

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/05/2023

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	133.759.995,22	89,07%				1,36%	3,45%	6,05%	5,23%	11,41%	20,95%	27,20%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
Multimercados Institucionais	123.934.963,84	82,52%			0,42%							
MAG OABPREV GO FI MULT	61.810.508,60	41,16%	MONGERAL AEGON	100%	0,36%	1,25%	3,04%	5,72%	4,80%	11,34%	23,49%	30,53%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	62.124.455,24	41,37%	VINCI	100%	0,49%	1,33%	3,38%	6,06%	5,21%	11,55%	19,67%	26,81%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,30%	3,76%	7,60%	6,23%	15,74%	27,37%	32,74%
Renda Fixa	9.825.031,38	6,54%			1,29%							
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES FIC FI	2.189.531,28	1,46%	ITAÚ	0,01%	0,03%	1,14%	3,22%	6,50%	5,34%	13,41%	22,44%	24,71%
ITAÚ RF IMA-B ATIVO FIC FI	7.200.009,02	4,79%	ITAÚ	2,25%	1,77%	2,76%	7,70%	8,66%	8,93%	9,01%	14,13%	23,94%
DELTA CRED PRIV FIC FI RF	69.653,07	0,05%	NOVERO	5,36%	0,04%	0,48%	1,97%	3,82%	3,15%	3,33%	-49,49%	-57,09%
TREK FI RF CRED PRIV IMOB.	365.838,01	0,24%	NOVERO	1,44%		-0,12%	-0,52%	-0,87%	-0,74%	-1,51%	0,04%	-0,72%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
Renda Variável	16.421.917,09	10,93%				6,39%	6,66%	0,74%	3,69%	0,13%	-17,46%	14,36%
Benchmark:	IBOVESPA					3,74%	3,24%	-3,69%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%
Renda Variável	16.421.917,09	10,93%			2,22%							
BRASIL CAPITAL 30 INSTIT. FIC FIA	4.427.998,08	2,95%	BC GESTAO	3,14%	13,00%	8,47%	10,34%	4,45%	7,27%	3,22%	-20,04%	14,18%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	5.206.856,54	3,47%	CONSTANCIA	0,44%	2,35%	6,03%	6,12%	0,12%	3,40%	-3,47%	-11,08%	22,76%
MANTARO AÇÕES FIC FIA	4.397.213,22	2,93%	PACIFICO	4,09%	10,00%	5,86%	5,72%	0,42%	3,33%	3,70%	-21,97%	8,70%
SANTANDER FI IBOV ATIVO INSTIT. AÇÕES	2.389.849,25	1,59%	SANTANDER	0,90%	9,20%	4,46%	3,13%	-3,74%	-1,15%	-3,49%	-15,44%	15,11%
Benchmark:	IBOVESPA					3,74%	3,24%	-3,69%	-1,28%	-2,71%	-14,17%	23,95%
Total	150.181.912,31	100%			1,51%	1,88%	3,80%	5,47%	5,07%	10,08%	14,79%	25,17%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					0,71%	2,56%	5,58%	4,49%	7,97%	25,75%	42,52%

* 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.

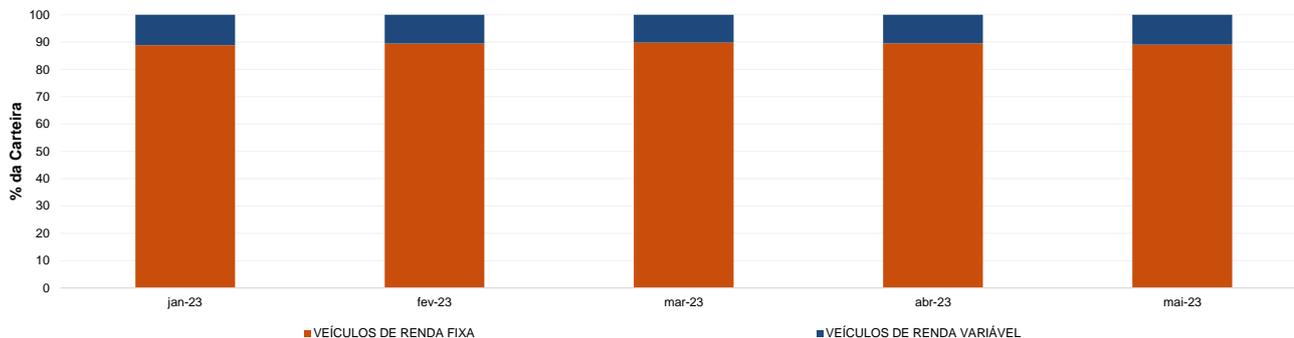
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

Este 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.

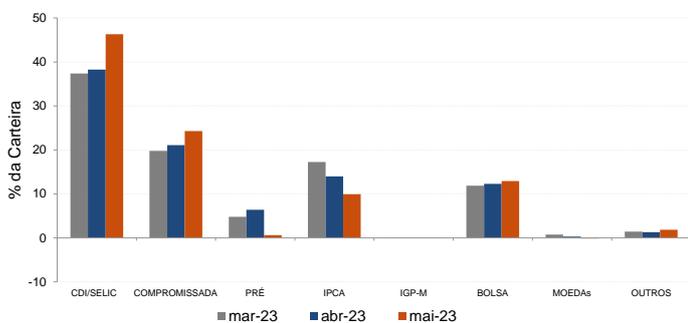
Distribuição da Carteira

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.

