

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/12/2021

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	113,181,612.22	87.64%				0.67%	1.65%	2.38%	4.27%	4.27%	7.88%	15.44%	
Benchmark:	CDI					0.76%	1.84%	3.09%	4.40%	4.40%	7.28%	13.69%	
Multimercados Institucionais	95,673,775.22	74.08%			0.30%								
MAG OABPREV GO FI MULT	45,849,432.41	35.50%	MONGERAL AEGON	100%	0.43%	1.09%	2.53%	3.97%	6.01%	6.01%	9.84%	17.43%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	49,824,342.81	38.58%	VINCI	100%	0.64%	0.34%	0.98%	1.34%	3.33%	3.33%	8.73%	18.51%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0.95%	2.35%	4.13%	6.47%	6.47%	11.60%	20.64%	
Renda Fixa	17,507,837.00	13.56%			0.97%								
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	10,772,816.45	8.34%	ITAU	0.05%	0.01%	0.76%	1.86%	3.14%	4.34%	4.34%	6.92%	13.13%	
ITAU RF IMA-B ATIVO FC	6,298,779.40	4.88%	ITAU	1.01%	2.70%	0.08%	0.37%	-0.61%	-1.47%	-1.47%	5.95%	31.88%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	373,933.48	0.29%	NOVERO	1.44%		-0.13%	-0.35%	-0.70%	1.68%	1.68%	5.47%	-10.82%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	62,307.67	0.05%	NOVERO	5.36%	0.00%	1.06%	2.74%	-54.74%	-55.33%	-55.33%	-92.98%	-95.15%	
Benchmark:	CDI					0.76%	1.84%	3.09%	4.40%	4.40%	7.28%	13.69%	
Renda Variável	15,881,421.83	12.30%				1.22%	-9.61%	-21.05%	-16.74%	-16.74%	-17.39%	18.36%	
Benchmark:	IBOVESPA					2.85%	-5.55%	-17.33%	-11.93%	-11.93%	-9.36%	19.27%	
Renda Variável	15,881,421.83	12.30%			3.25%								
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	4,362,603.15	3.38%	BC GESTAO	1.00%	7.46%	2.57%	-13.92%	-23.05%	-19.57%	-19.57%	-19.90%	25.01%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4,933,595.31	3.82%	CONSTANCIA	0.45%	3.31%	3.14%	-4.45%	-15.53%	-5.60%	-5.60%	-11.48%	33.56%	
PACIFICO ACOES FQ FIA	4,244,549.02	3.29%	PACIFICO	1.91%	7.22%	-1.15%	-16.07%	-24.87%	-21.92%	-21.92%	-14.37%	24.07%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2,340,674.35	1.81%	SANTANDER	0.55%	7.44%	2.86%	-5.91%	-17.66%	-13.46%	-13.46%	-18.38%	8.42%	
Benchmark:	IBOVESPA					2.85%	-5.55%	-17.33%	-11.93%	-11.93%	-9.36%	19.27%	
Imobiliário	86,302.36	0.07%				-1.14%	-3.27%	-74.19%	-74.35%	-74.35%			
Benchmark:	INPC					0.73%	2.75%	5.97%	10.16%	10.16%	16.16%	21.37%	
FII	86,302.36	0.07%											
SAO FRANCISCO 34 FII-SUBORDINA	86,302.36	0.07%	CULTINVEST	0.96%		-0.29%	29.87%	-65.34%	-71.01%	-71.01%	-71.18%	-71.22%	
Benchmark:	IFIX					8.78%	3.28%	1.81%	-2.28%	-2.28%	-12.28%	19.27%	
Total	129,149,336.41	100%				0.86%	0.74%	0.12%	-1.44%	0.92%	0.92%	3.89%	14.17%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					1.10%	3.79%	8.15%	14.65%	14.65%	25.82%	36.85%	

* 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.

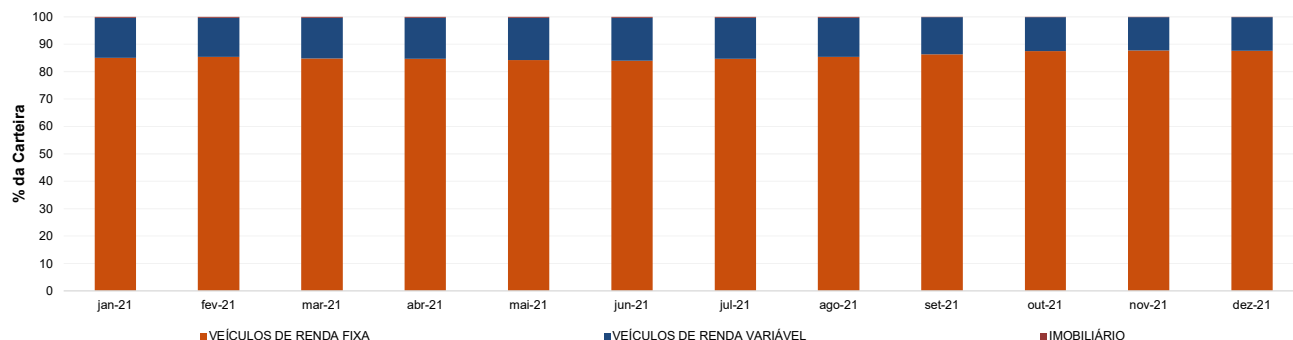
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

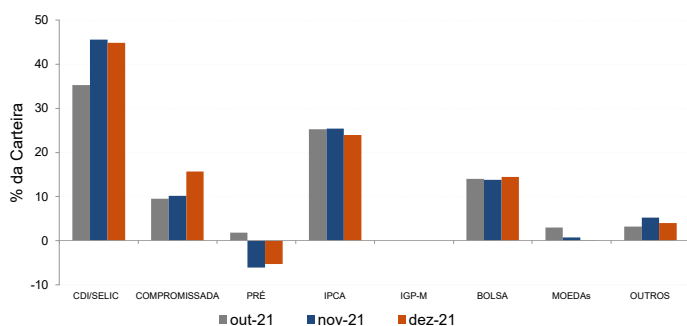
Distribuição da Carteira

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.

