

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 30/12/2022

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	128.716.813,57	89,04%				0,79%	2,41%	5,38%	11,91%	11,91%	16,69%	20,72%	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%	
Multimercados Institucionais	118.024.270,15	81,65%			0,41%								
MAG OABPREV GO FI MULT	58.977.211,24	40,80%	MONGERAL AEGON	100%	0,45%	0,87%	2,67%	5,69%	12,63%	12,63%	19,41%	23,71%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	59.047.058,91	40,85%	VINCI	100%	0,63%	0,80%	2,46%	5,56%	12,19%	12,19%	15,93%	21,98%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,30%	3,70%	7,68%	14,61%	14,61%	22,03%	27,91%	
Renda Fixa	10.692.543,42	7,40%			1,19%								
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FIC FI	3.646.652,02	2,52%	ITAU	0,01%	0,03%	1,10%	3,17%	6,57%	12,35%	12,35%	17,22%	20,13%	
ITAU RF IMA-B ATIVO FIC FI	6.609.784,35	4,57%	ITAU	1,66%	1,92%	-0,25%	-0,49%	0,73%	4,94%	4,94%	3,40%	11,18%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOB.	368.582,33	0,25%	NOVERO	1,44%	0,00%	-0,11%	-0,48%	-1,20%	-1,20%	0,47%	4,21%	4,21%	
DELTA CRED PRIV FIC FI RF	67.524,72	0,05%	NOVERO	5,36%	0,76%	0,65%	0,97%	1,06%	8,37%	8,37%	-51,59%	-92,39%	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%	
Renda Variável	15.836.870,63	10,96%				-2,85%	-3,27%	8,82%	-0,28%	-0,28%	-16,98%	-17,62%	
Benchmark:	IBOVESPA					-2,45%	-0,27%	11,36%	4,69%	4,69%	-7,80%	-5,11%	
Renda Variável	15.836.870,63	10,96%			2,21%								
BRASIL CAPITAL 30 INSTIT. FIC FIA	4.127.935,12	2,86%	BC GESTAO	1,84%	9,00%	-2,63%	-0,74%	10,07%	-5,38%	-5,38%	-23,90%	-24,21%	
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	5.035.633,27	3,48%	CONSTANCIA	0,42%	2,73%	-3,17%	-5,46%	4,62%	2,07%	2,07%	-3,65%	-9,65%	
MANTARO AÇÕES FIC FIA	4.255.556,03	2,94%	PACIFICO	3,41%	9,48%	-2,81%	-4,24%	11,78%	0,26%	0,26%	-21,71%	-14,15%	
SANTANDER FI IBOV ATIVO INSTIT. AÇÕES	2.417.746,22	1,67%	SANTANDER	0,78%	8,16%	-2,61%	-1,06%	10,77%	3,29%	3,29%	-10,61%	-15,70%	
Benchmark:	IBOVESPA					-2,45%	-0,27%	11,36%	4,69%	4,69%	-7,80%	-5,11%	
Total	144.553.684,20	100%				1,25%	0,38%	1,76%	5,76%	10,37%	10,37%	11,38%	14,65%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					1,04%	2,55%	2,35%	10,25%	10,25%	26,40%	38,71%	

* 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.

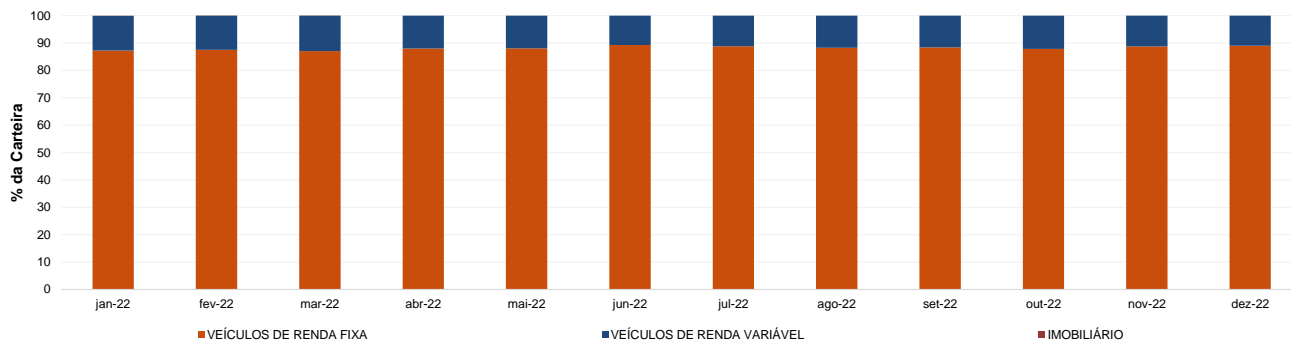
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

