

## OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/05/2022

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.

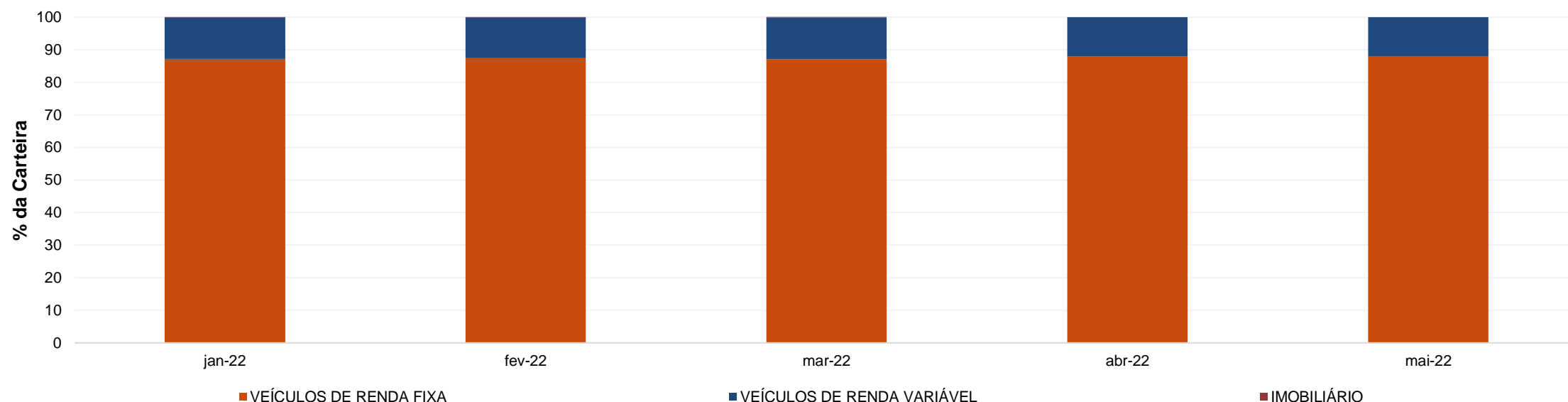
VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
<b>Renda Fixa</b>	<b>120.835.879,05</b>	<b>88,05%</b>			<b>1,19%</b>	<b>3,92%</b>	<b>6,41%</b>	<b>5,70%</b>	<b>8,56%</b>	<b>14,17%</b>	<b>18,26%</b>
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%
<b>Multimercados Institucionais</b>	<b>101.336.759,56</b>	<b>73,84%</b>		<b>0,52%</b>							
MAG OABPREV GO FI MULT	48.612.930,46	35,42%	MONGERAL AEGON	100%	1,44%	3,95%	7,19%	6,03%	10,92%	17,24%	20,58%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	52.723.829,10	38,42%	VINCI	100%	1,03%	3,99%	6,18%	5,82%	7,28%	13,68%	21,11%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,21%	3,32%	6,19%	5,19%	10,05%	14,69%	22,69%
<b>Renda Fixa</b>	<b>19.499.119,49</b>	<b>14,21%</b>		<b>0,63%</b>							
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	12.455.280,82	9,08%	ITAU	0,05%	1,04%	2,74%	5,14%	4,36%	7,97%	9,97%	15,15%
ITAU RF IMA-B ATIVO FC	6.604.988,73	4,81%	ITAU	1,53%	0,92%	5,22%	4,95%	4,86%	4,70%	13,70%	24,04%
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	371.440,07	0,27%	NOVERO	1,44%	-0,19%	-0,42%	-0,79%	-0,67%	1,57%	0,80%	0,48%
DELTA CRED PRIV FC FIRF	67.409,87	0,05%	NOVERO	5,36%	0,61%	6,34%	9,34%	8,19%	-51,12%	-58,48%	-94,71%
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%
<b>Renda Variável</b>	<b>16.400.551,21</b>	<b>11,95%</b>			<b>1,67%</b>	<b>-0,14%</b>	<b>4,53%</b>	<b>3,27%</b>	<b>-17,57%</b>	<b>14,21%</b>	<b>10,10%</b>
Benchmark:	IBOVESPA				3,22%	-1,58%	9,26%	6,23%	-11,78%	27,40%	14,76%
<b>Renda Variável</b>	<b>16.400.551,21</b>	<b>11,95%</b>		<b>2,92%</b>							
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	4.289.774,51	3,13%	BC GESTAO	1,07%	1,02%	-2,31%	0,85%	-1,67%	-22,53%	10,61%	4,42%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	5.394.123,34	3,93%	CONSTANCIA	0,43%	4,81%	2,66%	6,29%	9,33%	-7,88%	27,17%	29,84%
PACIFICO ACOES FQ FIA	4.240.360,99	3,09%	PACIFICO	2,64%	9,37%	0,24%	-4,37%	-1,25%	-0,10%	-24,76%	4,82%
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2.476.292,37	1,80%	SANTANDER	0,64%	9,80%	3,13%	-1,85%	8,82%	5,79%	-12,39%	19,28%
Benchmark:	IBOVESPA				3,22%	-1,58%	9,26%	6,23%	-11,78%	27,40%	14,76%
<b>Total</b>	<b>137.236.430,22</b>	<b>100%</b>			<b>1,34%</b>	<b>1,25%</b>	<b>3,41%</b>	<b>6,11%</b>	<b>5,34%</b>	<b>4,28%</b>	<b>13,71%</b>
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.				0,80%	4,27%	7,87%	6,70%	16,47%	32,00%	40,20%

\* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatório foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC. O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

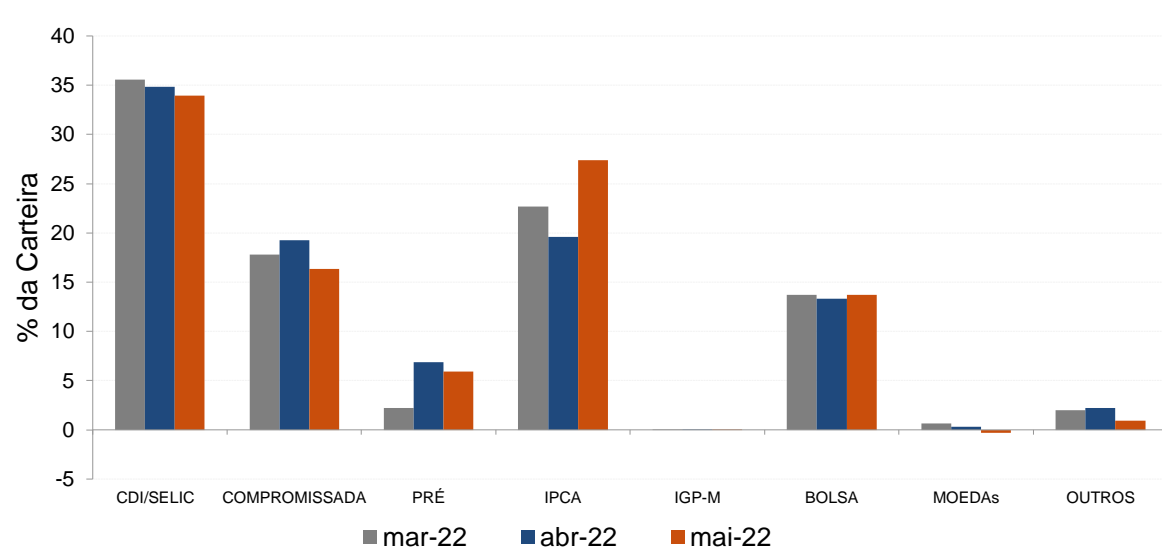
## Distribuição da Carteira

O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais fatores de risco ao longo do tempo.

