

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 29/04/2022

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.

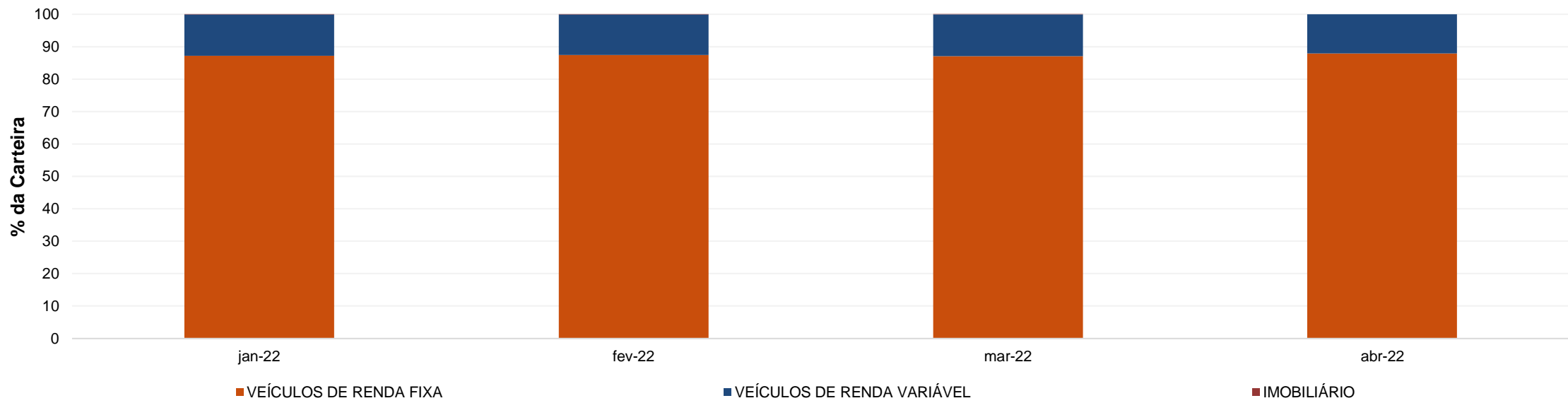
VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	118.012.199,04	87,97%			1,04%	3,64%	6,27%	4,46%	8,18%	13,74%	17,75%
Benchmark:	CDI				0,83%	2,53%	4,68%	3,28%	7,08%	9,38%	15,07%
Multimercados Institucionais	100.113.134,16	74,63%		0,54%							
MAG OABPREV GO FI MULT	47.924.859,69	35,73%	MONGERAL AEGON	100%	1,11%	3,58%	6,59%	4,53%	10,53%	16,72%	19,68%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	52.188.274,47	38,90%	VINCI	100%	1,07%	3,79%	6,15%	4,74%	7,03%	13,47%	20,93%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				0,98%	3,01%	5,70%	3,94%	9,21%	13,77%	22,09%
Renda Fixa	17.899.064,88	13,34%		0,96%							
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	10.915.102,16	8,14%	ITAU	0,04%	0,07%	0,77%	2,51%	4,68%	3,28%	7,17%	9,09%
ITAU RF IMA-B ATIVO FC	6.544.823,17	4,88%	ITAU	1,50%	2,64%	0,74%	5,05%	8,04%	3,91%	5,12%	14,45%
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	372.136,97	0,28%	NOVERO	1,44%	-0,11%	-0,34%	-0,72%	-0,48%	1,64%	0,80%	0,47%
DELTA CRED PRIV FC FIRF	67.002,58	0,05%	NOVERO	5,36%	0,74%	4,69%	6,55%	9,58%	7,54%	-51,49%	-58,71%
Benchmark:	CDI				0,83%	2,53%	4,68%	3,28%	7,08%	9,38%	15,07%
Renda Variável	16.131.585,65	12,03%			-7,20%	-3,11%	1,59%	1,58%	-15,28%	21,68%	9,70%
Benchmark:	IBOVESPA				-10,10%	-3,81%	4,23%	2,91%	-9,27%	34,00%	11,96%
Renda Variável	16.131.585,65	12,03%		2,99%							
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	4.246.268,15	3,17%	BC GESTAO	1,07%	8,72%	-9,44%	-6,69%	-3,63%	-2,67%	-22,36%	17,86%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	5.254.160,50	3,92%	CONSTANCIA	0,44%	4,03%	-3,83%	2,52%	9,33%	6,50%	-6,36%	31,50%
PACIFICO ACOES FQ FIA	4.230.069,41	3,15%	PACIFICO	2,43%	8,33%	-7,28%	-5,42%	-6,63%	-0,34%	-22,53%	15,17%
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2.401.087,59	1,79%	SANTANDER	0,61%	8,63%	-10,06%	-4,01%	3,74%	2,58%	-10,00%	24,83%
Benchmark:	IBOVESPA				-10,10%	-3,81%	4,23%	2,91%	-9,27%	34,00%	11,96%
Total	134.143.784,69	100%			1,35%	-0,03%	2,73%	5,62%	4,04%	4,42%	14,10%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.				1,35%	4,79%	8,25%	5,85%	17,05%	31,04%	39,78%

