ANÁLISE DE INVESTIMENTOS

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%		
BRADESCO FI MULT SARAHPREV SALVADOR	243.672.734,84	7,46%	BRADESCO		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%**							
BRADESCO FI RF SARAHPREV BRASÍLIA ALM	1.554.531.730,72	47,61%	BRADESCO		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%**							
BRADESCO FI RF CRED PRIV SARAHPREV FORTALE	215.037.863,45	6,59%	BRADESCO		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 / Ou	**-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.

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 informação aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

RELATÓRIO DE DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS

EFPC: SARAHPREV
Plano: PLANO CV

Data-Base: 30/09/2024
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$	3.271.240.333,30
Total de Recursos do XML	R$	3.271.240.333,30
Diferença	-R$	0,00

INFORMAÇÕES XML

Tipo do Ativo	Carteira Própria + Fundo Exclusivo		
	Quantidade		Valor
Renda Fixa			
Depósitos	-	R$	181.275.115,07
Títulos Públicos	386.789,61	R$	1.813.584.858,89
Títulos Privados	9.000,85	R$	12.630.114,85
Opções	207,71	R$	43.383,43
Operações Compromissadas	0,00	R$	-
Contratos a Termo	0,00	R$	-
Contratos de Futuro	4.986,16	R$	21.585,19
Contratos de Swap	0,00	R$	-
Valores a Pagar (-) / Receber (+)	-	R$	1.962.582,11
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$	75.961.710,32
Exterior			
Ações	0,00	R$	-

ALOCAÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (1° NÍVEL)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor	
BB AÇÕES BRL UNIVERSAL BRANDS IE FIF	38.110.528/0001-96	16.095.526,09	R$	24.702.236,38
BB INSTIT. FI RF	02.296.928/0001-90	16.159.068,59	R$	213.115.829,47
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY IE FI	17.413.636/0001-68	12.412.353,42	R$	94.319.324,81
BB MULT SCHRODER IE FI	17.431.816/0001-72	12.833.114,65	R$	85.150.374,06
FI IMOB. - FII BTG PACTUAL CORP OFFICE FUND	08.924.783/0001-01	60.000,00	R$	2.864.400,00
FI IMOB. - VBI PRIME PROPERTIES	35.652.102/0001-76	132.588,00	R$	11.169.213,12
FII CENESP	13.551.286/0001-45	60.000,00	R$	81.000,00

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 informação aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

RELATÓRIO DE DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS

EFPC: SARAHPREV
Plano: PLANO CV

Data-base: 30/09/2024
CNPB: 1996003747

ALOCAÇÃO EM FUNDOS DE INVESTIMENTOS (ATRAVÉS DOS EXCLUSIVOS)