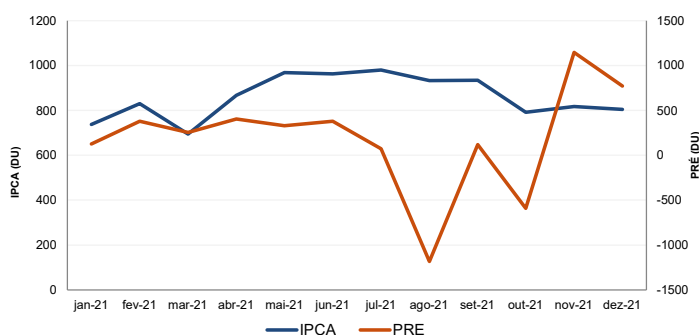
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	765.81	4.33	979.28	5.61
SUZB3	Madeira e Papel	681.04	3.85	511.89	2.93
RAIL3	Transporte	600.36	3.40	206.96	1.19
GNDI3	Análises e Diagnósticos	589.48	3.34	368.93	2.11
VALE3	Mineração	584.82	3.31	459.14	2.63
RENT3	Diversos	495.38	2.80	116.07	0.66
BPAC11	Intermediários Financeiros	487.24	2.76	503.67	2.88
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	485.45	2.75	491.23	2.81
EQTL3	Energia Elétrica	478.58	2.71	70.56	0.40
LCAM3	Diversos	374.83	2.12	351.73	2.01

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

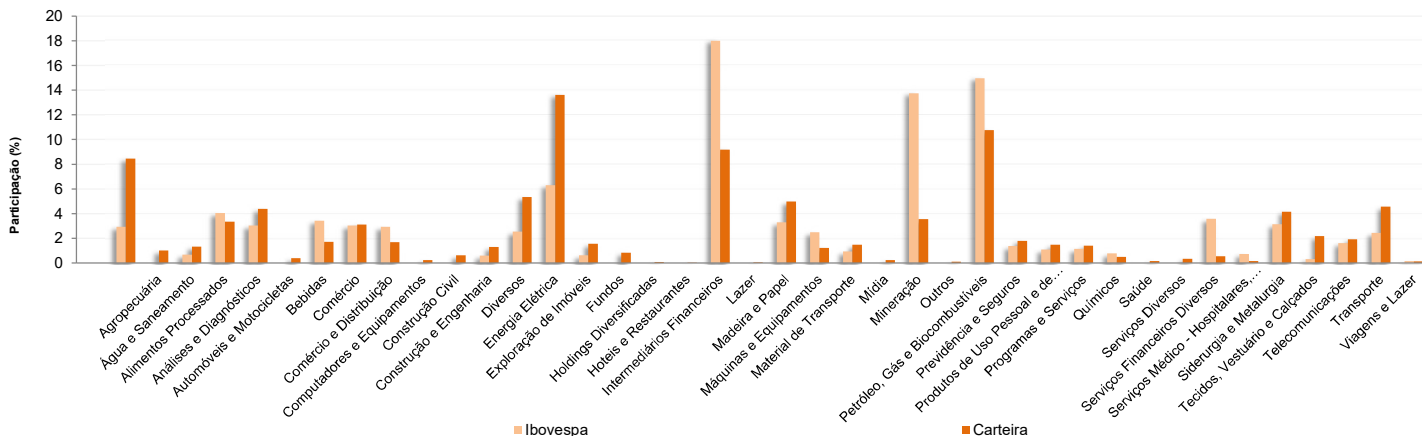
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PASS12	20.29	0.11	0.00	Sem Liquidez
CRIV4	6.66	0.04	0.01	7
GEP4	6.66	0.04	0.01	4
PETR4	765.81	4.33	0.00	1
SUZB3	681.04	3.85	0.00	1
RAIL3	600.36	3.40	0.00	1
GNDI3	589.48	3.34	0.00	1
VALE3	584.82	3.31	0.00	1
RENT3	495.38	2.80	0.00	1
BPAC11	487.24	2.76	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.



OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/12/2021

Análises de Contrapartes

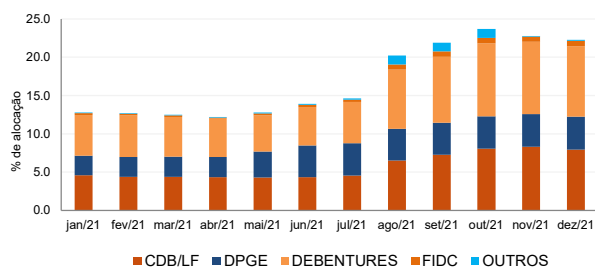
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO SAFRA SA	2,724.72	2.10	Faixa 1
BANCO AGIBANK S.A.	2,271.99	1.75	Faixa 4
BANCO C6 S.A.	2,242.43	1.73	Sem Faixa
BANCO RCI BRASIL SA	1,908.87	1.47	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	1,680.60	1.30	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1,433.39	1.10	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	1,273.59	0.98	Faixa 2
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	1,117.40	0.86	Faixa 1
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	1,078.32	0.83	Faixa 2
MAGAZINE LUIZA SA	1,068.55	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/12/2021

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	09-nov-22	408,040	0.31%	CDI	BCO DAYCOVAL SA	10-dez-21	108.25%	Faixa 2	MAG OABPREV GO FI MULT

