

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 25/02/2022

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	114.969.367,85	87,49%				0,92%	2,39%	3,81%	1,71%	5,97%	9,27%	15,85%
Benchmark:	CDI					0,75%	2,26%	3,81%	1,49%	5,65%	8,15%	14,19%
Multimercados Institucionais	97.462.627,31	74,17%			0,33%							
MAG OABPREV GO FI MULT	46.764.169,63	35,59%	MONGERAL AEGON	100%	0,41%	1,07%	3,11%	5,24%	2,00%	8,09%	11,68%	18,19%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	50.698.457,68	38,58%	VINCI	100%	0,33%	0,83%	2,11%	3,14%	1,75%	5,06%	10,21%	18,47%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,90%	2,77%	4,83%	1,81%	7,77%	12,50%	21,15%
Renda Fixa	17.506.740,54	13,32%			0,70%							
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	10.793.174,17	8,21%	ITAU	0,04%	0,05%	0,81%	2,34%	3,92%	1,57%	5,70%	7,91%	13,76%
ITAU RF IMA-B ATIVO FC	6.277.182,31	4,78%	ITAU	1,43%	1,91%	0,76%	-0,26%	0,29%	-0,34%	0,88%	4,64%	25,18%
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	372.993,08	0,28%	NOVERO	1,44%		-0,11%	-0,38%	-0,72%	-0,25%	1,64%	5,76%	0,51%
DELTA CRED PRIV FC FIRF	63.390,98	0,05%	NOVERO	5,36%	0,83%	0,81%	2,82%	-53,82%	1,74%	-54,32%	-92,84%	-95,05%
Benchmark:	CDI					0,75%	2,26%	3,81%	1,49%	5,65%	8,15%	14,19%
Renda Variável	16.423.357,13	12,50%				-1,36%	4,67%	-11,46%	3,41%	-7,56%	-8,65%	12,15%
Benchmark:	IBOVESPA					0,89%	11,02%	-4,75%	7,94%	2,82%	8,61%	18,37%
Renda Variável	16.423.357,13	12,50%			2,95%							
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	4.390.990,71	3,34%	BC GESTAO	1,02%	8,85%	-3,51%	3,23%	-18,98%	0,65%	-17,87%	-14,46%	11,41%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	5.075.141,57	3,86%	CONSTANCIA	0,43%	9,00%	-0,97%	6,10%	-6,36%	2,87%	3,76%	-5,33%	24,70%
PACIFICO ACOES FQ FIA	4.434.191,91	3,37%	PACIFICO	2,07%	13,82%	-0,86%	3,27%	-17,02%	4,47%	-16,62%	-6,87%	22,61%
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2.523.032,93	1,92%	SANTANDER	0,59%	7,04%	0,86%	10,88%	-5,08%	7,79%	1,44%	-2,40%	8,19%
Benchmark:	IBOVESPA					0,89%	11,02%	-4,75%	7,94%	2,82%	8,61%	18,37%
Imobiliário	15.941,08	0,01%				-81,35%	-81,74%	-95,20%	-81,53%	-95,25%		
Benchmark:	INPC					1,00%	2,42%	5,73%	1,68%	10,80%	17,68%	22,30%
FII	15.941,08	0,01%										
SAO FRANCISCO 34 FII-SUBORDINA	15.941,08	0,01%	CULTINVEST	0,18%		-81,35%	-81,74%	-95,20%	-81,53%	-95,25%	-	-
Benchmark:	IFIX					-1,29%	6,31%	-0,32%	-2,27%	-5,04%	-7,51%	12,59%
Total	131.408.666,06	100%				1,30%	0,58%	2,61%	1,37%	1,86%	3,81%	6,45%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					1,31%	3,45%	7,84%	2,33%	15,35%	27,47%	37,86%

* 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.