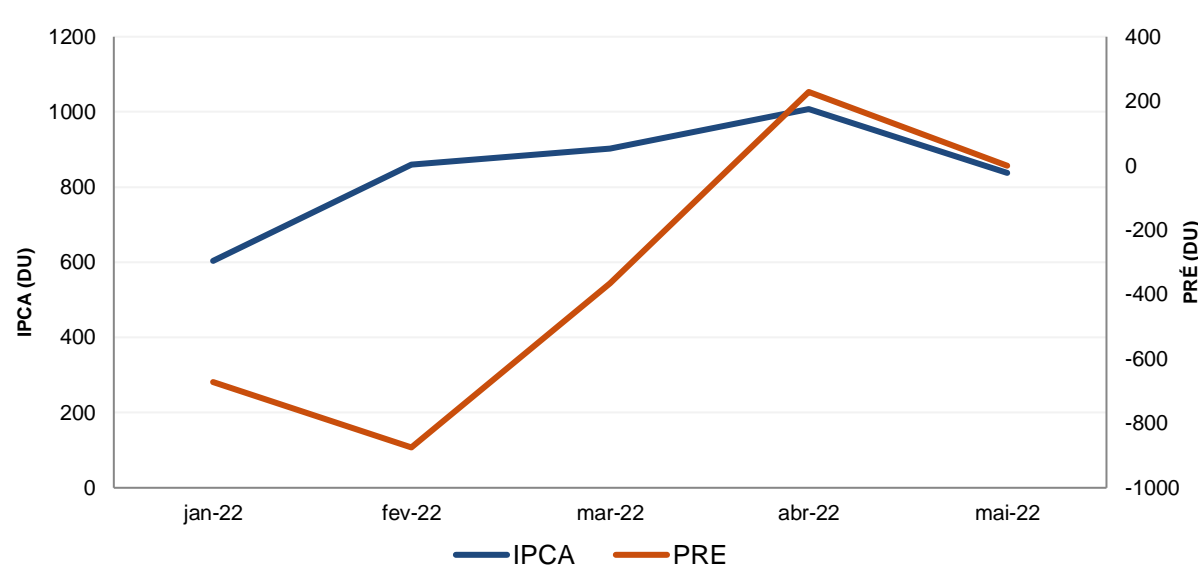
### Evolução do Patrimônio Líquido



### Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



### Evolução da Duration



## Análises de Renda Variável

Essa seção abrange análises sobre a carteira de Renda Variável. Todas as informações sobre concentração são relativas ao total da carteira de Renda Variável do plano.

### Maiores Exposições

A análise de maiores exposições apresenta as ações com maior participação na carteira, o setor ao qual pertencem e a evolução da posição em relação ao mês anterior.

Nome	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	868,69	4,71	742,74	4,18
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	821,47	4,45	817,83	4,60
EQTL3	Energia Elétrica	773,59	4,19	714,85	4,02
ITUB4	Intermediários Financeiros	725,75	3,93	629,37	3,54
BPAC11	Intermediários Financeiros	569,05	3,08	492,52	2,77
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	567,70	3,08	546,25	3,07
LCAM3	Diversos	487,32	2,64	432,37	2,43
RENT3	Diversos	445,12	2,41	325,22	1,83
SUZB3	Madeira e Papel	444,31	2,41	366,69	2,06
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	415,56	2,25	417,45	2,35