* 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.

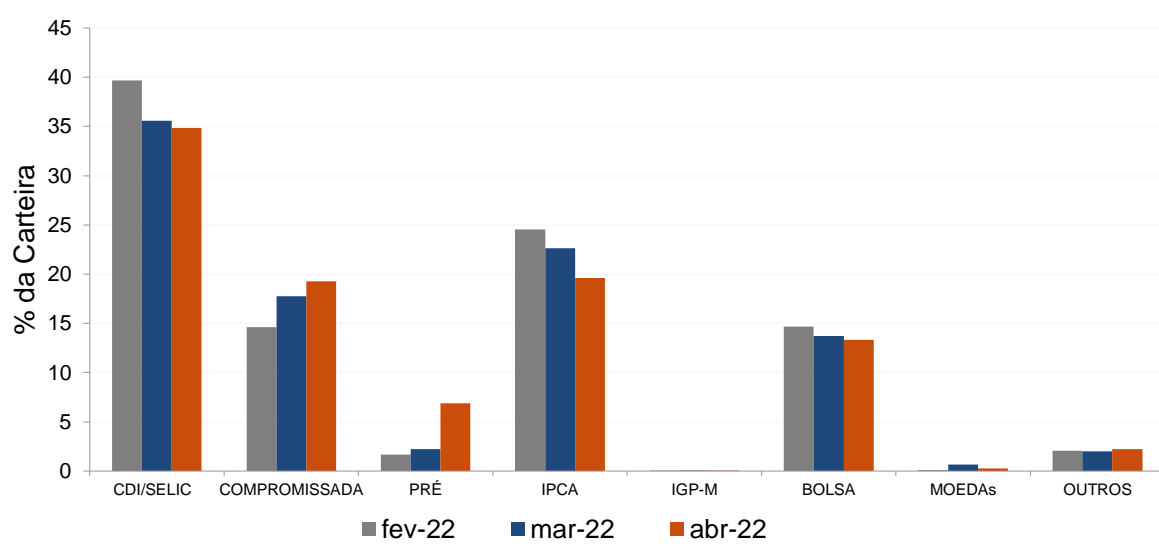
Distribuição da Carteira

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.

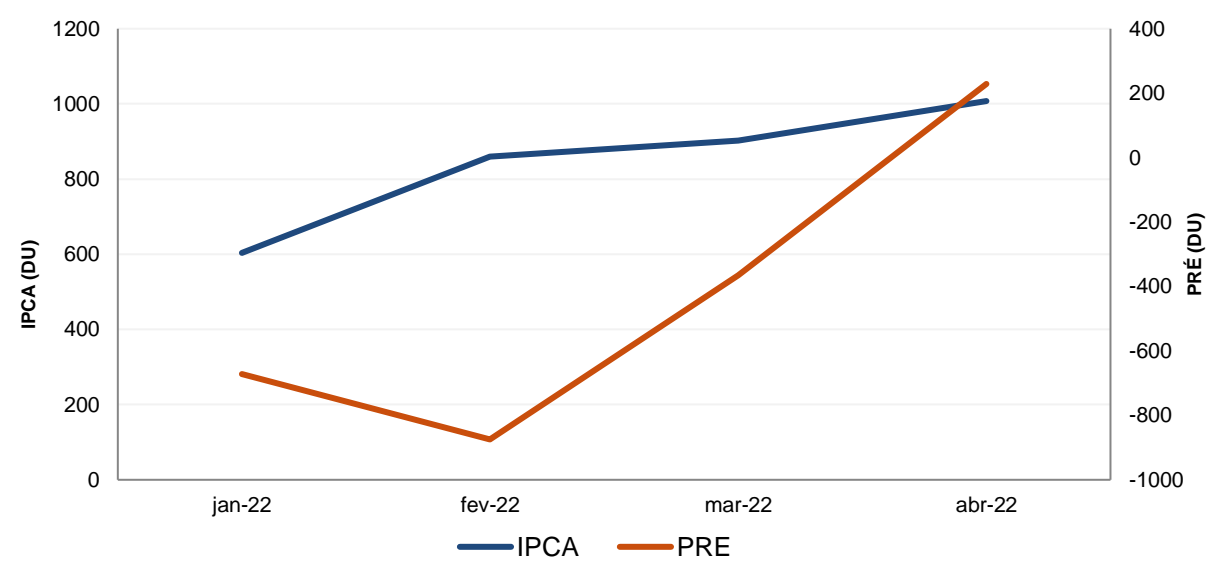
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	817,83	4,60	819,13	4,26
VALE3	Mineração	742,74	4,18	731,16	3,80
EQTL3	Energia Elétrica	714,85	4,02	802,31	4,17
ITUB4	Intermediários Financeiros	629,37	3,54	696,21	3,62
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	546,25	3,07	497,98	2,59
BPAC11	Intermediários Financeiros	492,52	2,77	585,62	3,05
HAPV3	Análises e Diagnósticos	439,27	2,47	785,02	4,08
LCAM3	Diversos	432,37	2,43	500,58	2,60
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	424,29	2,39	356,52	1,85
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	417,45	2,35	378,55	1,97

