

ANÁLISE DE INVESTIMENTOS

SARAHPREV PLANO CV

Data-base: 28/03/2024

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	2.365.584.961,71	75,86%			0,95%	2,79%	5,62%	2,79%	10,20%		
Benchmark	INPC + 5% a.a.				0,58%	2,78%	4,81%	2,78%	8,46%	18,85%	39,43%
RENDA FIXA TRADICIONAL	218.868.456,35	7,00%		0,01%	0,94%						
SARAHPREV PLANO CV CARTEIRA PROPRIA RF	-517.545,19	-0,02%		-1,53%	0,00%	0,00%	2,47%	0,00%	6,15%		
BB INSTIT. FI RF	219.386.001,54	7,02%	BB	0,01%	0,94%	2,86%	5,96%	2,86%	12,95%	27,46%	36,30%
Benchmark	CDI				0,83%	2,62%	5,54%	2,62%	12,36%	27,28%	35,44%
MULTIMERCADO INSTITUCIONAL	304.647.228,24	9,74%		0,27%	0,73%						
FI MULT BTG PACTUAL SARAHPREV BELO HORIZON	152.064.344,08	4,86%	BTG PACTUAL	0,42%	0,69%	2,07%	5,53%	2,07%			
BRADESCO FI MULT SARAHPREV SALVADOR	152.582.884,16	4,88%	BRADESCO	0,16%	0,78%	2,20%	5,91%	2,20%			
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.				0,95%	3,00%	6,30%	3,00%	14,01%	31,09%	41,59%
RENDA FIXA ALM	1.494.981.975,94	47,82%		0,00%	0,99%						
BRADESCO FI RF SARAHPREV BRASILIA ALM	1.494.981.975,94	47,82%	BRADESCO	0,00%	0,99%	2,93%	5,48%	2,93%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.				0,58%	2,78%	4,81%	2,78%	8,46%	18,85%	39,43%
RENDA FIXA CRÉDITO CDI	173.694.950,99	5,56%		0,00%	1,13%						
BRADESCO FI RF CRED PRIV SARAHPREV FORTALE	173.694.950,99	5,56%	BRADESCO	0,00%	1,13%	3,55%	6,93%	3,55%			
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.				0,95%	3,00%	6,30%	3,00%	14,01%	31,09%	41,59%
RENDA FIXA CRÉDITO IPCA	173.392.350,19	5,55%		0,41%	0,85%						
SARAHPREV RIO DE JANEIRO RF CRED PRIV FI	173.392.350,19	5,55%	ITAU	0,11%	0,85%	2,72%	5,80%	2,72%			
Benchmark	IPCA + 7,5% a.a.				0,74%	3,21%	6,17%	3,21%	11,56%	25,50%	50,16%
Renda Variável	282.848.184,18	9,05%		0,40%	-2,96%	10,18%	-2,96%	28,63%			
Benchmark	IBOVESPA				-0,71%	-4,53%	9,90%	-4,53%	25,74%	6,76%	9,84%
RENDA VARIÁVEL ATIVA	282.848.184,18	9,05%		1,58%	0,40%						
BB SARAHPREV MÓDULO RV FIC FIA	282.848.184,18	9,05%	BB	5,30%	0,40%	-2,95%	10,19%	-2,95%	28,64%		
Benchmark	IBOVESPA + 2% a.a.				-0,55%	-4,07%	10,96%	-4,07%	28,20%	11,03%	16,51%
Estruturado	192.610.521,43	6,16%		0,02%	0,94%	4,27%	0,94%	7,82%			
Benchmark	CDI + 2% a.a.				0,99%	3,12%	6,55%	3,12%	14,56%	32,37%	43,68%
MULTIMERCADO ESTRUTURADO	154.573.457,88	4,94%		0,86%	1,37%						
BB SARAHPREV MÓDULO MULT FIC FI MULT	154.573.457,88	4,94%	BB	0,86%	1,37%	1,86%	6,05%	1,86%	10,48%		
Benchmark	CDI + 2% a.a.				0,99%	3,12%	6,55%	3,12%	14,56%	32,37%	43,68%
FIP	38.037.063,55	1,22%		0,00%	-0,08%						
FIPPAÇÕES EM HOTELARIA MULTIEST.	18,01	0,00%	POLO CAPITAL								
FUNDO BRASIL DE INTERIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP	6.150.994,70	0,20%	SPX								
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOG.S - FIPPAÇÕES MUL'	2.494.908,15	0,08%	BRZ								
OLEO E GAS FIPPAcoes MULTIEST.	73,04	0,00%	GENIAL								
FS - FIPPAÇÕES MULTIEST.	160.190,70	0,01%	SPX								
FUNDO BRASIL DE INTERIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP	3.606.019,39	0,12%	SPX								
FIPPAÇÕES MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	2.034.417,71	0,07%	KINEA								
LACAN FLORESTAL- FIPPAÇÕES MULTIEST.	13.291.112,22	0,43%	LACAN								
PATRIA INFRA. FIC FIPPAÇÕES	6.066.171,74	0,19%	PATRIA								
PATRIA BRASIL INFRA. III FIC FIPPAÇÕES	4.233.157,88	0,14%	PATRIA								
Benchmark	IPCA				0,16%	1,42%	2,51%	1,42%	3,93%	8,76%	21,05%
Exterior	200.774.816,43	6,42%		3,07%	11,25%	19,54%	11,25%	23,54%			
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)				3,25%	11,91%	20,18%	11,91%	21,08%	18,71%	7,19%
EXTERIOR – RV (SEM HEDGE)	154.297.776,53	4,94%		0,67%	3,95%						
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	80.683.843,81	2,58%	BB	1,95%	3,66%	13,55%	22,89%	13,55%	25,66%	28,77%	21,74%
BB MULT SCHRODER IE FI	73.613.932,72	2,35%	BB	1,22%	4,27%	13,16%	19,92%	13,16%	24,88%	22,27%	12,68%
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)				3,25%	11,91%	20,18%	11,91%	21,08%	18,71%	7,19%
EXTERIOR – RV (COM HEDGE)	46.477.039,89	1,49%		2,29%	0,24%						
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE PRIVATE FI	46.477.039,89	1,49%	BB	3,29%	0,24%	4,76%	13,58%	4,76%	18,08%	24,66%	41,84%
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)				3,25%	11,91%	20,18%	11,91%	21,08%	18,71%	7,19%
Imobiliário	16.929.911,40	0,54%		-1,13%	-13,30%	-13,29%	-13,30%	2,62%			
Benchmark	IFIX				1,43%	2,92%	5,87%	2,92%	23,44%	22,60%	19,72%
FII	16.929.911,40	0,54%		2,27%	-1,76%						
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	3.465.600,00	0,11%	BTG PACTUAL								
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	13.464.311,40	0,43%	VBI								
Benchmark	IFIX				1,43%	2,92%	5,87%	2,92%	23,44%	22,60%	19,72%
Operação com Participantes	67.794.559,81	2,17%		0,97%	2,60%	4,84%	2,60%	11,60%			
Benchmark	INPC + 5% a.a.				0,58%	2,78%	4,81%	2,78%	8,46%	18,85%	39,43%
Total	3.126.542.954,96	100,00%		0,60%	0,97%	2,53%	6,69%	2,53%	12,94%		
Benchmark	INPC + 5% a.a.				0,58%	2,78%	4,81%	2,78%	8,46%	18,85%	39,43%