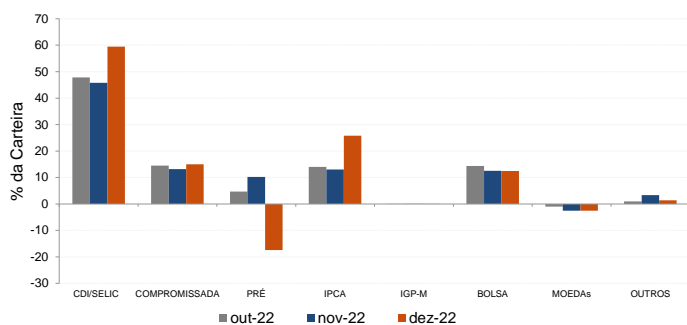
Distribuição da Carteira

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.

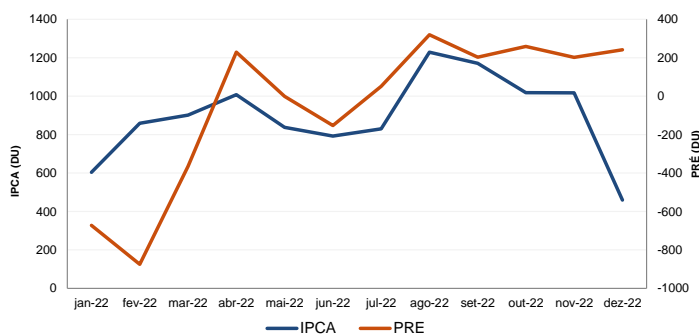
Evolução do Patrimônio Líquido



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	1.126,30	6,12	997,02	5,55
VALE3	Mineração	1.021,99	5,55	911,72	5,08
EQTL3	Energia Elétrica	836,76	4,54	762,24	4,24
BPAC11	Intermediários Financeiros	640,13	3,48	684,99	3,81
SUZB3	Madeira e Papel	620,45	3,37	734,37	4,09
RENT3	Diversos	581,10	3,16	632,29	3,52
ENGI11	Energia Elétrica	576,41	3,13	542,01	3,02
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	558,12	3,03	524,05	2,92
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	525,57	2,85	449,75	2,50
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	456,59	2,48	606,71	3,38

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

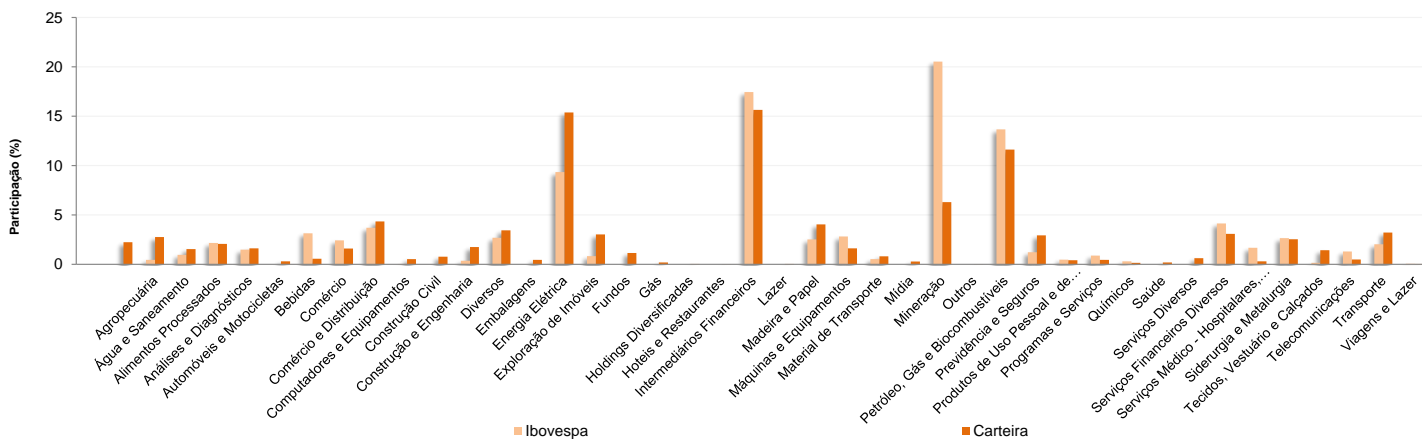
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PASS12	33,15	0,18	0,00	Sem Liquidez
BKBR3	0,03	0,00	0,00	Sem Liquidez
MODL11	0,01	0,00	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	5,66	0,03	0,01	4
GEP44	4,78	0,03	0,01	4
ITUB4	1.126,30	6,12	0,00	1
VALE3	1.021,99	5,55	0,00	1
EQTL3	836,76	4,54	0,00	1
BPAC11	640,13	3,48	0,00	1
SUZB3	620,45	3,37	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