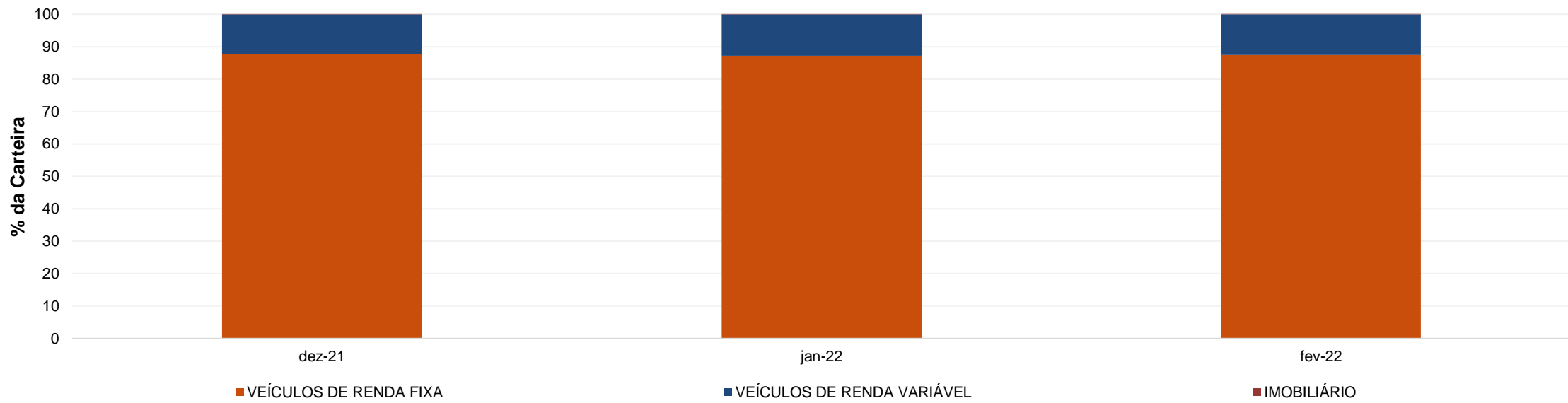
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

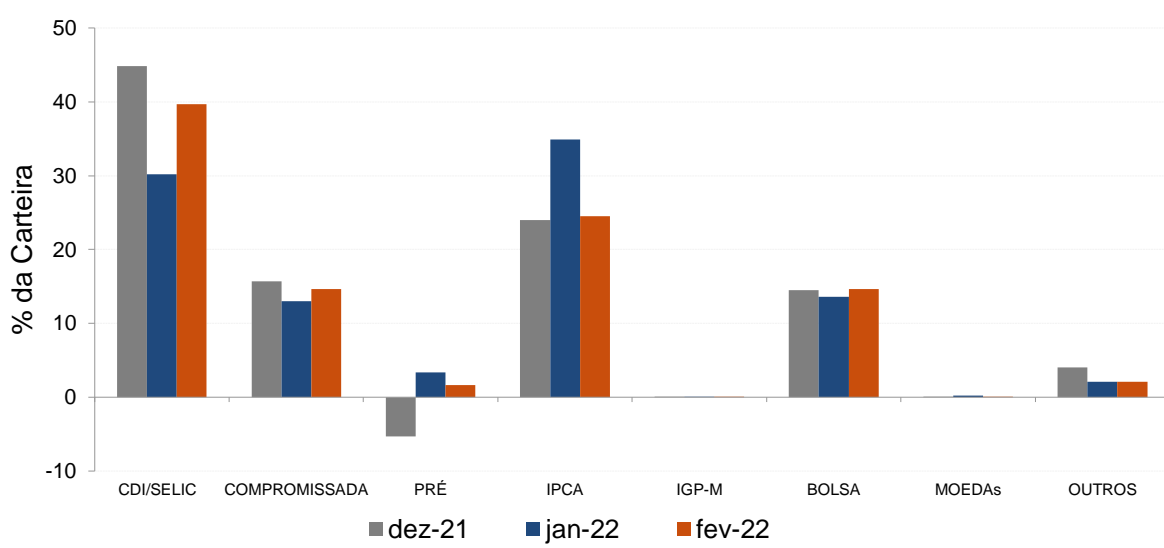
Distribuição da Carteira

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.

