

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/01/2022

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	114.268.431,28	87,23%				0,78%	2,65%	3,21%	0,78%	4,96%	8,39%	15,27%	
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%	
Multimercados Institucionais	96.548.419,15	73,70%			0,28%								
MAG OABPREV GO FI MULT	46.266.806,56	35,32%	MONGERAL AEGON	100%	0,31%	0,91%	2,90%	4,83%	0,91%	6,83%	10,31%	17,41%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	50.281.612,59	38,38%	VINCI	100%	0,37%	0,92%	2,28%	2,17%	0,92%	3,90%	9,31%	17,77%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,90%	2,61%	4,51%	0,90%	7,10%	11,99%	20,85%	
Renda Fixa	17.720.012,13	13,53%			0,87%								
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	11.053.808,33	8,44%	ITAU	0,04%	0,02%	0,75%	2,11%	3,52%	0,75%	4,95%	7,34%	13,38%	
ITAU RF IMA-B ATIVO FC	6.229.931,19	4,76%	ITAU	1,24%	2,47%	-1,09%	2,84%	-1,46%	-1,09%	-1,51%	4,58%	24,89%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	62.883,32	0,05%	NOVERO	5,36%	1,25%	0,92%	2,84%	-54,26%	0,92%	-54,79%	-92,90%	-95,10%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	373.389,29	0,29%	NOVERO	1,44%		-0,15%	-0,39%	-0,73%	-0,15%	1,65%	5,45%	-10,81%	
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%	
Renda Variável	16.649.502,58	12,71%				4,84%	8,60%	-9,89%	4,84%	-6,48%	-10,83%	14,58%	
Benchmark:	IBOVESPA					6,98%	8,35%	-7,93%	6,98%	-2,54%	-1,42%	15,14%	
Renda Variável	16.649.502,58	12,71%											
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	4.550.581,82	3,47%	BC GESTAO	1,00%	7,76%	4,31%	3,27%	-17,63%	4,31%	-16,45%	-17,28%	14,17%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	5.124.911,33	3,91%	CONSTANCIA	0,46%	6,99%	3,88%	6,64%	-8,47%	3,88%	2,09%	-9,60%	24,08%	
PACIFICO ACOES FQ FIA	4.472.581,78	3,41%	PACIFICO	2,04%	11,21%	5,37%	-1,28%	-18,23%	5,37%	-18,76%	-12,48%	21,93%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2.501.427,65	1,91%	SANTANDER	0,57%	6,69%	6,87%	8,07%	-8,36%	6,87%	-4,21%	-11,92%	5,27%	
Benchmark:	IBOVESPA					6,98%	8,35%	-7,93%	6,98%	-2,54%	-1,42%	15,14%	
Imobiliário	85.488,37	0,07%				-0,94%	-2,90%	-74,30%	-0,94%	-74,51%			
Benchmark:	INPC					0,67%	2,26%	5,61%	0,67%	10,60%	16,72%	21,74%	
FII	85.488,37	0,07%											
SAO FRANCISCO 34 FII-SUBORDINA	85.488,37	0,07%	CULTINVEST	0,96%		-0,94%	-2,90%	-74,30%	-0,94%	-74,51%	-	-	
Benchmark:	IFIX					-0,99%	3,78%	-1,67%	-0,99%	-3,56%	-9,76%	15,24%	
Total	131.003.422,23	100%				1,06%	1,28%	2,82%	0,52%	1,28%	2,52%	4,75%	14,02%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					1,01%	3,30%	7,76%	1,01%	15,12%	26,40%	37,25%	

* 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.

