

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 30/11/2023

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	140.719.884,99	88,29%				1,51%	2,70%	6,12%	11,67%	12,55%	25,80%	31,45%
Benchmark:	CDI					0,92%	2,92%	6,33%	12,04%	13,30%	26,87%	31,66%
Multimercados Institucionais	131.750.113,69	82,66%			0,42%							
MAG OABPREV GO FI MULT	65.935.021,20	41,37%	MONGERAL AEGON	100%	0,37%	1,33%	3,12%	6,67%	11,80%	12,77%	27,30%	34,95%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	65.815.092,49	41,29%	VINCI	100%	0,55%	1,59%	2,55%	5,94%	11,46%	12,36%	25,48%	30,42%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,08%	3,41%	7,39%	14,08%	15,56%	31,98%	39,68%
Renda Fixa	8.969.771,30	5,63%			2,34%							
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES FIC FI	1.102.036,32	0,69%	ITAÚ	0,00%	0,02%	0,90%	2,88%	6,29%	11,96%	13,20%	26,74%	31,54%
ITAÚ RF IMA-B ATIVO FIC FI	7.433.156,52	4,66%	ITAÚ	1,56%	2,82%	2,59%	0,36%	3,24%	12,46%	12,18%	18,11%	22,02%
DELTA CRED PRIV FIC FI RF	71.483,73	0,04%	TREK INVESTIMENTOS	5,36%	0,02%	0,37%	1,26%	2,63%	5,86%	6,55%	15,94%	-54,27%
TREK FI RF CRED PRIV IMOB.	363.094,73	0,23%	TREK INVESTIMENTOS	1,44%		-0,15%	-0,35%	-0,75%	-1,49%	-1,61%	-3,02%	-1,39%
Benchmark:	CDI					0,92%	2,92%	6,33%	12,04%	13,30%	26,87%	31,66%
Renda Variável	18.670.157,69	11,71%				11,50%	5,41%	13,69%	17,89%	14,53%	18,99%	4,83%
Benchmark:	IBOVESPA					12,54%	10,01%	17,53%	16,04%	13,20%	24,94%	16,93%
Renda Variável	18.670.157,69	11,71%			2,63%							
BRASIL CAPITAL 30 INSTIT. FIC FIA	5.105.136,26	3,20%	BC GESTAO	5,42%	11,93%	12,33%	4,26%	15,29%	23,67%	20,42%	20,02%	1,47%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	5.654.684,18	3,55%	CONSTANCIA	0,42%	2,22%	10,25%	4,04%	8,60%	12,29%	8,74%	18,21%	14,99%
MANTARO ACOES FIC FIA	5.116.130,80	3,21%	PACIFICO	4,25%	9,70%	11,36%	6,05%	16,35%	20,22%	16,84%	19,15%	3,34%
SANTANDER FI IBOV ATIVO INSTIT. ACOES	2.794.206,45	1,75%	SANTANDER	1,12%	9,55%	12,78%	9,27%	16,92%	15,57%	12,55%	22,79%	10,98%
Benchmark:	IBOVESPA					12,54%	10,01%	17,53%	16,04%	13,20%	24,94%	16,93%
Total	159.390.042,68	100%			1,57%	2,59%	3,01%	6,95%	12,38%	12,80%	24,94%	27,36%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					0,42%	1,31%	2,37%	6,97%	8,08%	19,22%	37,66%

* 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.

