

SARAHPREV PLANO CV

Data-base: 30/09/2024

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	2.537.738.580,62	77,73%				0,72%	2,38%	4,72%	7,65%	10,61%	22,18%	
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,89%	1,89%	4,26%	7,16%	9,25%	19,84%	34,88%
RENDA FIXA TRADICIONAL	213.115.829,47	6,53%			0,01%							
BB INSTIT. FI RF	213.115.829,47	6,53%	BB		0,01%	0,83%	2,78%	5,39%	8,40%	11,66%	26,17%	40,45%
Benchmark	CDI					0,83%	2,63%	5,23%	7,99%	11,06%	25,98%	39,71%
MULTIMERCADO INSTITUCIONAL	409.784.422,59	12,55%			0,33%							
FI MULT BTG PACTUAL SARAHPREV BELO HORIZON	166.111.687,75	5,09%	BTG PACTUAL		0,13%	1,11%	3,32%	3,09%	5,23%	8,79%		
BRADERCO FI MULT SARAHPREV SALVADOR	243.672.734,84	7,46%	BRADERCO		0,47%	0,48%	2,27%	4,22%	6,52%	10,39%		
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.					0,96%	3,03%	6,03%	9,21%	12,71%	29,76%	46,06%
RENDA FIXA ALM	1.554.531.730,72	47,61%			0,00%							
BRADERCO FI RF SARAHPREV BRASÍLIA ALM	1.554.531.730,72	47,61%	BRADERCO		0,00%	0,66%	2,13%	4,62%	7,68%	10,36%		
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,89%	1,89%	4,26%	7,16%	9,25%	19,84%	34,88%
RENDA FIXA CRÉDITO CDI	215.037.863,45	6,59%			0,01%							
BRADERCO FI RF CRED PRIV SARAHPREV FORTALE	215.037.863,45	6,59%	BRADERCO		0,01%	0,96%	3,18%	6,31%	10,08%	13,67%		
Benchmark	CDI + 1,5% a.a.					0,96%	3,03%	6,03%	9,21%	12,71%	29,76%	46,06%
RENDA FIXA CRÉDITO IPCA	145.268.734,39	4,45%			0,42%							
SARAHPREV RIO DE JANEIRO RF CRED PRIV FI	145.268.734,39	4,45%	ITAU		0,12%	0,80%	2,65%	5,15%	8,01%	11,25%		
Benchmark	IPCA + 7,5% a.a.					1,05%	2,73%	5,71%	9,09%	12,19%	26,79%	46,07%
Renda Variável	275.938.473,31	8,45%				-3,79%	4,12%	-2,44%	-5,33%	7,49%	10,41%	
Benchmark	IBOVESPA					-3,08%	6,38%	2,90%	-1,77%	13,08%	19,79%	18,78%
RENDA VARIÁVEL ATIVA	275.938.473,31	8,45%			1,51%							
BB SARAHPREV MÓDULO RV FIC FIA	275.938.473,31	8,45%	BB		6,26%	-3,79%	4,12%	-2,44%	-5,32%	7,50%		
Benchmark	IBOVESPA + 2% a.a.					-2,92%	6,94%	3,94%	-0,29%	15,33%	24,59%	26,01%
Estruturado	157.001.007,22	4,81%				0,91%	2,58%	2,68%	3,65%	7,07%	12,27%	
Benchmark	CDI + 2% a.a.					1,00%	3,17%	6,30%	9,61%	13,26%	31,03%	48,22%
MULTIMERCADO ESTRUTURADO	119.240.702,76	3,65%			0,71%							
BB SARAHPREV MÓDULO MULT FIC FI MULT	119.240.702,76	3,65%	BB		0,71%	1,60%	4,48%	3,54%	5,47%	9,80%		
Benchmark	CDI + 2% a.a.					1,00%	3,17%	6,30%	9,61%	13,26%	31,03%	48,22%
FIP	37.760.304,46	1,16%			0,00%							
SARAHPREV MACAPÁ II FIC FI MULT	37.760.304,46	1,16%	VINCI		0,00%	-1,18%						
Benchmark	IPCA					0,44%	0,80%	1,86%	3,31%	4,42%	9,84%	17,71%
Exterior	204.171.935,26	6,25%				-1,83%	1,34%	13,46%	26,22%	35,62%	57,46%	
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)					-2,05%	3,90%	18,13%	32,20%	41,96%	57,72%	24,03%
EXTERIOR – RV (SEM HEDGE)	179.469.698,87	5,50%			2,02%							
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	94.319.324,81	2,89%	BB		4,29%	-1,94%	0,97%	16,90%	32,74%	43,66%	66,83%	36,96%
BB MULT SCHRODER IE FI	85.150.374,06	2,61%	BB		4,72%	-2,72%	-0,21%	15,67%	30,90%	38,71%	57,28%	22,77%
Benchmark	MSCI WORLD (BRL)					-2,05%	3,90%	18,13%	32,20%	41,96%	57,72%	24,03%
EXTERIOR – RV (COM HEDGE)	24.702.236,38	0,76%			3,70%							
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE FIF	24.702.236,38	0,76%	BB		2,24%	1,79%	7,65%	6,61%	11,69%	21,09%	45,78%	39,04%
Benchmark	MSCI WORLD (USD)					1,69%	6,02%	8,33%	17,48%	30,48%	56,52%	23,83%
Imobiliário	14.114.613,12	0,43%				-8,39%	-6,16%	-12,70%	-24,32%	-24,30%	-15,73%	
Benchmark	IFIX					-2,58%	-1,24%	-3,00%	-0,16%	2,69%	10,54%	21,74%
FII	14.114.613,12	0,43%			5,42%							
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	2.864.400,00	0,09%	BTG PACTUAL			-4,90%	-6,43%	-17,35%	-19,49%	-19,62%	-31,59%	-35,30%
FII CENESP	81.000,00	0,00%	BTG PACTUAL			-10,00%	-12,90%	-53,77%	-94,04%	-94,09%	-95,92%	-96,41%
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	11.169.213,12	0,34%	VBI			-10,09%	-8,69%	-17,05%	-18,38%	-21,34%	-14,91%	-1,83%
Benchmark	IFIX					-2,58%	-1,24%	-3,00%	-0,16%	2,69%	10,54%	21,74%
Operação com Participantes	75.955.983,84	2,33%				0,74%	2,64%	5,90%	8,65%	11,02%	26,72%	
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,89%	1,89%	4,26%	7,16%	9,25%	19,84%	34,88%
Caixa / Valores a Pagar / Valores a Receber / Out	-96.939,27	0,00%										
Total	3.264.823.654,10	100,00%				0,61%	0,13%	2,42%	4,44%	7,08%	11,42%	22,64%
Benchmark	INPC + 5% a.a.					0,89%	1,89%	4,26%	7,16%	9,25%	19,84%	34,88%

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.