

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 30/11/2022

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	128.207.495,57	88,72%				0,49%	2,63%	5,05%	11,04%	11,78%	16,80%	20,77%
Benchmark:	CDI					1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%
Multimercados Institucionais	117.043.099,19	80,99%			0,57%							
MAG OABPREV GO FI MULT	58.466.648,29	40,46%	MONGERAL AEGON	100%	0,21%	0,81%	2,80%	5,31%	11,66%	12,88%	19,67%	23,47%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	58.576.450,90	40,53%	VINCI	100%	1,02%	0,37%	2,61%	5,18%	11,30%	11,68%	16,07%	22,44%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,18%	3,64%	7,56%	13,14%	14,21%	20,88%	26,95%
Renda Fixa	11.164.396,38	7,73%			2,09%							
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FIC FI	4.102.159,98	2,84%	ITAU	0,01%	0,01%	1,01%	3,14%	6,48%	11,12%	11,96%	16,20%	19,25%
ITAU RF IMA-B ATIVO FIC FI	6.626.110,84	4,59%	ITAU	1,62%	3,45%	-1,47%	1,23%	0,32%	5,20%	5,29%	8,77%	13,73%
TREK FI RF CRED PRIV IMOB.	369.036,53	0,26%	NOVERO	1,44%		0,00%	-0,23%	-0,53%	-1,20%	-1,32%	0,34%	4,09%
DELTA CRED PRIV FIC FI RF	67.089,03	0,05%	NOVERO	5,36%	1,12%	0,60%	1,18%	-0,48%	7,67%	8,82%	-57,08%	-92,45%
Benchmark:	CDI					1,02%	3,15%	6,50%	11,12%	11,97%	16,20%	19,67%
Renda Variável	16.301.087,63	11,28%				-7,02%	-0,52%	-0,61%	2,64%	3,89%	-8,47%	-6,77%
Benchmark:	IBOVESPA					-3,06%	2,71%	1,02%	7,31%	10,37%	3,30%	3,93%
Renda Variável	16.301.087,63	11,28%			2,74%							
BRASIL CAPITAL 30 INSTIT. FIC FIA	4.239.417,99	2,93%	BC GESTAO	1,80%	9,43%	-5,20%	2,11%	-1,17%	-2,82%	-0,33%	-15,74%	-14,73%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	5.200.369,20	3,60%	CONSTANCIA	0,42%	8,95%	-7,37%	-3,42%	-3,59%	5,41%	8,71%	5,76%	4,61%
MANTARO AÇÕES FIC FIA	4.378.649,96	3,03%	PACIFICO	3,23%	11,12%	-10,25%	-0,72%	3,26%	3,16%	1,97%	-11,56%	-3,64%
SANTANDER FI IBOV ATIVO INSTIT. AÇÕES	2.482.650,48	1,72%	SANTANDER	0,75%	11,16%	-3,31%	1,76%	0,26%	6,07%	9,10%	-1,39%	-6,83%
Benchmark:	IBOVESPA					-3,06%	2,71%	1,02%	7,31%	10,37%	3,30%	3,93%
Total	144.508.583,20	100%			1,63%	-0,42%	2,26%	4,38%	9,95%	10,76%	12,90%	16,57%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					0,70%	1,51%	2,26%	9,11%	10,31%	27,36%	39,42%

* 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.

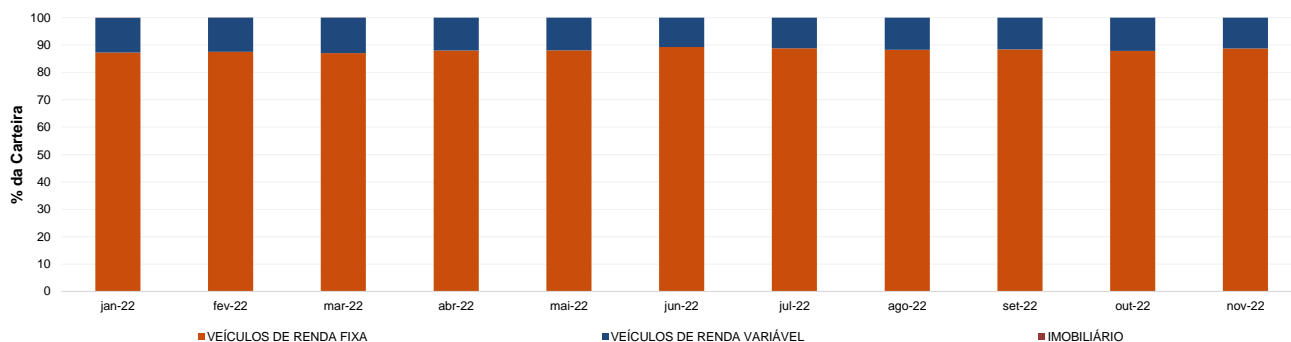
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

