

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/01/2023

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	130.549.305,23	88,89%				1,06%	2,35%	5,80%	1,06%	12,22%	17,64%	21,49%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%
Multimercados Institucionais	119.349.490,34	81,26%				1,25%						
MAG OABPREV GO FI MULT	59.731.096,56	40,67%	MONGERAL AEGON	100%	0,41%	1,28%	2,99%	6,25%	1,28%	13,05%	20,77%	24,70%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	59.618.393,78	40,59%	VINCI	100%	0,54%	0,97%	2,15%	5,81%	0,97%	12,25%	16,62%	22,70%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,30%	3,82%	7,79%	1,30%	15,07%	23,24%	28,86%
Renda Fixa	11.199.814,89	7,63%				1,16%						
ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES FIC FI	4.158.199,89	2,83%	ITAÚ	0,01%	0,01%	1,12%	3,26%	6,67%	1,12%	12,76%	18,34%	21,03%
ITAÚ RF IMA-B ATIVO FIC FI	6.605.514,47	4,50%	ITAÚ	2,07%	1,97%	-0,06%	-1,78%	1,79%	-0,06%	6,03%	4,43%	10,88%
DELTA CRED PRIV FIC FI RF	67.973,93	0,05%	NOVERO	5,36%	0,44%	0,67%	1,92%	1,10%	0,67%	8,10%	-51,13%	-92,33%
TREK FI RF CRED PRIV IMOB.	368.126,59	0,25%	NOVERO	1,44%		-0,12%	-0,36%	-0,72%	-0,12%	-1,41%	0,21%	3,96%
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%
Renda Variável	16.324.280,97	11,11%				3,08%	-6,89%	6,14%	3,08%	-1,95%	-11,47%	-15,59%
Benchmark:	IBOVESPA					3,37%	-2,25%	9,95%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%
Renda Variável	16.324.280,97	11,11%				1,32%						
BRASIL CAPITAL 30 INSTIT. FIC FIA	4.209.927,78	2,87%	BC GESTAO	1,85%	8,25%	1,99%	-5,86%	6,10%	1,99%	-7,49%	-22,70%	-23,47%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIA	5.228.481,58	3,56%	CONSTANCIA	0,42%	1,86%	3,83%	-6,87%	3,78%	3,83%	2,02%	4,15%	-7,77%
MANTARO AÇÕES FIC FIA	4.381.592,25	2,98%	PACIFICO	3,52%	9,83%	2,96%	-10,19%	7,27%	2,96%	-2,03%	-20,41%	-14,26%
SANTANDER FI IBOV ATIVO INSTIT. AÇÕES	2.504.279,36	1,71%	SANTANDER	0,82%	8,26%	3,58%	-2,47%	9,36%	3,58%	0,11%	-4,10%	-11,82%
Benchmark:	IBOVESPA					3,37%	-2,25%	9,95%	3,37%	1,15%	-1,42%	-0,29%
Total	146.873.586,19	100%				1,25%	1,28%	1,23%	5,84%	1,28%	10,36%	13,15%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					0,81%	2,58%	3,46%	0,81%	10,04%	26,68%	39,08%

* 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.

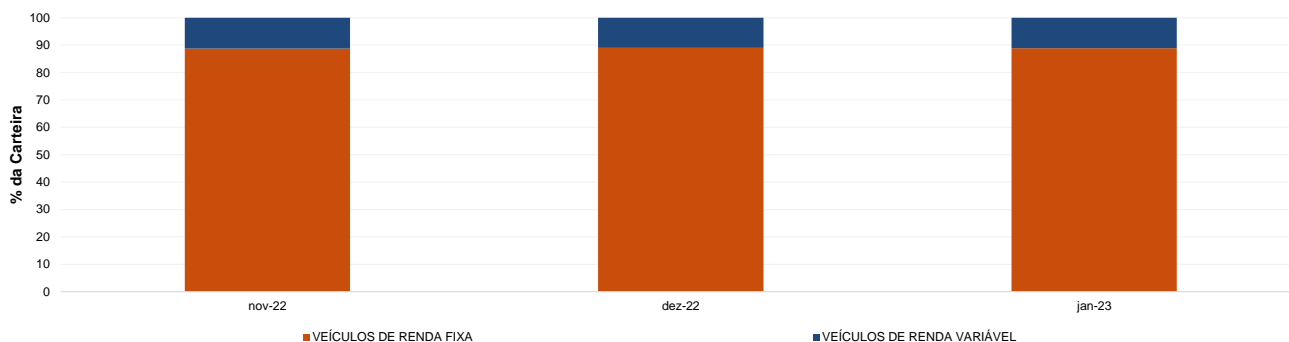
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