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

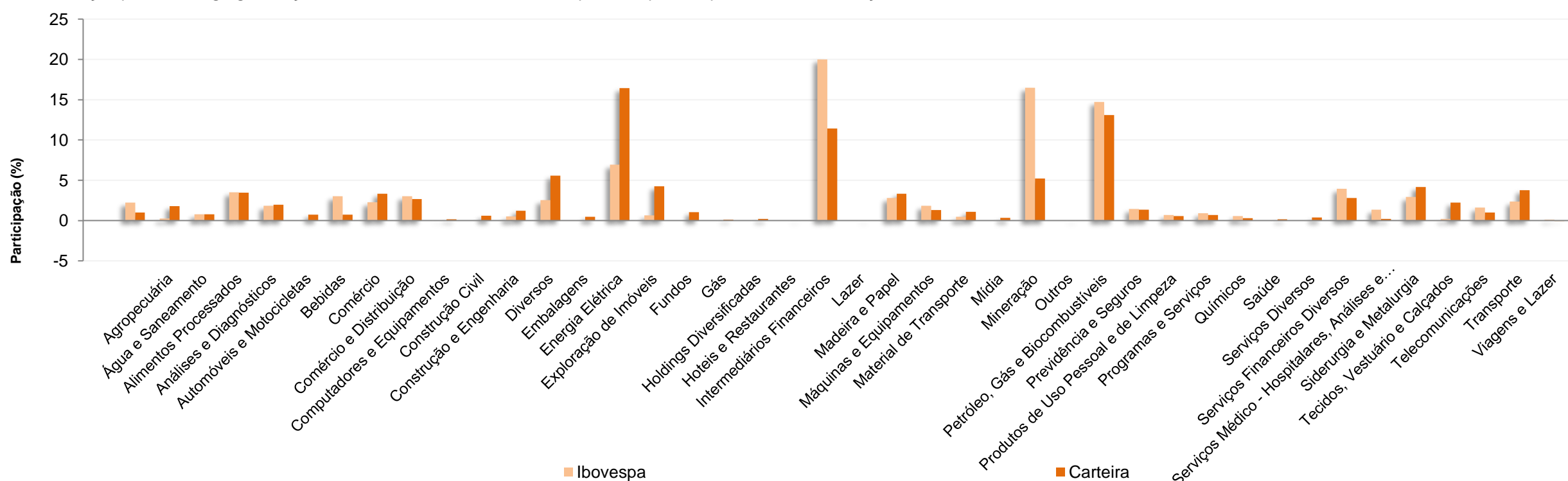
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PASS12	25,58	0,14	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	5,68	0,03	0,01	13
GEPA4	5,24	0,03	0,01	3
MTSA4	26,41	0,14	0,02	2
VALE3	868,69	4,71	0,00	1
PETR4	821,47	4,45	0,00	1
EQTL3	773,59	4,19	0,00	1
ITUB4	725,75	3,93	0,00	1
BPAC11	569,05	3,08	0,00	1
CSAN3	567,70	3,08	0,00	1

\* em mil R\$

### Concentração por setor

A concentração por setor segrega as ações da carteira em setores da Bovespa e compara os percentuais de alocação da carteira com os do benchmark de renda variável.



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.

## Análises de Contrapartes

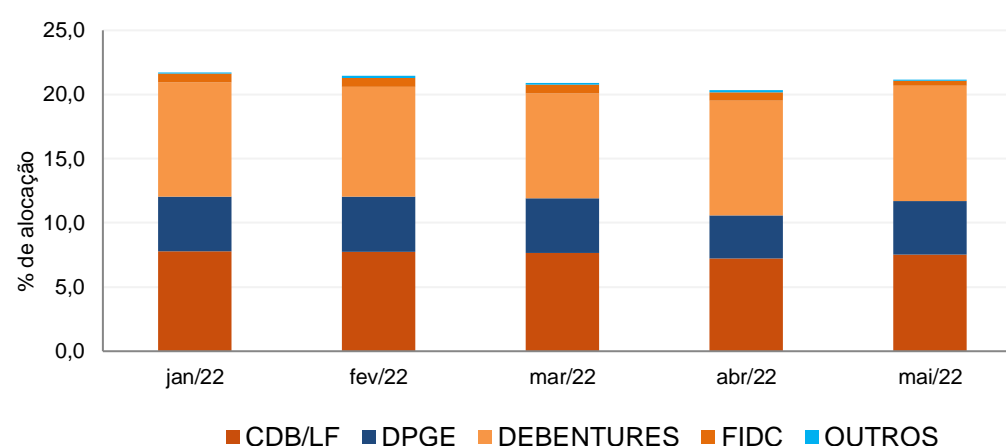
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO SAFRA SA	2.805,02	2,03	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	2.458,17	1,78	Faixa 1
BANCO AGIBANK S.A.	2.360,72	1,71	Faixa 4
BANCO C6 S.A.	2.314,31	1,67	Faixa 3
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.800,33	1,30	Faixa 1
CIA LOCACAO AMERICAS	1.344,65	0,97	Faixa 2
BCO DAYCOVAL SA	1.309,21	0,95	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.243,45	0,90	Faixa 2
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	1.151,71	0,83	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.104,58	0,80	Faixa 2

