

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/08/2022

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
Renda Fixa	123.406.416,06	88,28%			1,21%	2,36%	6,37%	8,19%	10,43%	14,66%	19,40%
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
Multimercados Institucionais	113.962.891,81	81,52%		1,04%							
MAG OABPREV GO FI MULT	56.876.152,55	40,69%	MONGERAL AEGON	100%	1,17%	2,45%	6,50%	8,62%	12,08%	17,46%	21,49%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	57.086.739,26	40,84%	VINCI	100%	0,92%	2,50%	6,60%	8,47%	9,94%	14,02%	21,53%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,35%	3,78%	7,23%	9,17%	12,40%	17,74%	24,75%
Renda Fixa	9.443.524,25	6,76%		3,35%							
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	2.461.354,86	1,76%	ITAU	0,01%	0,01%	1,16%	3,24%	6,07%	7,74%	10,23%	12,93%
ITAU RF IMA-B ATIVO FC	6.545.553,57	4,68%	ITAU	1,50%	4,84%	0,86%	-0,90%	4,28%	3,92%	4,58%	7,85%
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	370.309,52	0,26%	NOVERO	1,44%		-0,13%	-0,30%	-0,72%	-0,97%	-1,43%	0,24%
DELTA CRED PRIV FC FIRF	66.306,30	0,05%	NOVERO	5,36%	0,01%	-1,38%	-1,64%	4,60%	6,42%	-51,70%	-58,82%
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
Renda Variável	16.386.353,96	11,72%			6,54%	-0,09%	-0,23%	3,18%	-11,66%	-2,15%	1,05%
Benchmark:	IBOVESPA				6,16%	-1,64%	-3,20%	4,48%	-7,79%	10,22%	8,29%
Renda Variável	16.386.353,96	11,72%		2,55%							
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	4.151.745,90	2,97%	BC GESTAO	1,46%	11,47%	4,64%	-3,22%	-5,45%	-4,83%	-23,39%	-11,60%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	5.384.540,98	3,85%	CONSTANCIA	0,42%	3,64%	6,87%	-0,18%	6,10%	9,14%	-0,65%	16,67%
PACIFICO ACOES FQ FIA	4.410.346,64	3,15%	PACIFICO	3,05%	12,99%	7,97%	4,01%	-0,54%	3,91%	-17,47%	-7,46%
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2.439.720,44	1,75%	SANTANDER	0,70%	11,58%	6,54%	-1,48%	-3,30%	4,23%	-8,21%	3,42%
Benchmark:	IBOVESPA				6,16%	-1,64%	-3,20%	4,48%	-7,79%	10,22%	8,29%
Total	139.792.770,03	100%			2,32%	1,81%	2,07%	5,55%	7,52%	7,00%	12,05%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.				0,06%	0,74%	5,04%	7,49%	13,28%	30,18%	39,49%

* 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.

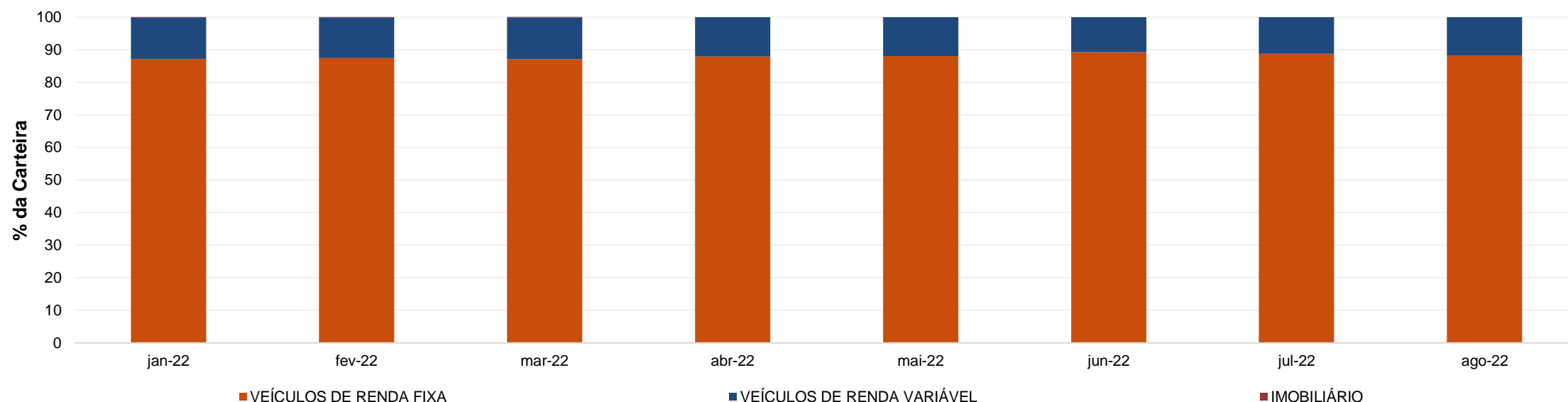
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

