	4,32%	9,29%		
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,87%	2,26%	5,49%	4,51%	8,46%	18,12%	38,78%
RENDA FIXA TRADICIONAL	202.329.875,43	6,44%			0,01%	0,85%						
SARHPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	-526.430,87	-0,02%			-0,83%	0,00%	0,00%	0,69%	0,00%	3,75%		
BB INSTIT. FI RF	202.856.306,30	6,45%	BB		0,01%	0,85%	2,66%	5,66%	4,61%	12,57%	27,23%	37,87%
Benchmark	CDI					0,83%	2,58%	5,33%	4,40%	12,01%	27,10%	37,13%
MULTIMERCADO INSTITUCIONAL	314.146.740,18	9,99%			0,34%	0,71%						
FI MULT BTG PACTUAL SARHPREV BELO HORIZON	155.331.025,34	4,94%	BTG PACTUAL		0,44%	0,68%	0,12%	2,93%	1,50%			
BRADESCO FI MULT SARHPREV SALVADOR	158.815.714,84	5,05%	BRADESCO		0,27%	0,74%	2,15%	4,95%	3,59%			
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.					0,96%	2,96%	6,11%	5,04%	13,67%	30,92%	43,37%
RENDA FIXA ALM	1.518.870.991,65	48,32%			0,00%	0,87%						
BRADESCO FI RF SARHPREV BRASILIA ALM	1.518.870.991,65	48,32%	BRADESCO		0,00%	0,87%	2,60%	5,60%	4,57%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,87%	2,26%	5,49%	4,51%	8,46%	18,12%	38,78%
RENDA FIXA CRÉDITO CDI	185.884.087,15	5,91%			0,01%	0,99%						
BRADESCO FI RF CRED PRIV SARHPREV FORTALE	185.884.087,15	5,91%	BRADESCO		0,01%	0,99%	3,24%	6,75%	5,71%			
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.					0,96%	2,96%	6,11%	5,04%	13,67%	30,92%	43,37%
RENDA FIXA CRÉDITO IPCA	176.136.878,21	5,60%			0,37%	0,88%						
SARHPREV RIO DE JANEIRO RF CRED PRIV FI	176.136.878,21	5,60%	ITAU		0,02%	0,88%	2,45%	5,45%	4,35%			
Benchmark	IPCA + 7,5% a.a.					1,07%	2,85%	6,57%	5,37%	11,66%	24,72%	49,80%
Renda Variável	262.715.085,53	8,36%					-2,91%	-6,75%	-4,83%	-9,86%	9,42%	
Benchmark	IBOVESPA						-3,04%	-5,37%	-4,11%	-9,01%	12,70%	9,65%
RENDA VARIÁVEL ATIVA	262.715.085,53	8,36%			1,93%	-2,91%						
BB SARHPREV MÓDULO RV FIC FIA	262.715.085,53	8,36%	BB		5,29%	-2,91%	-6,75%	-4,82%	-9,86%	9,43%		
Benchmark	IBOVESPA + 2% a.a.					-2,88%	-4,90%	-3,17%	-8,26%	14,94%	14,06%	2,63%
Estruturado	190.014.718,17	6,04%					0,29%	-1,33%	1,31%	-0,42%	5,18%	
Benchmark	CDI + 2% a.a.						1,00%	3,09%	6,37%	5,25%	14,23%	32,20%
MULTIMERCADO ESTRUTURADO	151.880.020,58	4,83%			1,31%	0,41%						
BB SARHPREV MÓDULO MULT FIC FI MULT	151.880.020,58	4,83%	BB		1,31%	0,41%	-0,40%	2,36%	0,09%	7,32%		
Benchmark	CDI + 2% a.a.					1,00%	3,09%	6,37%	5,25%	14,23%	32,20%	45,49%
FIP	38.134.697,59	1,21%			0,00%	-0,08%						
FIP EM HOTELARIA MULTIEST.	6.780,04	0,00%	POLO CAPITAL									
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPI	6.357.238,25	0,20%	SPX									
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS - FIP MULTIE	2.492.862,12	0,08%	BRZ									
OLEO E GAS FIP MULTIEST.	73,04	0,00%	GENIAL									
FS - FIP MULTIEST.	159.957,38	0,01%	SPX									
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPI	3.723.564,32	0,12%	SPX									
FIP MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	2.052.094,86	0,07%	KINEA									
LACAN FLORESTAL- FIP MULTIEST.	13.268.814,63	0,42%	LACAN									
PATRIA INFRA. FIC FIP	5.962.155,27	0,19%	PATRIA									
PATRIA BRASIL INFRA. III FIC FIP	4.111.157,69	0,13%	PATRIA									
Benchmark	IPCA					0,46%	1,00%	2,84%	2,27%	3,93%	8,02%	20,69%
Exterior	206.878.319,02	6,58%					3,60%	6,20%	18,30%	14,63%	25,52%	
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)						5,64%	8,59%	21,01%	17,70%	26,53%	36,82%
EXTERIOR – RV (SEM HEDGE)	161.758.015,48	5,15%			1,51%	4,43%						
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	84.490.158,02	2,69%	BB		3,98%	4,31%	8,55%	23,26%	18,91%	30,43%	47,96%	28,83%
BB MULT SCHRODER IE FI	77.267.857,46	2,46%	BB		3,71%	4,57%	9,44%	21,78%	18,78%	27,96%	38,09%	18,44%
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)					5,64%	8,59%	21,01%	17,70%	26,53%	36,82%	15,98%
EXTERIOR – RV (COM HEDGE)	45.120.303,54	1,44%			3,95%	0,71%						
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI	45.120.303,54	1,44%	BB		4,67%	0,71%	-2,68%	5,21%	1,70%	13,79%	24,61%	32,13%
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)					5,64%	8,59%	21,01%	17,70%	26,53%	36,82%	15,98%
Imobiliário	16.093.768,08	0,51%					-2,52%	-4,49%	-16,95%	-16,25%	-9,24%	
Benchmark	IFIX						0,02%	0,66%	6,48%	2,14%	12,24%	19,92%
FII	16.093.768,08	0,51%			3,40%	-3,81%						
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	3.312.000,00	0,11%	BTG PACTUAL									
FII CENESP	98.400,00	0,00%	BTG PACTUAL									
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	12.683.368,08	0,40%	VBI									
Benchmark	IFIX						0,02%	0,66%	6,48%	2,14%	12,24%	19,92%
Operação com Participantes	70.602.925,83	2,25%					1,30%	3,78%	6,37%	5,46%	11,69%	
Benchmark	INPC + 5% a.a.						0,87%	2,26%	5,49%	4,51%	8,46%	18,12%
Total	3.143.673.389,25	100,00%					0,66%	0,66%	1,61%	4,93%	3,18%	10,64%
Benchmark	INPC + 5% a.a.						0,87%	2,26%	5,49%	4,51%	8,46%	18,12%

