

## OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/10/2022

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>126.937.331,87</b>	<b>87,86%</b>				<b>1,12%</b>	<b>3,36%</b>	<b>5,78%</b>	<b>10,50%</b>	<b>12,41%</b>	<b>17,04%</b>	<b>20,25%</b>	
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%	
<b>Multimercados Institucionais</b>	<b>116.358.476,88</b>	<b>80,54%</b>			<b>0,34%</b>								
MAG OABPREV GO FI MULT	57.997.257,13	40,14%	MONGERAL AEGON	100%	0,24%	0,96%	3,16%	5,97%	10,76%	12,95%	19,74%	22,63%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	58.361.219,75	40,40%	VINCI	100%	0,48%	1,27%	3,58%	5,87%	10,89%	12,38%	16,50%	21,90%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,18%	3,82%	7,59%	11,82%	13,72%	19,83%	26,15%	
<b>Renda Fixa</b>	<b>10.578.854,99</b>	<b>7,32%</b>			<b>1,16%</b>								
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	3.417.798,02	2,37%	ITAU	0,01%	0,01%	1,03%	3,30%	6,52%	10,02%	11,51%	15,17%	18,49%	
ITAU RF IMA-B ATIVO FC	6.724.912,19	4,65%	ITAU	1,50%	1,82%	1,25%	3,63%	2,75%	6,77%	11,01%	12,69%	12,22%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	369.454,46	0,26%	NOVERO	1,44%		-0,11%	-0,36%	-0,72%	-1,20%	-1,44%	0,23%	3,96%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	66.690,32	0,05%	NOVERO	5,36%	0,99%	-0,27%	-0,81%	-0,47%	7,03%	9,07%	-58,40%	-92,50%	
Benchmark:	CDI					1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%	
<b>Renda Variável</b>	<b>17.532.707,06</b>	<b>12,14%</b>				<b>7,08%</b>	<b>13,99%</b>	<b>8,69%</b>	<b>10,40%</b>	<b>10,41%</b>	<b>12,31%</b>	<b>3,26%</b>	
Benchmark:	IBOVESPA					5,45%	12,48%	7,57%	10,70%	12,11%	23,51%	8,22%	
<b>Renda Variável</b>	<b>17.532.707,06</b>	<b>12,14%</b>			<b>1,34%</b>								
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	4.472.014,45	3,10%	BC GESTAO	1,79%	6,81%	7,53%	12,71%	5,32%	2,51%	1,49%	0,48%	-8,62%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	5.614.240,98	3,89%	CONSTANCIA	0,42%	2,14%	5,41%	11,43%	6,85%	13,80%	16,82%	29,56%	17,35%	
MANTARO AÇÕES FICFIA	4.878.738,16	3,38%	PACIFICO	3,14%	7,37%	9,78%	19,44%	15,33%	14,94%	7,69%	8,27%	8,83%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2.567.713,47	1,78%	SANTANDER	0,72%	7,40%	5,08%	12,13%	6,94%	9,70%	10,93%	15,70%	-2,19%	
Benchmark:	IBOVESPA					5,45%	12,48%	7,57%	10,70%	12,11%	23,51%	8,22%	
<b>Total</b>	<b>144.470.038,93</b>	<b>100%</b>				<b>1,19%</b>	<b>1,81%</b>	<b>4,55%</b>	<b>6,13%</b>	<b>10,42%</b>	<b>12,09%</b>	<b>16,09%</b>	<b>17,58%</b>
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					0,79%	0,86%	2,37%	8,35%	10,81%	28,09%	39,64%	

\* 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.