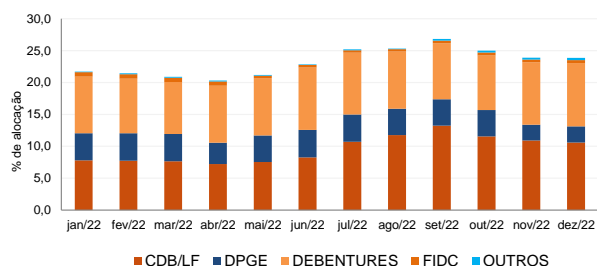
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BANCO VOTORANTIM S.A.	2.885,43	1,98	Faixa 2
BCO SAFRA SA	2.564,04	1,76	Faixa 1
BANCO AGIBANK S.A.	2.465,36	1,69	Faixa 4
BCO BRADESCO SA	1.973,11	1,35	Faixa 1
NCF PARTICIPACOES SA	1.438,26	0,99	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.344,26	0,92	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	1.268,00	0,87	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.255,52	0,86	Faixa 1
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	1.200,68	0,82	Faixa 1
BANCO MODAL SA	1.196,26	0,82	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
EESG12	29,47	ENVIRONMENTAL ESG PARTICIPAÇÕES S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	10-dez-29	CDI	3,25%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
HYPEA4	13,60	HYPERA S.A.	Sem Faixa	Faixa 1	14-dez-27	CDI	1,43%	BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV
IRBR11	0,23	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	Faixa 1	Faixa 2	15-out-23	CDI	3,06%	BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV
PALFA2	11,89	CIA PAULISTA FORCA LUZ	Sem Faixa	Faixa 1	12-dez-26	CDI	1,22%	BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV
PALFA2	17,24	CIA PAULISTA FORCA LUZ	Sem Faixa	Faixa 1	12-dez-26	CDI	1,22%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
RIGEA4	2,49	RGE SUL DISTRIBUIDORA ENERGIA SA	Sem Faixa	Faixa 1	12-dez-26	CDI	1,22%	BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV
RIGEA4	6,27	RGE SUL DISTRIBUIDORA ENERGIA SA	Sem Faixa	Faixa 1	12-dez-26	CDI	1,22%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 30/12/2022

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 Mensal	13-dez-24	604.438	0,41%	CDI	BCO RODOBENS S.A	13-dez-22	1,50%	Faixa 2	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
TIETA0	12-dez-27	532.992	0,37%	CDI	AES BRASIL OPERAÇÕES S.A.	12-dez-22	1,53%	Faixa 2	MAG OABPREV GO FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.034.854	8,26%	IPCA		19-dez-22	6,27%	6,33%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	8.697.661	5,97%	IPCA		20-dez-22	6,26%	6,35%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	572.321	0,39%	IPCA		23-dez-22	6,19%	6,60%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	572.321	0,39%	IPCA		23-dez-22	6,21%	6,60%	MAG OABPREV GO FI MULT