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

Data-Base: 31/05/2024

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\$	3.147.503.793,43
Total de Recursos do XML	R\$	3.147.503.793,46
Diferença	-R\$	0,03

INFORMAÇÕES XML

Tipo do Ativo	Carteira Própria + Fundo Exclusivo	
	Quantidade	Valor
Renda Fixa		
Depósitos	-	R\$ 59.866.746,95
Títulos Públicos	369.698,76	R\$ 1.787.529.480,22
Títulos Privados	9.691,74	R\$ 14.245.433,94
Opções	4,97	R\$ 115.601,92
Operações Compromissadas	0,00	R\$ -
Contratos a Termo	0,00	R\$ -
Contratos de Futuro	12.131,27	R\$ 389,44
Contratos de Swap	0,00	R\$ -
Valores a Pagar (-) / Receber (+)	-	R\$ 3.895.604,67
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\$ 70.602.925,83
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\$ 45.120.303,54
BB INSTIT. FI RF	02.296.928/0001-90	15.937.565,75	R\$ 202.856.306,30
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	17.413.636/0001-68	12.412.353,42	R\$ 84.490.158,02
BB MULT SCHRODER IE FI	17.431.816/0001-72	12.833.114,65	R\$ 77.267.857,46
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS - FIP MULTIEST.	14.737.553/0001-36	2.829,00	R\$ 2.492.862,12
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	08.924.783/0001-01	60.001,00	R\$ 3.312.055,20
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	35.652.102/0001-76	132.588,00	R\$ 12.683.368,08
FII CENESP	13.551.286/0001-45	60.000,00	R\$ 98.400,00

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

Data-base: 31/05/2024
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\$ 6.780,04
FIP MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	15.039.162/0001-00	8.870,00	R\$ 2.052.094,86
FS - FIP MULTIEST.	16.465.811/0001-06	1,99	R\$ 159.957,38
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP MULTIEST.	11.760.191/0001-06	9.668,61	R\$ 3.723.564,32
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP MULTIEST.	19.837.544/0001-30	4.565,57	R\$ 6.357.238,25
LACAN FLORESTAL- FIP MULTIEST.	13.812.224/0001-40	997,62	R\$ 13.268.814,63
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\$ 4.111.157,69
PATRIA INFRA. FIC FIP	12.517.924/0001-49	9.508,03	R\$ 5.962.155,27