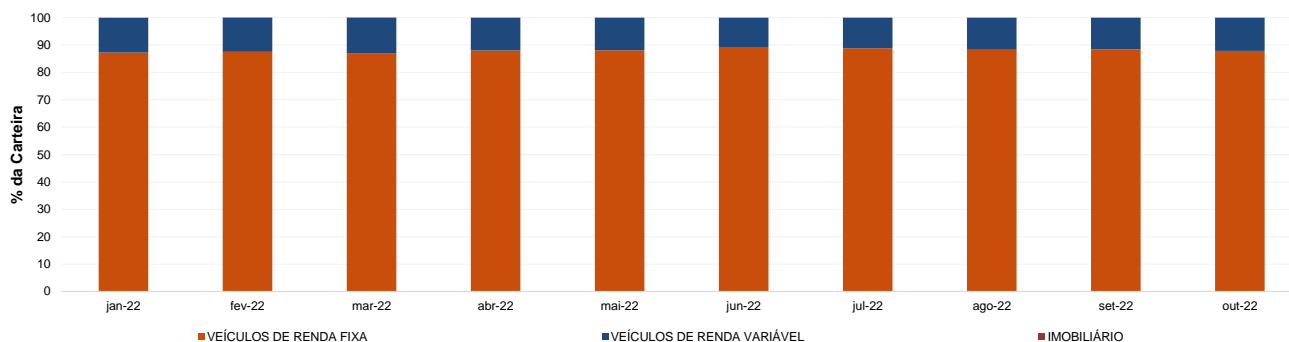
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

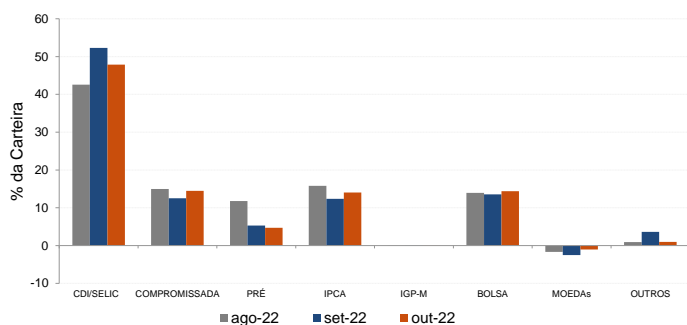
## Distribuição da Carteira

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.

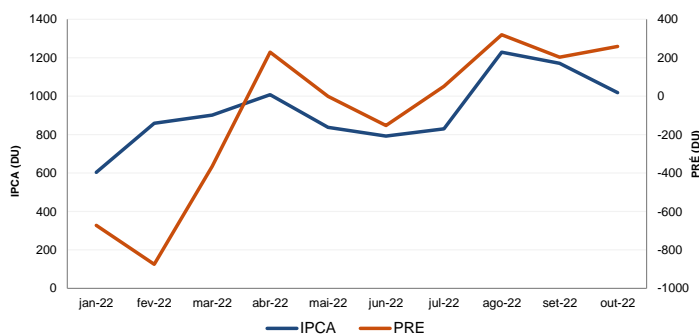
## Evolução do Patrimônio Líquido



## 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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
ITUB4	Intermediários Financeiros	964,92	4,75	996,95	5,28
EQTL3	Energia Elétrica	859,94	4,23	790,92	4,19
RENT3	Diversos	818,23	4,03	769,35	4,07
BPAC11	Intermediários Financeiros	775,80	3,82	713,27	3,78
VALE3	Mineração	693,87	3,42	606,15	3,21
ENGI11	Energia Elétrica	633,54	3,12	469,27	2,49
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	631,55	3,11	723,56	3,83
SUZB3	Madeira e Papel	611,55	3,01	431,84	2,29
RAIL3	Transporte	513,11	2,53	415,89	2,20
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	499,95	2,46	504,90	2,67