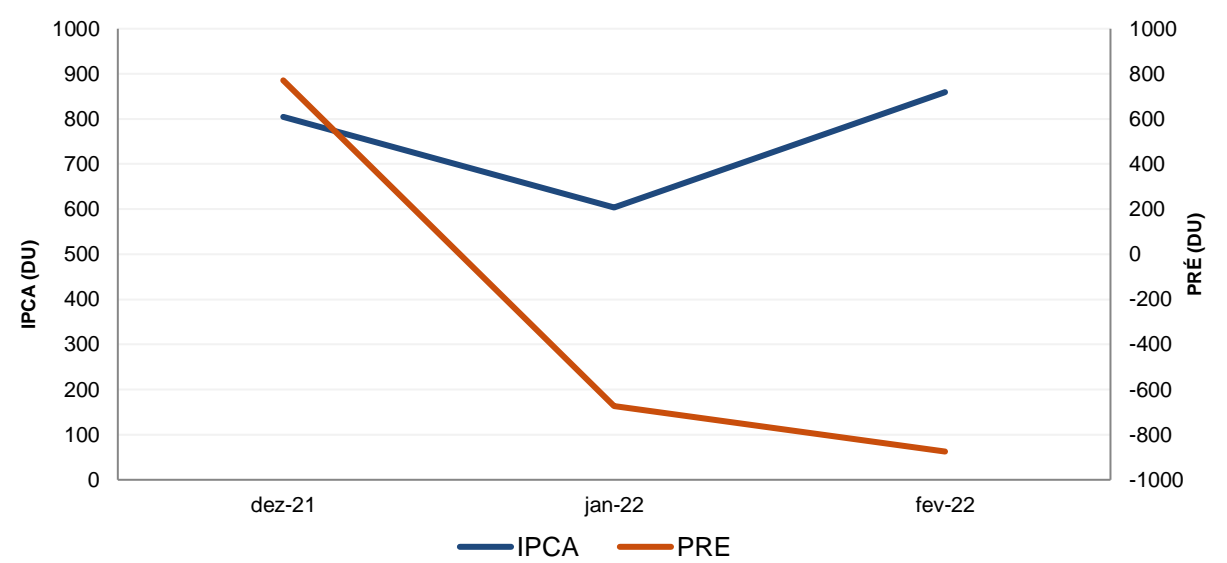
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	859,25	4,71	860,65	4,63
HAPV3	Análises e Diagnósticos	791,30	4,34	94,33	0,51
EQTL3	Energia Elétrica	709,68	3,89	446,49	2,40
VALE3	Mineração	701,86	3,85	616,79	3,32
SUZB3	Madeira e Papel	631,42	3,46	698,38	3,76
ITUB4	Intermediários Financeiros	586,26	3,22	430,96	2,32
BPAC11	Intermediários Financeiros	567,07	3,11	558,79	3,01
RENT3	Diversos	505,19	2,77	546,27	2,94
LCAM3	Diversos	437,98	2,40	421,68	2,27
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	433,35	2,38	538,30	2,90