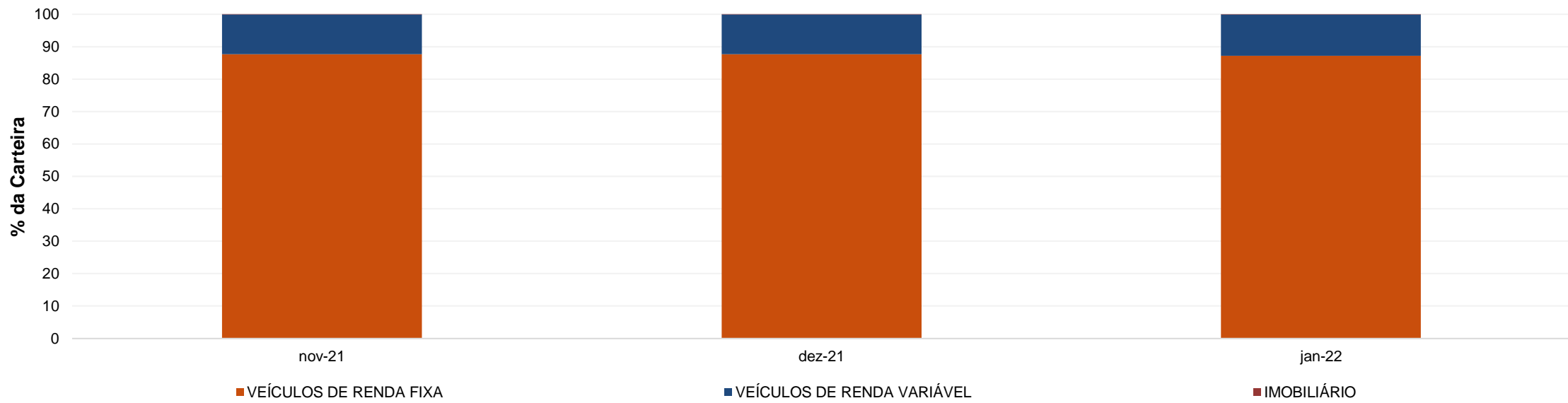
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

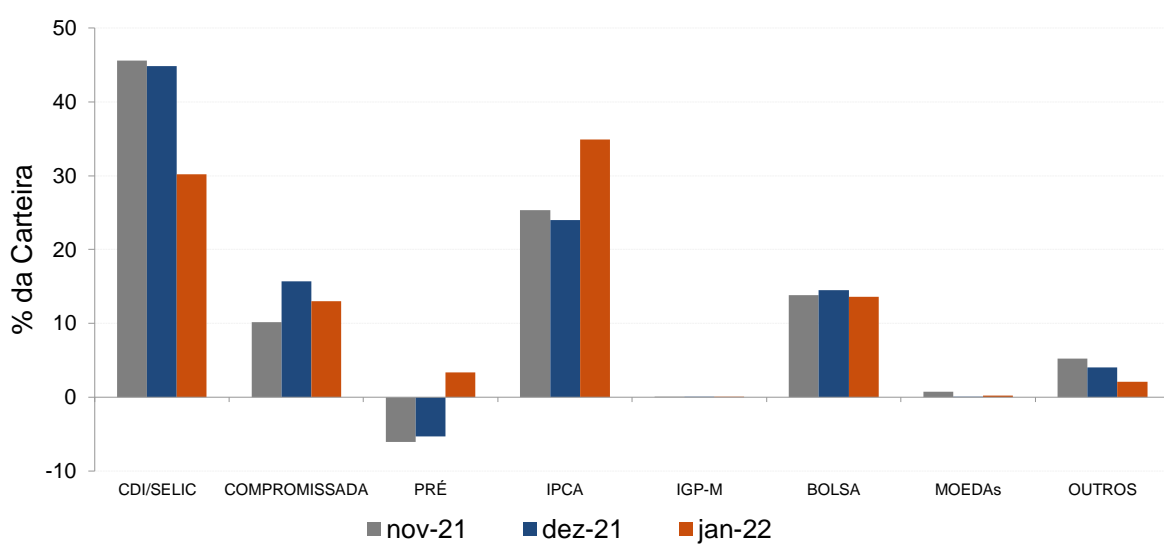
Distribuição da Carteira

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.