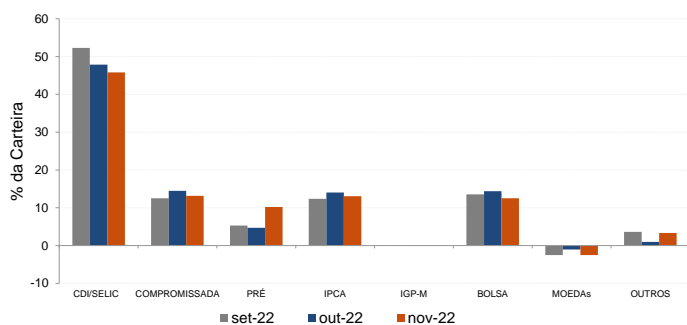
Distribuição da Carteira

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.

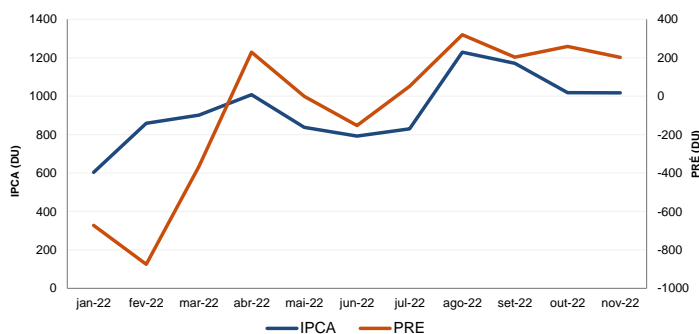
Evolução do Patrimônio Líquido



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	997,02	5,55	964,92	4,75
VALE3	Mineração	911,72	5,08	693,87	3,42
EQTL3	Energia Elétrica	762,24	4,24	859,94	4,23
SUZB3	Madeira e Papel	734,37	4,09	611,55	3,01
BPAC11	Intermediários Financeiros	684,99	3,81	775,80	3,82
RENT3	Diversos	632,29	3,52	818,23	4,03
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	606,71	3,38	631,55	3,11
ENG11	Energia Elétrica	542,01	3,02	633,54	3,12
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	524,05	2,92	499,95	2,46
BBAS3	Intermediários Financeiros	493,39	2,75	369,20	1,82

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

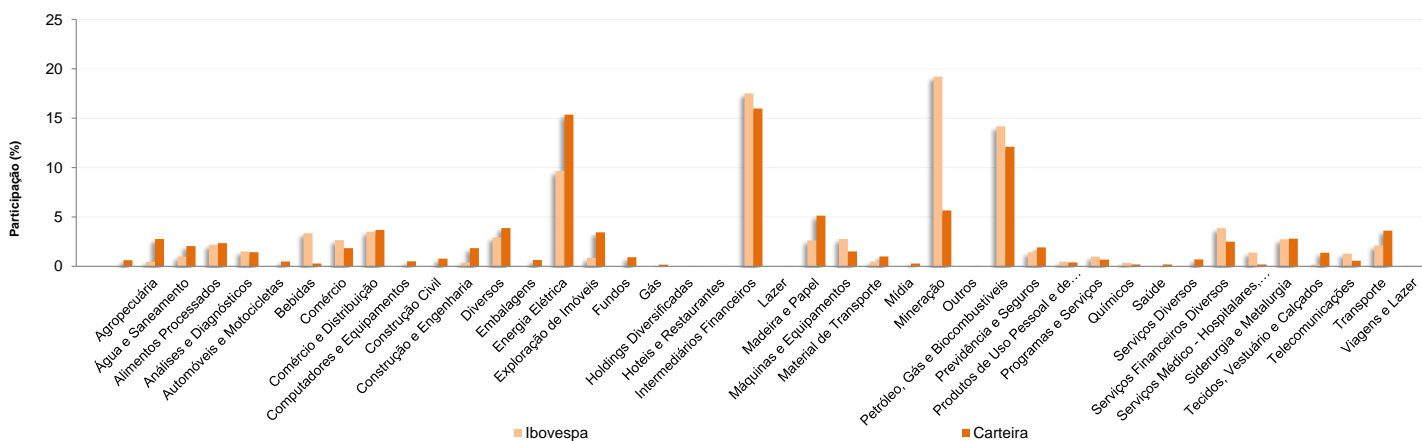
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PASS12	31,95	0,18	0,00	Sem Liquidez
BKBR3	0,03	0,00	0,00	Sem Liquidez
MODL11	0,01	0,00	0,00	Sem Liquidez
MTSA4	31,03	0,17	0,03	2
CRIV4	5,82	0,03	0,01	2
GEPA4	4,64	0,03	0,01	2
ITUB4	997,02	5,55	0,00	1
VALE3	911,72	5,08	0,00	1
EQTL3	762,24	4,24	0,00	1
SUZB3	734,37	4,09	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