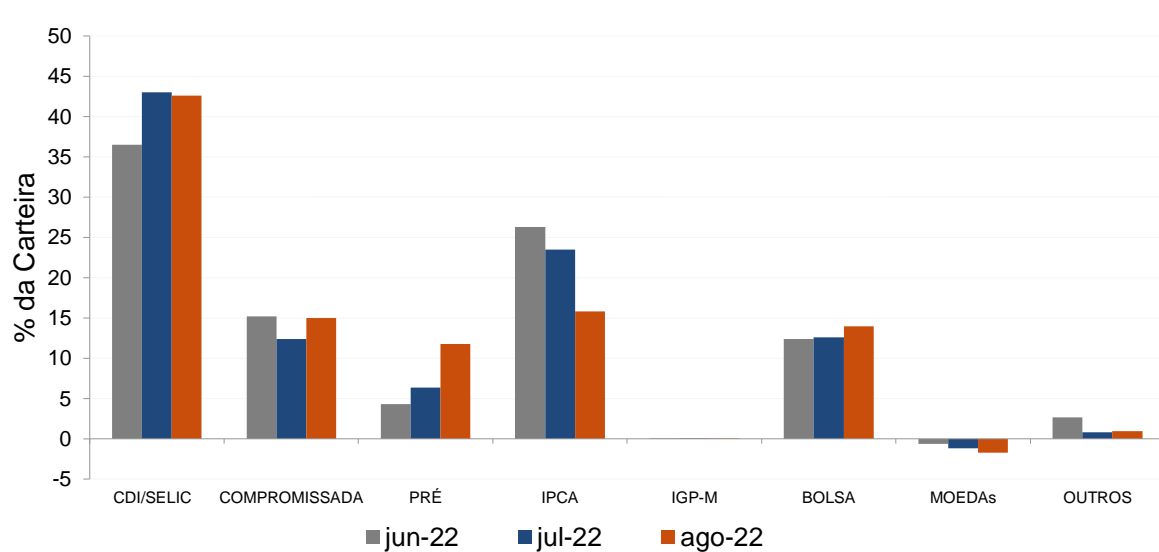
Distribuição da Carteira

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.