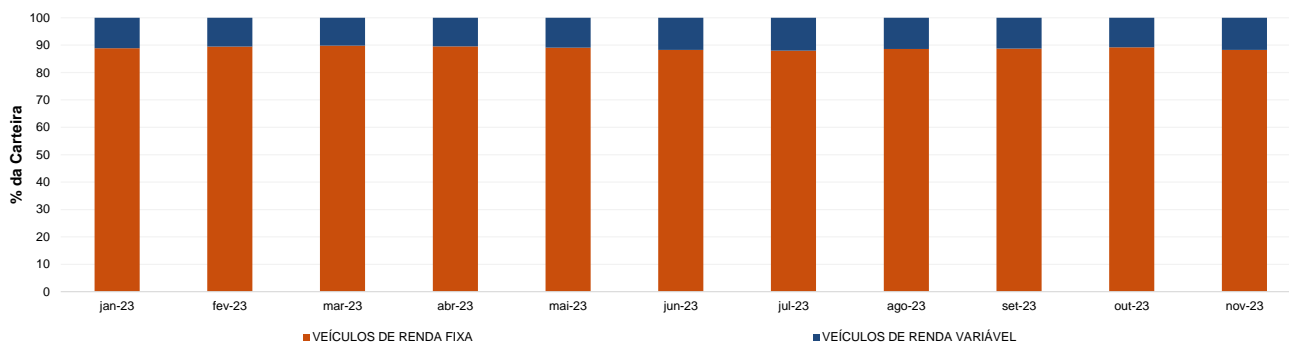
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

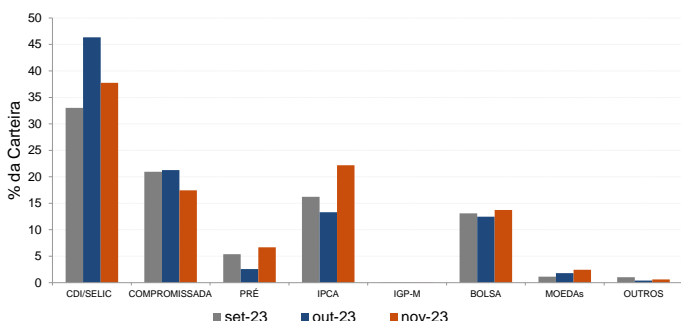
Distribuição da Carteira

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.

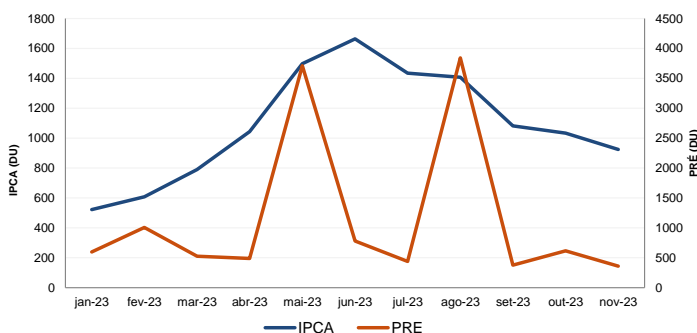
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
EQTL3	Energia Elétrica	1.264,00	5,92	1.182,19	6,17
ITUB4	Intermediários Financeiros	1.252,37	5,87	1.117,11	5,83
VALE3	Mineração	1.188,11	5,57	967,13	5,05
RENT3	Diversos	1.027,61	4,82	736,29	3,84
BPAC11	Intermediários Financeiros	887,88	4,16	771,68	4,03
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	835,23	3,91	712,54	3,72
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	720,16	3,38	642,32	3,35
RAIL3	Transporte	607,52	2,85	674,67	3,52
BBAS3	Intermediários Financeiros	584,71	2,74	531,44	2,77
ELET3	Energia Elétrica	453,43	2,13	304,02	1,59