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

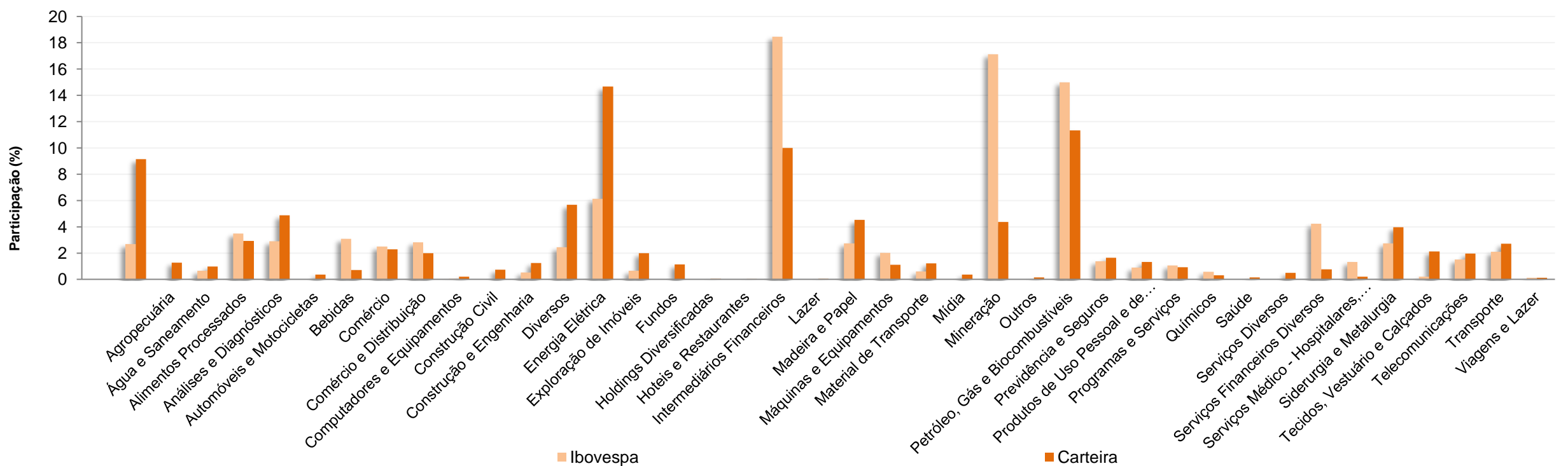
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PASS12	21,74	0,12	0,00	Sem Liquidez
MTSA4	25,24	0,14	0,02	2
SCAR3	19,01	0,10	0,00	2
GEPA4	6,11	0,03	0,01	2
CRIV4	5,80	0,03	0,01	2
PETR4	859,25	4,71	0,00	1
HAPV3	791,30	4,34	0,00	1
EQTL3	709,68	3,89	0,00	1
VALE3	701,86	3,85	0,00	1
SUZB3	631,42	3,46	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