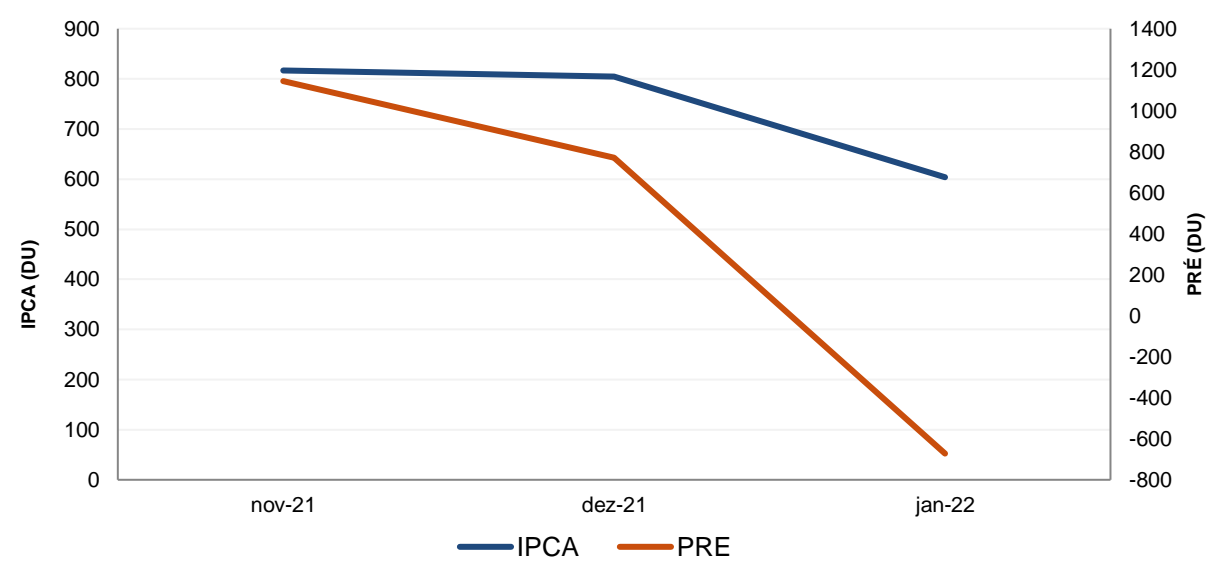
Evolução do Patrimônio Líquido



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	860,65	4,63	765,81	4,33
GNDI3	Análises e Diagnósticos	817,29	4,40	589,48	3,34
SUZB3	Madeira e Papel	698,38	3,76	681,04	3,85
VALE3	Mineração	616,79	3,32	584,82	3,31
BPAC11	Intermediários Financeiros	558,79	3,01	487,24	2,76
RENT3	Diversos	546,27	2,94	495,38	2,80
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	538,30	2,90	485,45	2,75
EQTL3	Energia Elétrica	446,49	2,40	478,58	2,71
ITUB4	Intermediários Financeiros	430,96	2,32	366,98	2,08
XP US		430,43	2,32	351,54	1,99

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

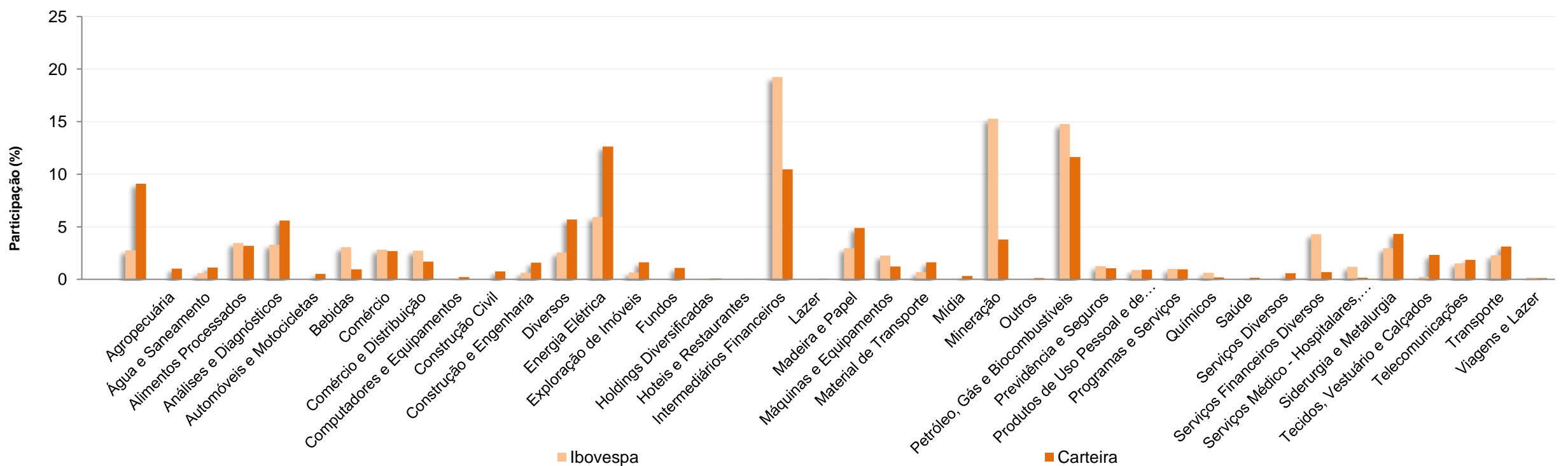
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PASS12	21,03	0,11	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	6,67	0,04	0,01	5
GEPA4	6,48	0,03	0,01	3
MTSA4	28,65	0,15	0,02	2
PETR4	860,65	4,63	0,00	1
GNDI3	817,29	4,40	0,00	1
SUZB3	698,38	3,76	0,00	1
VALE3	616,79	3,32	0,00	1
BPAC11	558,79	3,01	0,00	1
RENT3	546,27	2,94	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.