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

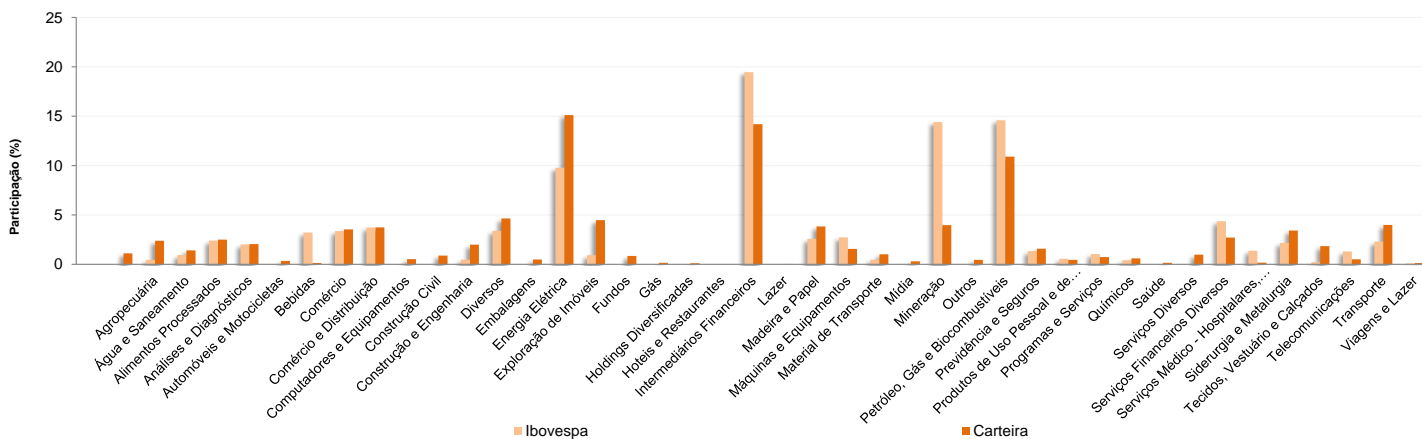
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PASS12	31,42	0,15	0,00	Sem Liquidez
MODL11	0,01	0,00	0,00	Sem Liquidez
MTSA4	28,63	0,14	0,02	2
CRIV4	5,84	0,03	0,01	2
GEP4	4,53	0,02	0,01	2
ITUB4	964,92	4,75	0,00	1
EQTL3	859,94	4,23	0,00	1
RENT3	818,23	4,03	0,00	1
BPAC11	775,80	3,82	0,00	1
VALE3	693,87	3,42	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.



## Análises de Contrapartes

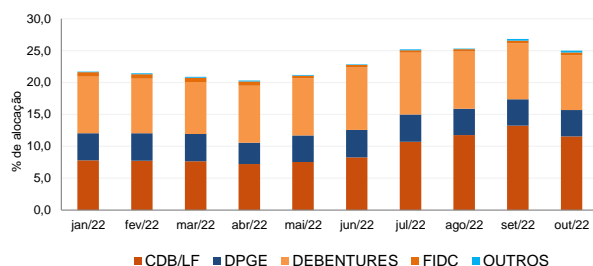
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	4.205,60	2,90	Faixa 1
BANCO C6 S.A.	2.913,96	2,01	Faixa 3
BCO SAFRA SA	2.531,40	1,74	Faixa 1
BANCO AGIBANK S.A.	2.397,49	1,65	Faixa 4
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2.206,40	1,52	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	1.387,95	0,96	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.314,50	0,91	Faixa 2
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	1.183,20	0,82	Faixa 1
BANCO MODAL SA	1.168,01	0,80	Faixa 3
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.125,59	0,78	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
CCPRA3	0,45	CC DOS PR. DA IND. DE R. ORNAM. CAL E CALC. D	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-24	CDI	1,37%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CCPRA3	8,94	CC DOS PR. DA IND. DE R. ORNAM. CAL E CALC. D	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-24	CDI	1,75%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CCPRB3	6,17	CC DOS PR. DA IND. DE R. ORNAM. CAL E CALC. D	Faixa 3	Faixa 2	15-mar-26	CDI	2,05%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CSNAA2	15,11	CIA SIDERURGICA NACIONAL	Sem Faixa	Faixa 1	20-dez-27	CDI	2,58%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
CSNAA2	17,53	CIA SIDERURGICA NACIONAL	Sem Faixa	Faixa 1	20-dez-27	CDI	2,50%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
RDORA5	25,93	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-32	CDI	2,05%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
RDORA5	24,06	REDE D OR SAO LUIZ SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-32	CDI	2,00%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
VBBR15	8,47	VIBRA ENERGIA SA	Sem Faixa	Faixa 1	03-out-29	CDI	1,50%	BRAM INSTITUCIONAL FI RF CRED PRIV

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/10/2022

**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. Nenhuma operação feita no último mês.