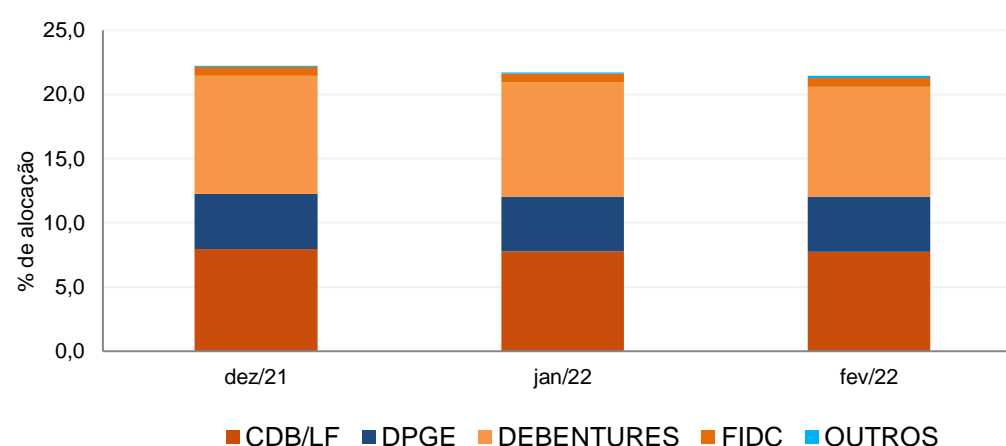
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO SAFRA SA	2.767,46	2,10	Faixa 1
BANCO AGIBANK S.A.	2.317,77	1,76	Faixa 4
BANCO C6 S.A.	2.283,60	1,73	Sem Faixa
BANCO RCI BRASIL SA	1.938,78	1,47	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.629,69	1,24	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	1.315,58	1,00	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	1.296,86	0,98	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.135,28	0,86	Faixa 2
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	1.089,92	0,83	Faixa 1
BCO MODAL SA	1.056,31	0,80	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
BCBF15	8,76	BCBF PARTICIPACOES S.A	Faixa 2	Faixa 1	04-nov-25	CDI	2,65%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
BCBF15	19,10	BCBF PARTICIPACOES S.A	Faixa 2	Faixa 1	04-nov-25	CDI	1,98%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
BCBF15	8,29	BCBF PARTICIPACOES S.A	Faixa 2	Faixa 1	04-nov-25	CDI	2,01%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
BCBF15	2,15	BCBF PARTICIPACOES S.A	Faixa 2	Faixa 1	04-nov-25	CDI	1,98%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
BCBF16	55,71	BCBF PARTICIPACOES S.A	Faixa 2	Faixa 1	07-out-27	CDI	1,45%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
IGSN15	3,87	IGUA SANEAMENTO SA	Faixa 2	Faixa 3	15-jul-34	IPCA	5,42%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
MEAL12	1,41	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	4,77%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
MEAL12	1,41	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	4,77%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
MEAL12	0,41	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	4,78%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
MEAL12	0,41	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO	Faixa 5	Faixa 4	10-set-25	CDI	4,78%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
MEAL21	3,90	INTERNATIONAL MEAL COMPANY ALIMENTACAO	Faixa 5	Faixa 4	15-mar-26	CDI	17,44%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
PASN12	11,33	PARANAGUA SANEAMENTO SA	Faixa 2	Faixa 3	15-jul-30	IPCA	6,99%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
POSI12	2,90	POSITIVO INFORMATICA SA	Faixa 4	Sem Faixa	25-fev-25	CDI	3,62%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
POSI12	6,45	POSITIVO INFORMATICA SA	Faixa 4	Sem Faixa	25-fev-25	CDI	4,55%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
POSI12	3,70	POSITIVO INFORMATICA SA	Faixa 4	Sem Faixa	25-fev-25	CDI	4,68%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
SBFC11	0,13	SBF COM PRODUTOS ESPORTIVOS LTDA	Faixa 3	Faixa 2	29-jun-24	CDI	2,75%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
SBFC11	7,78	SBF COM PRODUTOS ESPORTIVOS LTDA	Faixa 3	Faixa 2	29-jun-24	CDI	3,02%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
SBFC12	30,64	SBF COM PRODUTOS ESPORTIVOS LTDA	Faixa 3	Faixa 2	25-mai-25	CDI	2,31%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
SBFC12	5,42	SBF COM PRODUTOS ESPORTIVOS LTDA	Faixa 3	Faixa 2	25-mai-25	CDI	2,41%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR



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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.857.320	1,41%	Selic	25-fev-22	6,00%	0,03%	MAG OABPREV GO FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.344.563	1,02%	Selic	24-fev-22	6,00%	0,03%	MAG OABPREV GO FI MULT
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.036.909	0,79%	Selic	25-fev-22	6,00%	0,03%	MAG OABPREV GO FI MULT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	1.803.864	1,37%	Selic	25-fev-22	0,12%	0,00%	MAG OABPREV GO FI MULT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	1.338.717	1,02%	Selic	24-fev-22	0,12%	0,00%	MAG OABPREV GO FI MULT
LFT 2026-03-01	01-mar-26	987.020	0,75%	Selic	24-fev-22	0,12%	0,00%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	832.686	0,63%	IPCA	09-fev-22	5,48%	5,48%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	324.474	0,25%	IPCA	16-fev-22	5,52%	5,45%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	187.648	0,14%	IPCA	18-fev-22	5,57%	5,54%	MAG OABPREV GO FI MULT