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: 28/03/2024

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\$	3.128.065.763,62
Total de Recursos do XML	R\$	3.128.065.763,65
Diferença	-R\$	0,03

INFORMAÇÕES XML

Tipo do Ativo	Carteira Própria + Fundo Exclusivo	
	Quantidade	Valor
Renda Fixa		
Depósitos	-	R\$ 461.331,66
Títulos Públicos	581.104,63	R\$ 1.816.461.467,70
Títulos Privados	26.591,48	R\$ 38.941.412,13
Opções	54,63	R\$ 216.423,12
Operações Compromissadas	0,00	R\$ -
Contratos a Termo	0,00	R\$ -
Contratos de Futuro	26.677,71	-R\$ 47.518,88
Contratos de Swap	0,00	-R\$ 517.545,19
Valores a Pagar (-) / Receber (+)	-	R\$ 1.740.819,37
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\$ 67.794.559,81
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\$ 46.477.039,89
BB INSTIT. FI RF	02.296.928/0001-90	17.530.432,98	R\$ 219.386.001,54
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	17.413.636/0001-68	12.412.353,42	R\$ 80.683.843,81
BB MULT SCHRODER IE FI	17.431.816/0001-72	12.833.114,65	R\$ 73.613.932,72
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS - FIP MULTIEST.	14.737.553/0001-36	2.829,00	R\$ 2.494.908,15
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	08.924.783/0001-01	60.000,00	R\$ 3.465.600,00
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	35.652.102/0001-76	132.588,00	R\$ 13.464.311,40
FIP EM HOTELARIA MULTIEST.	14.067.624/0001-30	494,95	R\$ 18,01

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: 28/03/2024
CNPB: 1996003747

ALOCÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1º NÍVEL)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
FIP MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	15.039.162/0001-00	8.870,00	R\$ 2.034.417,71
FS - FIP MULTIEST.	16.465.811/0001-06	1,99	R\$ 160.190,70
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP MULTIEST.	11.760.191/0001-06	9.668,61	R\$ 3.606.019,39
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP MULTIEST.	19.837.544/0001-30	4.565,57	R\$ 6.150.994,70
LACAN FLORESTAL- FIP MULTIEST.	13.812.224/0001-40	997,62	R\$ 13.291.112,22
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\$ 4.233.157,88
PATRIA INFRA. FIC FIP	12.517.924/0001-49	9.508,03	R\$ 6.066.171,74