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.

Análises de Contrapartes

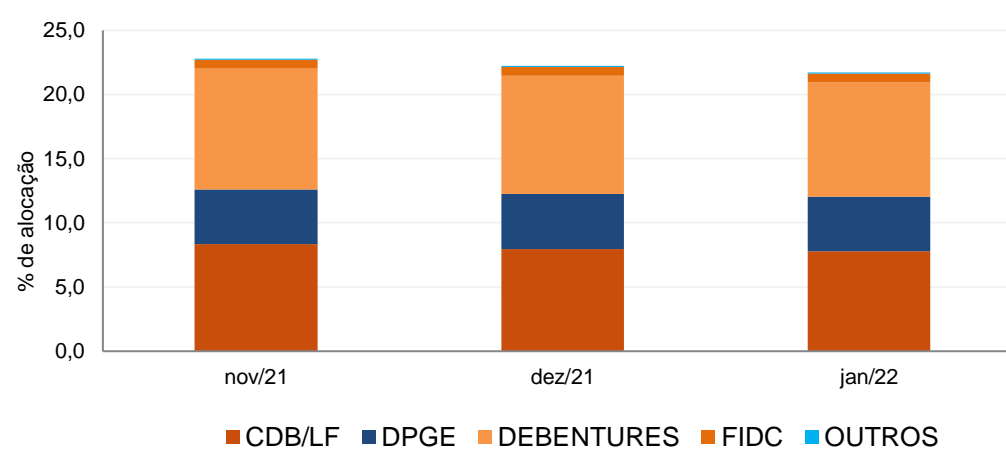
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO SAFRA SA	2.740,07	2,08	Faixa 1
BANCO AGIBANK S.A.	2.292,42	1,74	Faixa 4
BANCO C6 S.A.	2.257,41	1,71	Sem Faixa
BANCO RCI BRASIL SA	1.923,59	1,46	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	1.817,49	1,38	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.447,08	1,10	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	1.284,59	0,97	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.131,76	0,86	Faixa 2
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	1.120,57	0,85	Faixa 2
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	1.111,78	0,84	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
AMBP12	1,12	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTO	Sem Faixa	Faixa 2	15-jul-27	CDI	2,75%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
AMBP12	0,07	AMBIPAR PARTICIPAÇÕES E EMPREENDIMENTO	Sem Faixa	Faixa 2	15-jul-27	CDI	2,61%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
NP CDI	20,37	CCR SA	Sem Faixa	Faixa 1	03-dez-23	CDI	1,40%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP



OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/01/2022

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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	4.725.136	3,59%	IPCA	31-jan-22	6,49%	6,80%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	4.025.116	3,05%	IPCA	19-jan-22	6,14%	6,10%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	1.944.500	1,48%	IPCA	19-jan-22	6,07%	6,10%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	1.110.807	0,84%	IPCA	31-jan-22	5,50%	5,49%	MAG OABPREV GO FI MULT