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\$ 12.277.681,82
BB TOP PRINCIPAL RF REF. DI LP FI	03.504.023/0001-21	81.472,79	R\$ 1.315.195,99
BB TOP RF CP FI	01.608.573/0001-65	63.896,93	R\$ 1.321.213,25
BRAM FI RF CRED PRIV BANCOS	15.675.415/0001-32	9.724.656,47	R\$ 26.098.138,37
BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV	38.653.941/0001-05	108.465.632,82	R\$ 159.783.413,66
BRASIL CAPITAL BB 30 FIC FIA	35.704.405/0001-95	11.944.799,30	R\$ 16.812.356,73
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTIT. FIQ DE FIA	11.977.794/0001-64	1.955.452,10	R\$ 6.420.853,89
CLARITAS ARBITRAGEM BB FIC FI MULT	27.793.086/0001-03	5.777.619,09	R\$ 8.380.941,86
DAHLIA AÇÕES FIC FIA	30.858.733/0001-22	10.979.622,67	R\$ 12.738.381,45
DAHLIA TOTAL RETURN BB FIC FI MULT	42.402.544/0001-20	4.027.603,40	R\$ 4.373.756,82
GENOA CAPITAL VESTAS B FIC FI MULT	49.240.295/0001-62	11.349.444,63	R\$ 13.198.813,93
IBIUNA HEDGE STC FIC FI MULT	38.195.760/0001-74	57.745,18	R\$ 8.042.256,64
ITAU DISTRIBUIDORES OPTIMUS EXTREME MULT FICFI	40.616.164/0001-62	269.082,20	R\$ 4.772.038,61
ITAU FIDELIDADE T - FI RF	11.419.811/0001-48	1.774.405,15	R\$ 61.994.211,47
ITAU VERSO P CRED PRIV RF FI	20.355.007/0001-33	2.310.604,60	R\$ 52.945.672,05
ITAU-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	07.928.916/0001-55	4.971.686,93	R\$ 26.432.888,34
JGP STRATEGY FIC FI MULT - FEEDER VI	24.688.398/0001-69	71.180,68	R\$ 13.363.000,21
KAPITALO ZETA BB FIC FI MULT	30.507.672/0001-59	7.992.959,02	R\$ 13.213.578,59
KINEA ZEUS FI FINANC. DA EM COTAS MULT	42.556.631/0001-31	8.553.388,31	R\$ 11.195.041,56
LEBLON AÇÕES II INSTIT. FIC FIA	26.768.800/0001-40	104.951,23	R\$ 17.502.915,48
LEGACY CAPITAL BB FIC FI MULT	35.343.900/0001-16	7.980.002,99	R\$ 12.238.716,73
MILES BB VIRTUS LONG ONLY FIC FIA	39.611.548/0001-03	10.923.880,82	R\$ 10.012.229,44
NAVI INSTIT. II FIC FIA	34.659.901/0001-01	29.254.568,44	R\$ 33.742.816,04
NAVI LS BB FIC FI MULT	34.081.172/0001-59	7.221.071,93	R\$ 10.352.412,51
NEO PROPECTUS II FIC FI MULT	24.140.338/0001-07	2.640.647,82	R\$ 6.085.930,35
OCEANA VALOR 30 DBB FIC FIA	32.386.727/0001-45	23.378.128,94	R\$ 34.187.795,17
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	11.403.850/0001-57	3.191.800,36	R\$ 13.086.380,72
REAL INVESTOR INSTIT. FIC FIA	52.070.019/0001-08	24.495.127,96	R\$ 26.433.048,75
RPS TOTAL RETURN BB D30 FIC FI MULT	42.500.804/0001-08	5.396.791,04	R\$ 5.891.786,87
SHARP IBRX ATIVO BB FIA	50.676.647/0001-06	33.324.335,22	R\$ 37.712.923,56
SPACEX FIC FI MULT	29.994.389/0001-10	9.298.566,71	R\$ 14.024.725,04

SPX APACHE FIC FIA	16.565.056/0001-23	8.970.859,29	R\$	28.749.645,69
TORK LONG ONLY INSTIT. FIC FIA	31.533.145/0001-81	9.173.317,50	R\$	15.547.032,25

! 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

Data-base: 31/05/2024
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	9.372.380,75	R\$	12.952.117,53
VINCI MOSAICO INSTIT. FIA	28.470.587/0001-11	2.034.952,25	R\$	14.722.048,03

! 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.