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

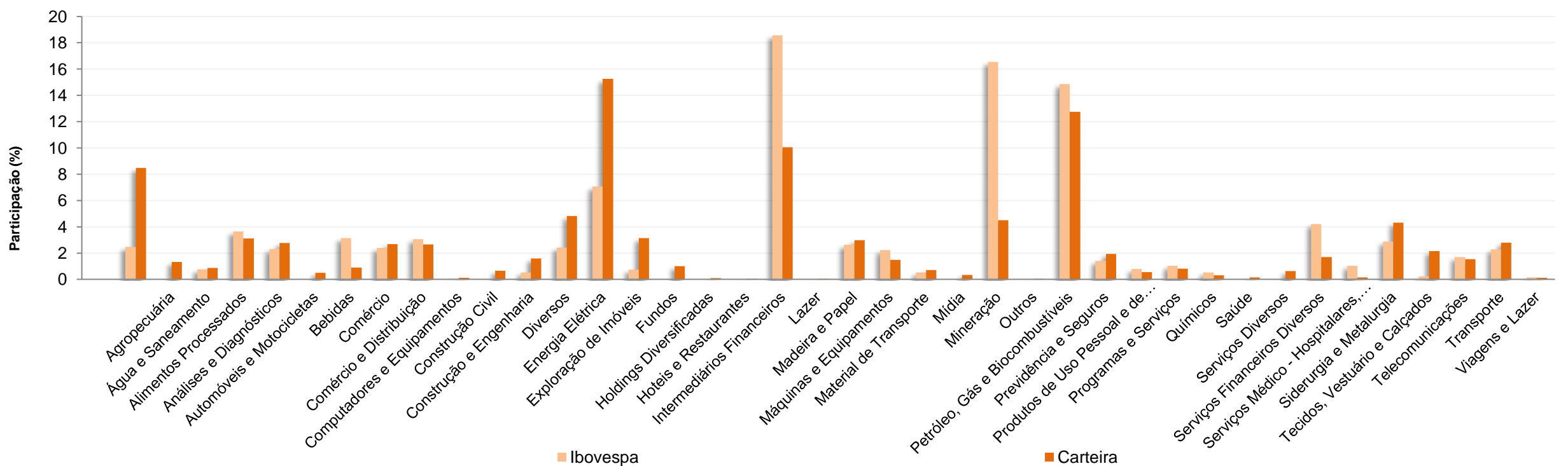
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PASS12	24,55	0,14	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	5,76	0,03	0,01	6
MTSA4	26,72	0,15	0,02	3
GEPA4	5,52	0,03	0,01	2
PETR4	817,83	4,60	0,00	1
VALE3	742,74	4,18	0,00	1
EQTL3	714,85	4,02	0,00	1
ITUB4	629,37	3,54	0,00	1
CSAN3	546,25	3,07	0,00	1
BPAC11	492,52	2,77	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