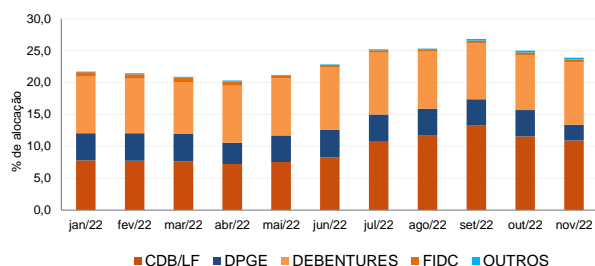
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BANCO VOTORANTIM S.A.	2.879,60	1,99	Faixa 2
BCO SAFRA SA	2.532,89	1,75	Faixa 1
BANCO AGIBANK S.A.	2.430,67	1,68	Faixa 4
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2.251,82	1,55	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	1.964,90	1,36	Faixa 1
NCF PARTICIPACOES SA	1.618,65	1,12	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.328,58	0,92	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	1.252,41	0,86	Faixa 1
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	1.183,58	0,82	Faixa 1
BANCO MODAL SA	1.180,27	0,81	Faixa 3

* 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
ARML13	9,55	ARMAC LOCAÇÃO, LOGÍSTICA E SERVIÇOS S.A.	Sem Faixa	Faixa 3	04-nov-29	CDI	2,33%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
LAMEA4	3,98	AMERICANAS S.A	Faixa 1	Faixa 2	18-mai-23	CDI	3,00%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
LAMEA5	0,09	AMERICANAS S.A	Faixa 1	Faixa 2	02-jun-23	CDI	1,26%	BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV
LAMEA5	0,12	AMERICANAS S.A	Faixa 1	Faixa 2	02-jun-23	CDI	1,49%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
LAMEA7	2,15	AMERICANAS S.A	Faixa 1	Faixa 2	15-jul-33	CDI	2,80%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
LAMEA7	3,55	AMERICANAS S.A	Faixa 1	Faixa 2	15-jul-33	CDI	2,75%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
LAMEA7	6,75	AMERICANAS S.A	Faixa 1	Faixa 2	15-jul-33	CDI	2,56%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
LAMEA7	19,12	AMERICANAS S.A	Faixa 1	Faixa 2	15-jul-33	CDI	2,75%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
LAMEA7	48,05	AMERICANAS S.A	Faixa 1	Faixa 2	15-jul-33	CDI	2,75%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	2,64	AMERICANAS S.A	Faixa 1	Faixa 2	15-jul-33	CDI	2,56%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 30/11/2022

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	30-nov-26	1.250.699	0,86%	CDI	BCO VOLKSWAGEN SA	29-nov-22	1,30%	Faixa 1	MAG OABPREV GO FI MULT
LF CDI Mensal	04-nov-24	1.766.356	1,22%	CDI	BANCO VOTORANTIM S.A.	03-nov-22	1,00%	Faixa 2	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NCFP14	23-dez-23	1.616.854	1,12%	CDI	NCF PARTICIPACOES SA	29-nov-22	1,07%	Faixa 2	MAG OABPREV GO FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2026-03-01	01-mar-26	2.488.374	1,72%	Selic		14-nov-22	0,10%	0,00%	MAG OABPREV GO FI MULT