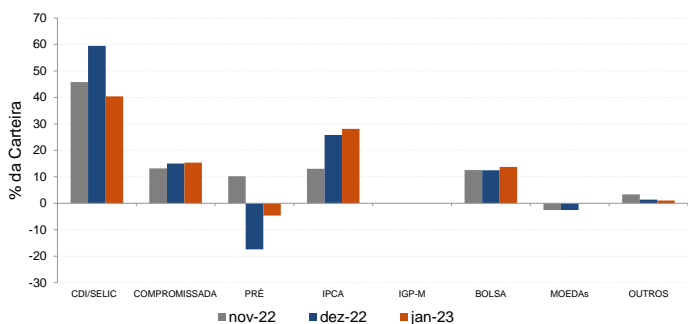
Distribuição da Carteira

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.

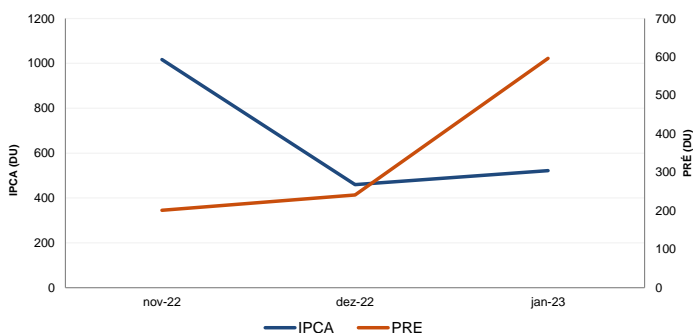
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
VALE3	Mineração	1.206,91	6,33	1.021,99	5,55
ITUB4	Intermediários Financeiros	1.200,12	6,30	1.126,30	6,12
EQTL3	Energia Elétrica	788,02	4,13	836,76	4,54
RENT3	Diversos	660,64	3,47	581,10	3,16
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	608,12	3,19	558,12	3,03
BBAS3	Intermediários Financeiros	600,90	3,15	436,71	2,37
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	563,01	2,95	525,57	2,85
SUZB3	Madeira e Papel	560,45	2,94	620,45	3,37
BPAC11	Intermediários Financeiros	502,00	2,63	640,13	3,48
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	493,29	2,59	456,59	2,48

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

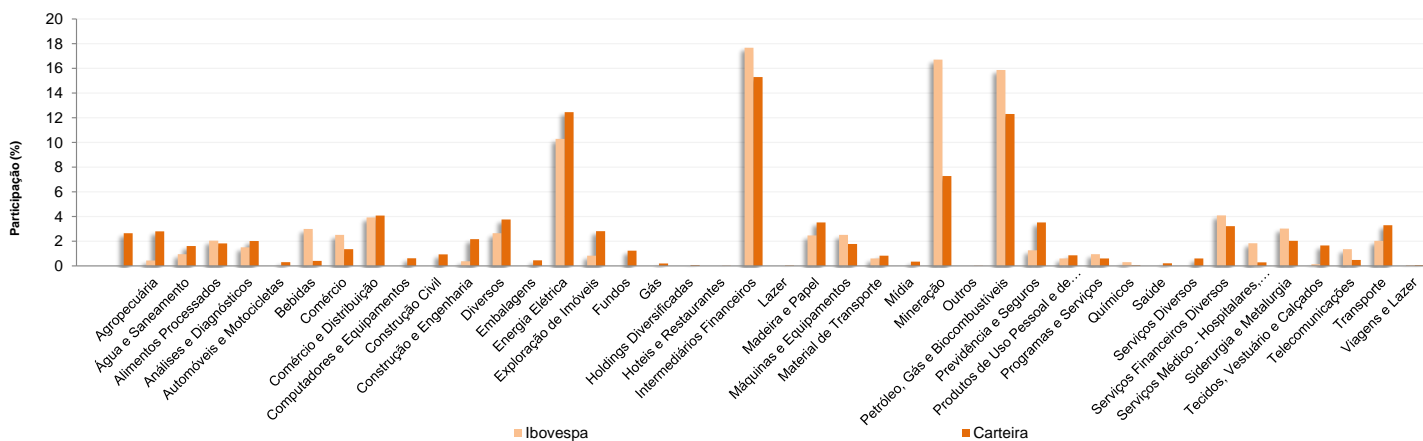
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PASS12	37,62	0,20	0,00	Sem Liquidez
GETT11	0,14	0,00	0,00	Sem Liquidez
BKBR3	0,03	0,00	0,00	Sem Liquidez
SULA11	0,01	0,00	0,00	Sem Liquidez
MODL11	0,01	0,00	0,00	Sem Liquidez
MTSA4	28,12	0,15	0,03	3
GEPA4	4,56	0,02	0,01	2
VALE3	1.206,91	6,33	0,00	1
ITUB4	1.200,12	6,30	0,00	1
EQTL3	788,02	4,13	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