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\$ 12.405.749,54
APEX AÇÕES 30 FIC FIA	15.862.830/0001-03	4.557.161,51	R\$ 11.170.518,30
BB TOP PRINCIPAL RF REF. DI LP FI	03.504.023/0001-21	275.738,33	R\$ 4.375.512,58
BB TOP RF CP FI	01.608.573/0001-65	64.458,48	R\$ 1.310.528,86
BRAM FI RF CRED PRIV BANCOS	15.675.415/0001-32	6.416.506,42	R\$ 16.893.652,74
BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV	38.653.941/0001-05	108.725.653,05	R\$ 156.875.025,95
BRASIL CAPITAL BB 30 FIC FIA	35.704.405/0001-95	11.739.485,10	R\$ 17.820.157,90
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTIT. FIQ DE FIA	11.977.794/0001-64	1.955.111,92	R\$ 7.206.549,76
CLARITAS ARBITRAGEM BB FIC FI MULT	27.793.086/0001-03	5.777.619,11	R\$ 8.464.720,42
DAHLIA AÇÕES FIC FIA	30.858.733/0001-22	10.047.052,09	R\$ 12.930.470,23
DAHLIA TOTAL RETURN BB FIC FI MULT	42.402.544/0001-20	4.027.603,41	R\$ 4.584.297,34
GENOA CAPITAL RADAR BB FIC FI MULT	36.986.717/0001-00	8.526.633,65	R\$ 13.219.509,49
IBIUNA HEDGE STC FIC FI MULT	38.195.760/0001-74	57.745,18	R\$ 8.241.936,18
ITAU DISTRIBUIDORES OPTIMUS EXTREME MULT FICFI	40.616.164/0001-62	269.082,20	R\$ 4.815.183,53
ITAÚ FIDELIDADE T - FI RF	11.419.811/0001-48	1.402.316,98	R\$ 48.157.660,23
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI	20.355.007/0001-33	1.847.548,84	R\$ 41.523.340,58
ITAÚ-UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI	07.928.916/0001-55	3.915.069,26	R\$ 20.618.888,42
JGP STRATEGY FIC FI MULT - FEEDER VI	24.688.398/0001-69	71.180,68	R\$ 13.156.866,92
KAPITALO ZETA BB FIC FI MULT	30.507.672/0001-59	7.992.959,04	R\$ 13.931.168,11
KINEA ZEUS FI FINANC. DA EM COTAS MULT	42.556.631/0001-31	8.001.672,93	R\$ 10.882.840,90
LEBLON AÇÕES II INSTIT. FIC FIA	26.768.800/0001-40	104.951,23	R\$ 19.361.554,79
LEGACY CAPITAL BB FIC FI MULT	35.343.900/0001-16	6.378.608,63	R\$ 9.974.484,82
MILES BB VIRTUS LONG ONLY FIC FIA	39.611.548/0001-03	10.923.880,80	R\$ 11.166.677,48
NAVI INSTIT. II FIC FIA	34.659.901/0001-01	29.254.568,38	R\$ 36.132.659,68
NAVI LS BB FIC FI MULT	34.081.172/0001-59	7.221.071,95	R\$ 10.463.447,35
NEO PROVECTUS II FIC FI MULT	24.140.338/0001-07	2.640.647,83	R\$ 6.359.599,19
OCEANA VALOR 30 DBB FIC FIA	32.386.727/0001-45	23.378.128,89	R\$ 36.541.117,73
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	11.403.850/0001-57	3.024.314,13	R\$ 13.211.678,07
REAL INVESTOR INSTIT. FIC FIA	52.070.019/0001-08	21.719.036,27	R\$ 25.021.587,32
RPS TOTAL RETURN BB D30 FIC FI MULT	42.500.804/0001-08	5.396.791,06	R\$ 6.139.535,22
SHARP IBRX ATIVO BB FIA	50.676.647/0001-06	33.324.335,14	R\$ 39.629.712,57
SPACEX FIC FI MULT	29.994.389/0001-10	9.298.566,74	R\$ 14.222.231,28

SPX APACHE FIC FIA	16.565.056/0001-23	7.469.604,13	R\$	25.905.579,83
TORK LONG ONLY INSTIT. FIC FIA	31.533.145/0001-81	8.829.575,90	R\$	16.912.741,13

! 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: 28/03/2024
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	9.372.380,78	R\$	13.146.343,29
VINCI MOSAICO INSTIT. FIA	28.470.587/0001-11	2.034.952,24	R\$	15.711.665,82

! 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.