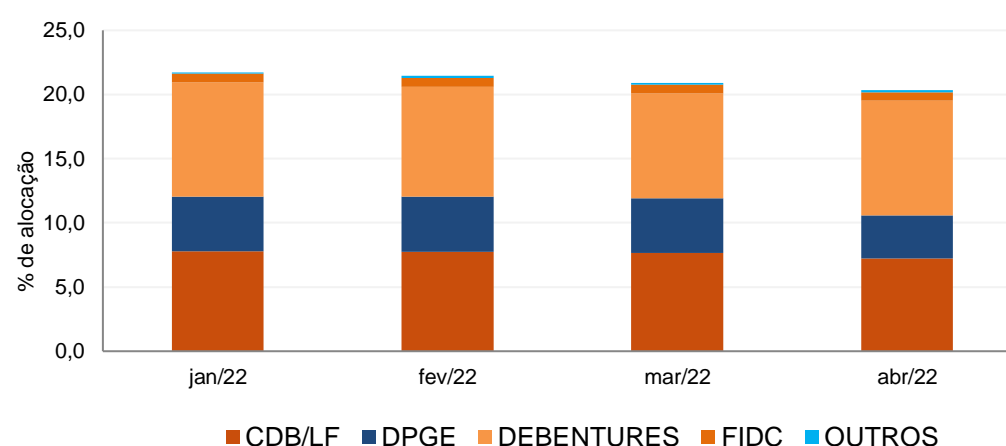
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO SAFRA SA	2.844,07	2,11	Faixa 1
BANCO C6 S.A.	2.362,88	1,75	Sem Faixa
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.691,38	1,25	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	1.332,15	0,99	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	1.318,55	0,98	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.230,14	0,91	Faixa 2
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	1.156,68	0,86	Faixa 1
BANCO AGIBANK S.A.	1.091,62	0,81	Faixa 4
BCO MODAL SA	1.080,13	0,80	Faixa 3
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	1.078,73	0,80	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
CMDT33	0,00	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	5,13%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
CMDT33	0,02	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	5,13%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
CMDT33	0,07	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	5,13%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
CMDT33	0,08	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	3,02%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
CMDT33	0,02	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	3,44%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
CMDT33	0,00	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	3,74%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
CMDT33	0,02	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	3,64%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
CMDT33	0,12	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	3,42%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
CMDT33	6,70	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-fev-25	IPCA	4,41%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
DESK13	30,04	DESKTOP S.A.	Sem Faixa	Faixa 3	17-nov-28	CDI	2,71%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
DESK13	17,53	DESKTOP S.A.	Sem Faixa	Faixa 3	17-nov-28	CDI	2,60%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
IRJS12	6,64	IGUÁ RIO DE JANEIRO S.A.	Sem Faixa	Faixa 3	31-jul-25	CDI	3,80%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
LMT115	0,10	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO CC	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	1,94%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
LMT115	22,41	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO CC	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	2,60%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
LMT115	1,43	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO CC	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	2,60%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
LMT115	16,36	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO CC	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	2,60%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
LMT115	0,09	LM TRANSPORTE INTERESTADUAIS SERVICO CC	Faixa 3	Faixa 2	28-mai-25	CDI	2,07%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
VCCS11	9,58	VERT CREDIARE COMPANHIA SECURITIZADORA	Sem Faixa	Faixa 1	16-abr-29	CDI	1,95%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP



OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 29/04/2022

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
BKBR19	24-abr-27	226.674	0,17%	CDI	BK BRASIL OPERACAO ASSESSORIA REE	28-abr-22	1,96%	Faixa 2	MAG OABPREV GO FI MULT
LIGHB4	15-abr-24	519.585	0,39%	CDI	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	26-abr-22	2,13%	Faixa 2	MAG OABPREV GO FI MULT
VVAR27	15-set-26	320.996	0,24%	CDI	VIA SA	13-abr-22	2,75%	Faixa 2	MAG OABPREV GO FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.159.546	0,86%	Selic		22-abr-22	4,00%	0,05%	MAG OABPREV GO FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	2.317.761	1,72%	Selic		29-abr-22	0,11%	0,08%	MAG OABPREV GO FI MULT
LFT 2025-03-01	01-mar-25	1.733.400	1,29%	Selic		06-abr-22	0,00%	0,06%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	433.992	0,32%	IPCA		12-abr-22	5,55%	5,57%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	237.467	0,18%	IPCA		04-abr-22	5,30%	5,24%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	225.184	0,17%	IPCA		11-abr-22	5,40%	5,54%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P