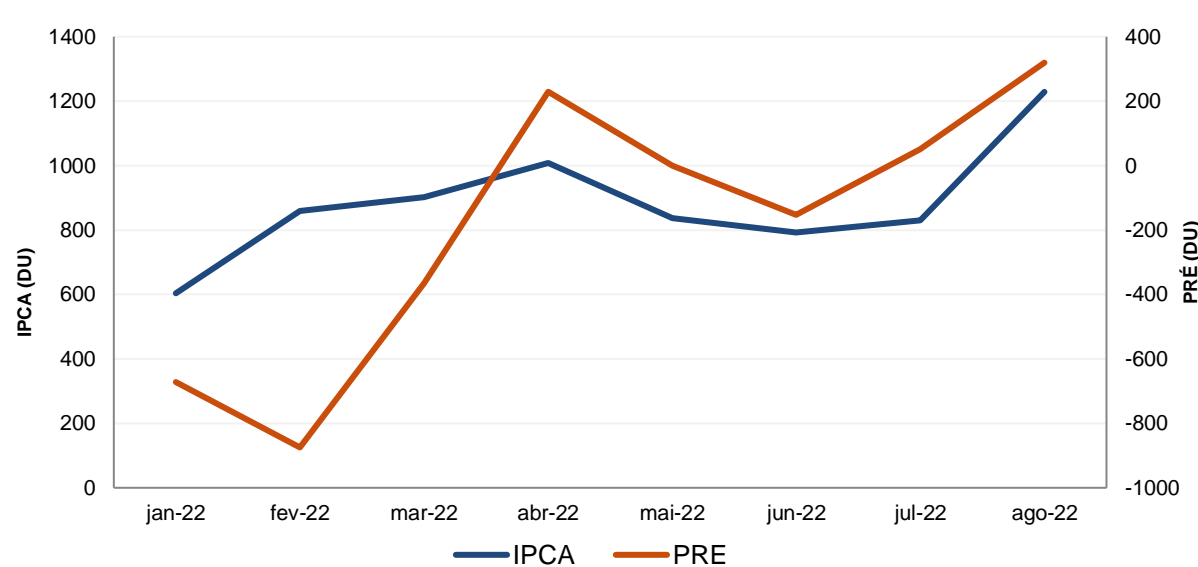
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
ITUB4	Intermediários Financeiros	954,86	5,24	801,09	4,64
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	855,72	4,69	887,43	5,14
EQTL3	Energia Elétrica	785,39	4,31	835,54	4,84
RENT3	Diversos	760,71	4,17	801,53	4,64
BPAC11	Intermediários Financeiros	672,88	3,69	571,54	3,31
RAIL3	Transporte	595,74	3,27	485,92	2,81
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	595,04	3,26	534,89	3,10
VALE3	Mineração	523,32	2,87	653,50	3,78
BBAS3	Intermediários Financeiros	421,85	2,31	294,77	1,71
ENGI11	Energia Elétrica	394,59	2,16	315,13	1,82

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

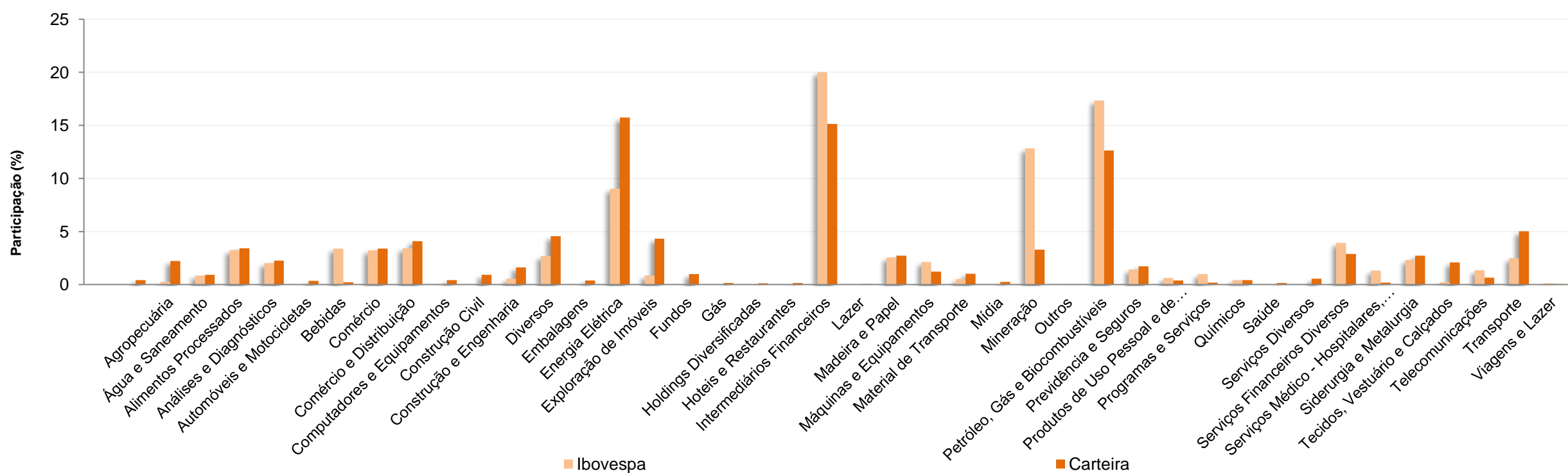
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PASS12	29,93	0,16	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	5,75	0,03	0,01	5
MTSA4	28,15	0,15	0,02	3
SCAR3	12,48	0,07	0,00	2
ITUB4	954,86	5,24	0,00	1
PETR4	855,72	4,69	0,00	1
EQTL3	785,39	4,31	0,00	1
RENT3	760,71	4,17	0,00	1
BPAC11	672,88	3,69	0,00	1
RAIL3	595,74	3,27	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.



OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/08/2022

Análises de Contrapartes

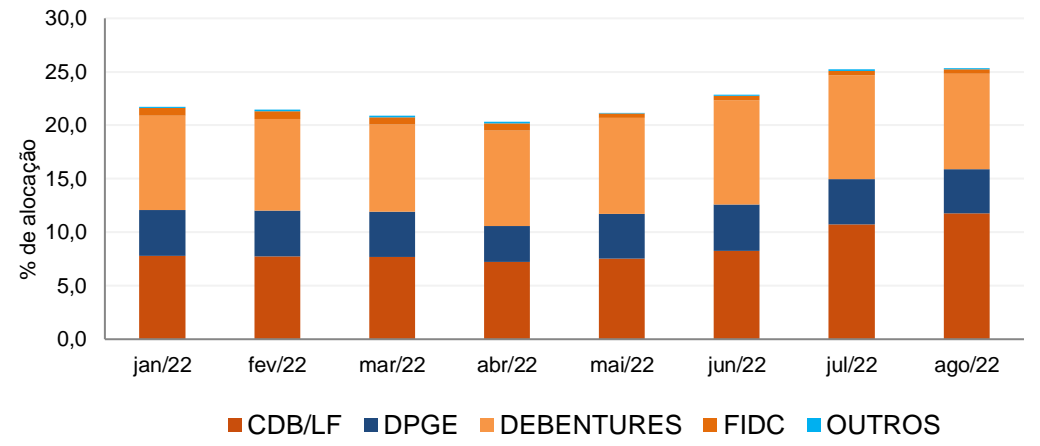
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	4.107,61	2,92	Faixa 1
BANCO C6 S.A.	2.873,28	2,04	Faixa 3
BCO SAFRA SA	2.858,28	2,03	Faixa 1
BANCO AGIBANK S.A.	2.331,38	1,66	Faixa 4
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2.109,01	1,50	Faixa 1
BCO VOTORANTIM SA	1.721,53	1,22	Faixa 2
BCO DAYCOVAL SA	1.364,66	0,97	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.286,13	0,91	Faixa 2
BCO MODAL SA	1.137,83	0,81	Faixa 3
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	1.133,02	0,81	Faixa 1

* 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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								



OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/08/2022

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
LF CDI	22-ago-25	702.687	0,50%	CDI	BCO TOYOTA BRASIL SA	22-ago-22	1,00%	Faixa 1	MAG OABPREV GO FI MULT
LF CDI Mensal	12-jun-23	201.652	0,14%	CDI	BCO BTG PACTUAL SA	10-ago-22	116,00%	Faixa 2	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
LF CDI Mensal	01-jul-26	501.085	0,36%	CDI	BCO ITAU SA	25-ago-22	0,87%	Faixa 1	MAG OABPREV GO FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	2.420.057	1,72%	Selic		16-ago-22	4,00%	0,03%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2.358.823	1,68%	Selic		22-ago-22	4,00%	0,00%	MAG OABPREV GO FI MULT