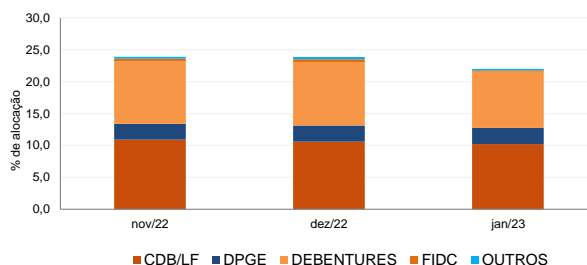
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BANCO VOTORANTIM S.A.	2.823,74	1,92	Faixa 2
BANCO AGIBANK S.A.	2.502,82	1,70	Faixa 4
BCO SAFRA SA	2.490,04	1,69	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	1.885,95	1,28	Faixa 1
NCF PARTICIPACOES SA	1.454,41	0,99	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.360,10	0,92	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.311,30	0,89	Faixa 1
BCO VOLKSWAGEN SA	1.283,66	0,87	Faixa 1
BANCO MODAL SA	1.212,36	0,82	Faixa 3
VALE SA	1.211,32	0,82	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
AERI11	5,58	AERIS INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE EQUIPAMENTC	Faixa 2	Faixa 3	15-jan-26	CDI	2,28%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
AERI11	6,36	AERIS INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE EQUIPAMENTC	Faixa 2	Faixa 3	15-jan-26	CDI	2,89%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
AERI12	6,36	AERIS INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE EQUIPAMENTC	Faixa 2	Faixa 3	31-jul-26	CDI	2,04%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
AERI12	2,66	AERIS INDÚSTRIA E COMÉRCIO DE EQUIPAMENTC	Faixa 2	Faixa 3	31-jul-26	CDI	2,98%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
BTOW15	0,03	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-dez-30	IPCA	7,99%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
CELG12	9,44	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	Sem Faixa	Faixa 1	20-jan-26	CDI	1,60%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
CELG12	4,78	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	Sem Faixa	Faixa 1	20-jan-26	CDI	1,50%	BRAM INSTIT. FI RF CRED PRIV
LAMEA6	0,01	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-out-30	IPCA	8,14%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	10,04	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	2,75%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	0,02	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	2,66%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
LAMEA7	0,78	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-33	CDI	2,75%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
LAMEA7	-0,01	AMERICANAS S.A	Faixa 2	Faixa 8	15-jul-50	CDI	295,01%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
OGDS11	3,02	OMEGA DESENVOLVIMENTO S.A.	Sem Faixa	Faixa 3	15-jun-25	CDI	1,80%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 31/01/2023

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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	9.482.526	6,45%	IPCA	19-jan-23	6,60%	6,56%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	3.110.170	2,11%	IPCA	10-jan-23	6,90%	6,77%	MAG OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	2.839.006	1,93%	IPCA	19-jan-23	6,62%	6,56%	MAG OABPREV GO FI MULT