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

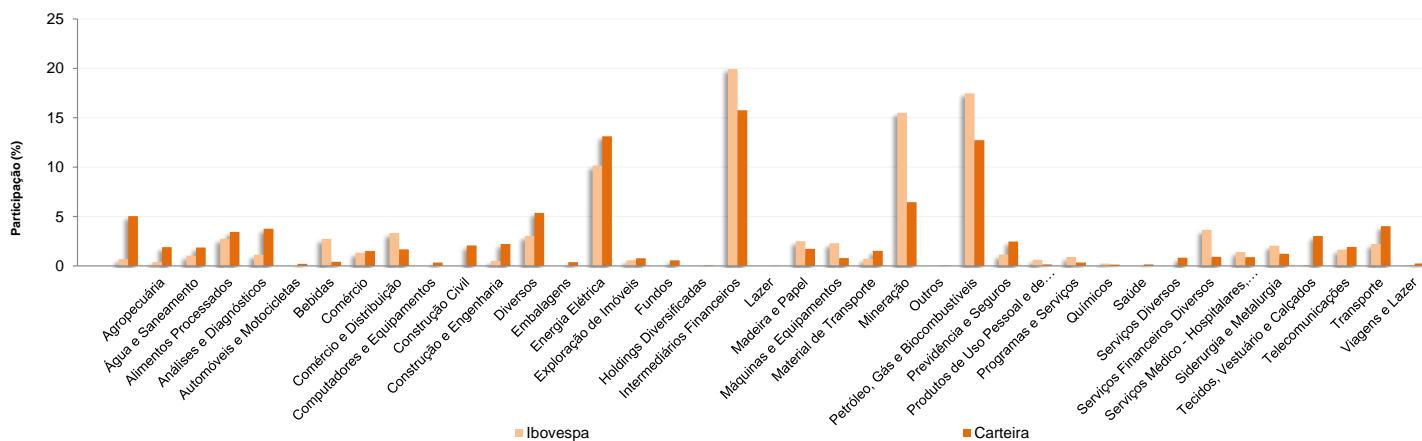
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
ALSO3	0,79	0,00	0,00	Sem Liquidez
ENBR3	0,45	0,00	0,00	Sem Liquidez
BOAS3	0,37	0,00	0,00	Sem Liquidez
BRPR3	0,00	0,00	0,00	Sem Liquidez
VIIA3	-0,05	0,00	0,00	Sem Liquidez
MODL3	-0,10	0,00	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	6,64	0,03	0,01	3
OFSA3	34,19	0,16	0,02	2
EQTL3	1.264,00	5,92	0,00	1
ITUB4	1.252,37	5,87	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

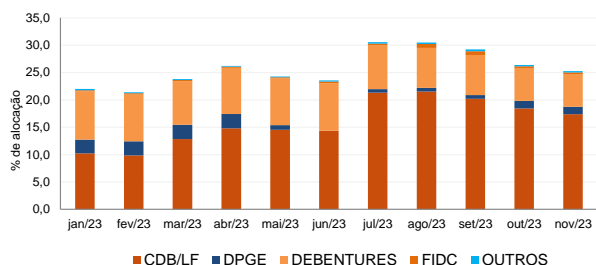
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	7.393,79	4,71	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	4.457,59	2,84	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	3.774,70	2,40	Faixa 1
BCO ITAU SA	2.316,38	1,47	Faixa 1
BANCO VOTORANTIM S.A.	1.907,62	1,21	Faixa 2
BCO BRASIL SA	1.463,38	0,93	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	1.450,25	0,92	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.405,09	0,89	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA	1.396,01	0,89	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	1.337,31	0,85	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
BBML13	1,57	BBM LOGISTICA SA	Faixa 5	Faixa 6	20-dez-26	CDI	6,98%	JGP CORP MASTER FI RF CRED PRIV LP
BBML13	8,06	BBM LOGISTICA SA	Faixa 5	Faixa 6	20-dez-26	CDI	4,80%	JGP CORP MASTER FI RF CRED PRIV LP
UGEL11	9,89	UNIGEL PARTICIPAÇÕES S.A.	Faixa 7	Faixa 8	08-abr-27	CDI	2,10%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 30/11/2023

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	31-dez-50	352.792	0,22%	CDI	ITAU UNIBANCO HOLDING SA	08-nov-23	1,90%	Faixa 1	MAG OABPREV GO FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2025-09-01	01-set-25	4.029.121	2,57%	Selic		29-nov-23	0,02%	0,02%	MAG OABPREV GO FI MULT
LFT 2028-03-01	01-mar-28	211.018	0,13%	Selic		08-nov-23	42,94%	0,14%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	2.319.963	1,48%	IPCA		23-nov-23	6,56%	6,58%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	252.902	0,16%	IPCA		01-nov-23	6,13%	6,05%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	214.324	0,14%	IPCA		23-nov-23	5,60%	5,60%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	747.240	0,48%	IPCA		20-nov-23	5,58%	5,59%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	194.369	0,12%	IPCA		23-nov-23	5,68%	5,58%	MAG OABPREV GO FI MULT