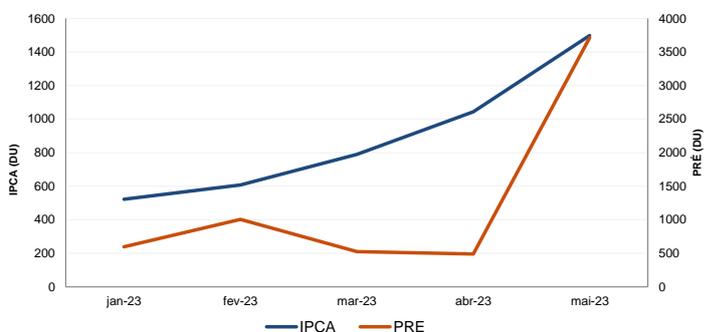
Evolução do Patrimônio Líquido



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	959,88	5,37	1.038,49	5,86
EQTL3	Energia Elétrica	879,67	4,92	867,47	4,89
BPAC11	Intermediários Financeiros	733,73	4,10	687,98	3,88
RENT3	Diversos	722,59	4,04	687,74	3,88
VALE3	Mineração	675,54	3,78	832,91	4,70
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	599,01	3,35	548,86	3,10
HAPV3	Análises e Diagnósticos	562,47	3,15	451,43	2,55
RAIL3	Transporte	560,55	3,13	568,97	3,21
BBAS3	Intermediários Financeiros	547,71	3,06	599,16	3,38
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	461,70	2,58	450,50	2,54

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

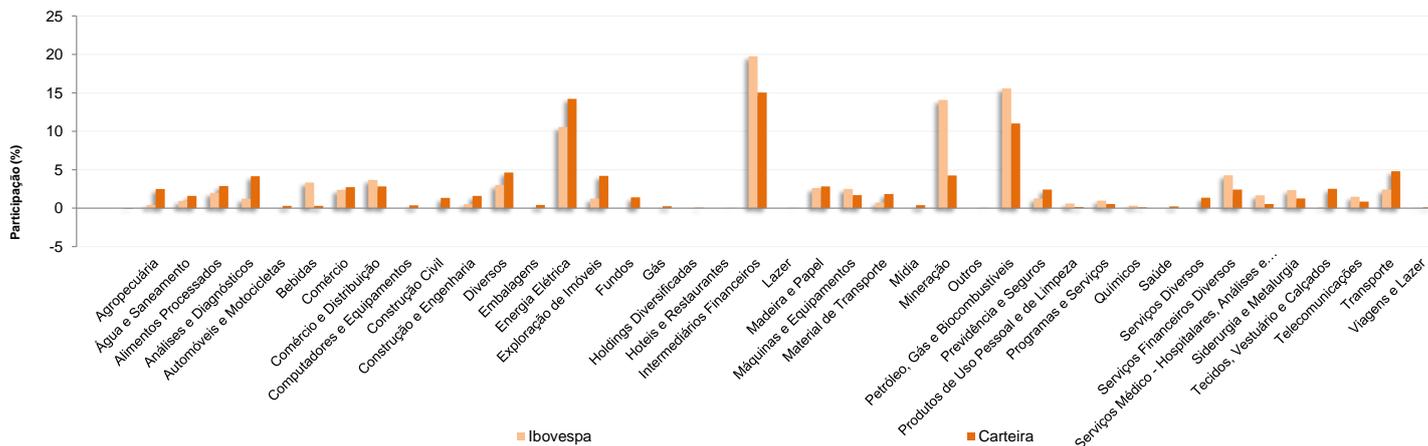
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PASS12	46,27	0,26	0,00	Sem Liquidez
PARD3	9,90	0,06	0,00	Sem Liquidez
GETT11	0,06	0,00	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	6,70	0,04	0,01	11
MTSA4	24,75	0,14	0,03	2
ITUB4	959,88	5,37	0,00	1
EQTL3	879,67	4,92	0,00	1
BPAC11	733,73	4,10	0,00	1
RENT3	722,59	4,04	0,00	1
VALE3	675,54	3,78	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

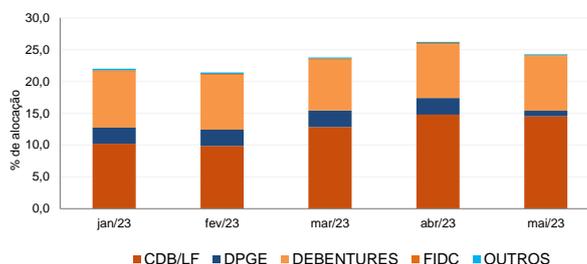
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BANCO VOTORANTIM S.A.	3.056,47	2,07	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	2.529,62	1,71	Faixa 1
BCO ITAU SA	2.174,81	1,47	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	2.125,33	1,44	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.590,69	1,07	Faixa 1
NCF PARTICIPACOES SA	1.513,88	1,02	Faixa 2
BCO BRASIL SA	1.453,84	0,98	Faixa 2
BCO VOLKSWAGEN SA	1.438,91	0,97	Faixa 1
BCO SAFRA SA	1.348,51	0,91	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA	1.337,49	0,90	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
CLII12	1,97	CORREDOR LOGÍSTICA E INFRAESTRUTURA S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	10-out-31	CDI	3,50%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/05/2023

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	29-jul-24	951.018	0,64%	CDI	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	24-mai-23	0,70%	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
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	428.166	0,29%	IPCA	25-mai-23	7,41%	7,53%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	244.328	0,17%	IPCA	24-mai-23	5,68%	5,55%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	77.156	0,05%	IPCA	09-mai-23	5,67%	5,59%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2033-05-15	15-mai-33	248.497	0,17%	IPCA	12-mai-23	17,63%	0,00%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	12.926	0,01%	IPCA	09-mai-23	5,98%	6,00%	MAG OABPREV GO FI MULT