Nome	CNPJ	Quantidade	Valor
ABSOLUTE VERTEX 30 BB FIC FI MULT	32.892.954/0001-42	5.395.866,05	R$ 9.563.022,99
BB TOP PRINCIPAL RF REF. DI LP FI	03.504.023/0001-21	70.637,53	R$ 1.179.913,10
BB TOP RF CP FI	01.608.573/0001-65	66.072,56	R$ 1.412.534,83
BR0000000000	11.083.096/0001-15	6.903,03	-R$ 187.617,44
BR0000000000	19.837.544/0001-30	4.285,56	R$ 5.015.474,49
BR0000000000	16.465.811/0001-06	1,87	R$ 147.226,24
BRAM FI RF CRED PRIV BANCOS	15.675.415/0001-32	17.191.808,70	R$ 47.892.870,19
BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV	38.653.941/0001-05	108.808.672,77	R$ 167.240.486,01
BRASIL CAPITAL BB 30 FIC FI FINANC. EM AÇÕES	35.704.405/0001-95	11.145.410,52	R$ 16.393.414,86
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS - FIP MULTIEST.	14.737.553/0001-36	2.655,50	R$ 2.342.133,07
BTG PACTUAL TESOURO SELIC FI RF REF. DI	09.215.250/0001-13	510.629,03	R$ 2.257.646,28
CLARITAS ARBITRAGEM BB FIC FI MULT	27.793.086/0001-03	4.314.479,61	R$ 6.507.373,72
DAHLIA AÇÕES FIC FIA	30.858.733/0001-22	8.965.599,57	R$ 11.260.925,84
DAHLIA TOTAL RETURN BB FIC FIF MULT	42.402.544/0001-20	2.621.637,59	R$ 3.011.187,61
FIP EM HOTELARIA MULTIEST.	14.067.624/0001-30	469,64	R$ 20.701,50
FIP MULTIEST. KINEA PRIVATE EQUITY II	15.039.162/0001-00	8.326,00	R$ 1.881.104,43
FUNDO BRASIL DE INTERNACIONALIZAÇÃO DE EMPRESAS FIP MULTIEST.	11.760.191/0001-06	9.075,63	R$ 3.674.791,24
GENOA CAPITAL VESTAS B FIC FI MULT	49.240.295/0001-62	8.428.556,69	R$ 10.223.714,52
IBIUNA HEDGE STC FIC FI MULT	38.195.760/0001-74	46.324,83	R$ 6.546.082,27
ITAU DISTRIBUIDORES OPTIMUS EXTREME MULT FICFI	40.616.164/0001-62	193.943,26	R$ 3.655.394,46
ITAÚ FIDELIDADE T FI FINANC. RF	11.419.811/0001-48	1.405.236,55	R$ 50.839.219,68
ITAÚ UNIBANCO FIDELIDADE W3 RF FI FINANC.	07.928.916/0001-55	3.985.406,24	R$ 21.862.934,31
ITAÚ VERSO P CRED PRIV RF FI FINANC.	20.355.007/0001-33	1.413.163,91	R$ 33.622.907,15
JGP STRATEGY FIC FI MULT - FEEDER VI	24.688.398/0001-69	53.675,65	R$ 10.815.584,35
KAPITALO ZETA BB FIC FI MULT	30.507.672/0001-59	5.446.163,65	R$ 10.000.683,56
KINEA ZEUS FI FINANC. DA EM COTAS MULT	42.556.631/0001-31	6.892.843,62	R$ 9.642.677,41
LACAN FLORESTAL- FIP MULTIEST.	13.812.224/0001-40	936,44	R$ 12.408.455,60
LEBLON AÇÕES II INSTIT. FIC FIA	26.768.800/0001-40	97.636,43	R$ 16.808.100,85
LEGACY CAPITAL BB FIC FI MULT	35.343.900/0001-16	6.272.717,70	R$ 10.017.548,36
NAVI INSTIT. II FIC FIA	34.659.901/0001-01	27.439.157,35	R$ 33.414.862,52
NAVI LS BB FIC FI MULT	34.081.172/0001-59	5.312.166,45	R$ 7.767.636,23
NEO PROVECTUS II FIC FI MULT	24.140.338/0001-07	1.995.809,29	R$ 4.459.896,91
OCEANA VALOR 30 DBB FIC FIA	32.386.727/0001-45	21.643.324,26	R$ 33.640.668,44
PATRIA BRASIL INFRA. III FIC FIP	17.870.798/0001-25	5.722,49	R$ 3.968.993,19
PATRIA INFRA. FIC FIP	12.517.924/0001-49	8.924,91	R$ 6.239.957,84
PRINCIPAL CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	11.403.850/0001-57	2.576.675,21	R$ 11.080.215,92
REAL INVESTOR INSTIT. FIC FIA	52.070.019/0001-08	24.686.922,43	R$ 28.048.303,17
RPS TOTAL RETURN BB D30 FIC FI MULT	42.500.804/0001-08	3.872.124,74	R$ 4.543.558,14
SHARP IBRX ATIVO BB FIA	50.676.647/0001-06	28.580.259,56	R$ 33.655.213,38
SPACEX FIC FI MULT	29.994.389/0001-10	7.192.115,82	R$ 11.673.659,84
SPX APACHE FIC FIA	16.565.056/0001-23	9.012.706,74	R$ 30.325.112,94
SQUADRA INST FIA	47.512.666/0001-92	248.481,32	R$ 30.416.545,03
TORK LONG ONLY INSTIT. FIC FIA	31.533.145/0001-81	8.551.460,75	R$ 15.348.322,52
VERDE AM BB60 FIC FI MULT	34.808.989/0001-86	6.594.066,77	R$ 9.607.954,23
VINCI MOSAICO INSTIT. FIA	28.470.587/0001-11	1.843.007,89	R$ 14.111.213,82

! 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 informação aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.