\* em mil R\$

### Alocação Por Tipo de Crédito



## Mudanças de Faixa de Risco de Crédito no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês. As alterações são checadas primeiro verificando a faixa correspondente da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Faixa Anterior	Faixa Atual	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
CRI RBRA 1 511	27,13	RB CAPITAL COMPANHIA SECURITIZACAO	Sem Faixa	Faixa 3	20-out-34	IPCA	1,56%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
LCAMB4	777,18	CIA LOCACAO AMERICAS	Sem Faixa	Faixa 1	10-mai-27	CDI	1,92%	MAG OABPREV GO FI MULT
LCAMB4	6,44	CIA LOCACAO AMERICAS	Sem Faixa	Faixa 1	10-mai-27	CDI	1,92%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
RDORB3	2,67	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-mai-32	CDI	1,90%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT



OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/05/2022

## Aquisições de Ativos no Mês

As tabelas a seguir apresentam os títulos adquiridos no último mês. Esses dados são extraídos dos arquivos XMLs da carteira e dos fundos com alocação direta. É apresentada a faixa de risco de crédito da emissão e, em caso de inexistência, apresenta-se a faixa do emissor.

Títulos Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
CEAB12	13-nov-25	414.261	0,30%	CDI	C&A MODAS S.A.	19-mai-22	2,28%	Faixa 2	MAG OABPREV GO FI MULT
DPGE CDI	12-mai-23	1.254.447	0,91%	CDI	BANCO AGIBANK S.A.	26-mai-22	130,00%	Faixa 4	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
GUAR15	10-mai-27	597.872	0,43%	CDI	GUARARAPES CONFECOES SA (EX COM	26-mai-22	2,64%	Faixa 3	MAG OABPREV GO FI MULT
LCAMB4	10-mai-27	777.178	0,56%	CDI	CIA LOCACAO AMERICAS	13-mai-22	1,92%	Faixa 1	MAG OABPREV GO FI MULT
LF CDI	10-nov-22	1.125.032	0,81%	CDI	BCO BRADESCO SA	19-mai-22	115,00%	Faixa 1	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2025-03-01	01-mar-25	1.168.361	0,84%	Selic		17-mai-22	0,00%	0,13%	MAG OABPREV GO FI MULT
LFT 2027-09-01	01-set-27	1.742.060	1,26%	Selic		17-mai-22	0,56%	0,00%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.027.380	0,74%	IPCA		30-mai-22	6,32%	6,43%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	614.842	0,44%	IPCA		20-mai-22	5,75%	5,80%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	47.601	0,03%	IPCA		20-mai-22	5,45%	5,80%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	47.601	0,03%	IPCA		20-mai-22	5,42%	5,80%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	983.380	0,71%	IPCA		25-mai-22	5,84%	5,85%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	983.380	0,71%	IPCA		25-mai-22	5,84%	5,85%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	983.380	0,71%	IPCA		25-mai-22	5,83%	5,85%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	975.286	0,71%	IPCA		02-mai-22	5,57%	5,56%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	975.286	0,71%	IPCA		30-mai-22	5,90%	5,98%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	967.192	0,70%	IPCA		24-mai-22	5,73%	5,82%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	760.804	0,55%	IPCA		26-mai-22	5,86%	5,83%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	12.140	0,01%	IPCA		02-mai-22	5,58%	5,56%	MAG OABPREV GO FI MULT



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.