

OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 30/06/2022

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 | 121.331.517,36 | 89,29% | | | | 0,47% | 2,72% | 6,19% | 6,19% | 8,72% | 13,86% | 18,33% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 1,01% | 2,91% | 5,40% | 5,40% | 8,66% | 11,12% | 16,25% |
| Multimercados Institucionais | 101.818.792,66 | 74,93% | | | 0,49% | | | | | | | |
| MAG OABPREV GO FI MULT | 48.861.367,71 | 35,96% | MONGERAL AEGON | 100% | 0,37% | 0,51% | 3,09% | 6,57% | 6,57% | 10,80% | 16,99% | 20,46% |
| VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV | 52.957.424,95 | 38,97% | VINCI | 100% | 0,63% | 0,44% | 2,56% | 6,29% | 6,29% | 7,71% | 13,13% | 20,22% |
| Benchmark: | CDI + 2% a.a. | | | | | 1,18% | 3,41% | 6,43% | 6,43% | 10,83% | 15,60% | 23,37% |
| Renda Fixa | 19.512.724,70 | 14,36% | | | 0,53% | | | | | | | |
| ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC | 12.512.721,22 | 9,21% | ITAU | 0,05% | 0,04% | 1,02% | 2,86% | 5,42% | 5,42% | 8,73% | 10,87% | 15,80% |
| ITAU RF IMA-B ATIVO FC | 6.561.961,15 | 4,83% | ITAU | 1,49% | 1,60% | -0,65% | 1,00% | 4,18% | 4,18% | 3,54% | 10,75% | 18,19% |
| TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO | 371.225,94 | 0,27% | NOVERO | 1,44% | | -0,06% | -0,35% | -0,72% | -0,72% | -1,42% | 0,20% | 0,67% |
| DELTA CRED PRIV FC FIRF | 66.816,39 | 0,05% | NOVERO | 5,36% | 0,02% | -0,88% | 4,40% | 7,24% | 7,24% | -51,47% | -58,73% | -92,59% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 1,01% | 2,91% | 5,40% | 5,40% | 8,66% | 11,12% | 16,25% |
| Renda Variável | 14.553.217,47 | 10,71% | | | | -11,26% | -16,28% | -8,36% | -8,36% | -27,65% | -8,03% | -6,82% |
| Benchmark: | IBOVESPA | | | | | -11,50% | -17,88% | -5,99% | -5,99% | -22,29% | 3,67% | -2,40% |
| Renda Variável | 14.553.217,47 | 10,71% | | | 2,46% | | | | | | | |
| BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA | 3.750.333,38 | 2,76% | BC GESTAO | 1,08% | 8,72% | -12,58% | -20,01% | -14,03% | -14,03% | -33,85% | -13,77% | -12,61% |
| CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA | 4.813.192,24 | 3,54% | CONSTANCIA | 0,42% | 3,81% | -10,77% | -11,90% | -2,44% | -2,44% | -17,59% | 6,05% | 10,19% |
| PACIFICO ACOES FQ FIA | 3.806.975,87 | 2,80% | PACIFICO | 2,95% | 7,93% | -10,22% | -16,55% | -10,31% | -10,31% | -32,62% | -12,80% | -4,46% |
| SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES | 2.182.715,98 | 1,61% | SANTANDER | 0,64% | 8,75% | -11,86% | -18,24% | -6,75% | -6,75% | -23,22% | -2,39% | -11,64% |
| Benchmark: | IBOVESPA | | | | | -11,50% | -17,88% | -5,99% | -5,99% | -22,29% | 3,67% | -2,40% |
| Total | 135.884.734,83 | 100% | | | 1,22% | -0,93% | 0,27% | 4,35% | 4,35% | 2,85% | 10,66% | 14,52% |
| Benchmark: | INPC + 4.09% a.a. | | | | | 0,96% | 3,14% | 7,72% | 7,72% | 16,50% | 32,42% | 41,10% |

* 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.

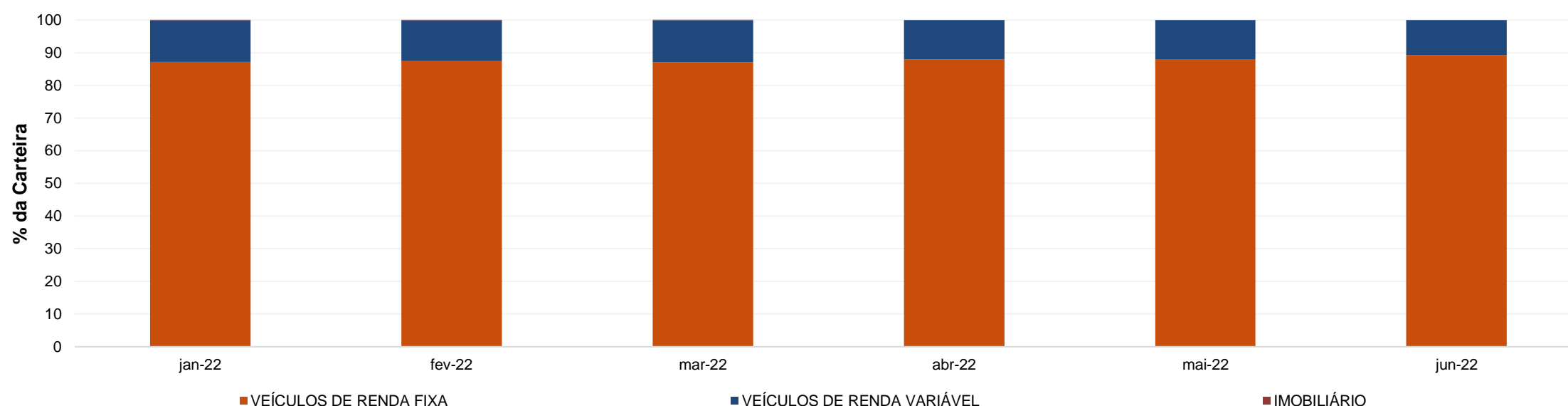
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

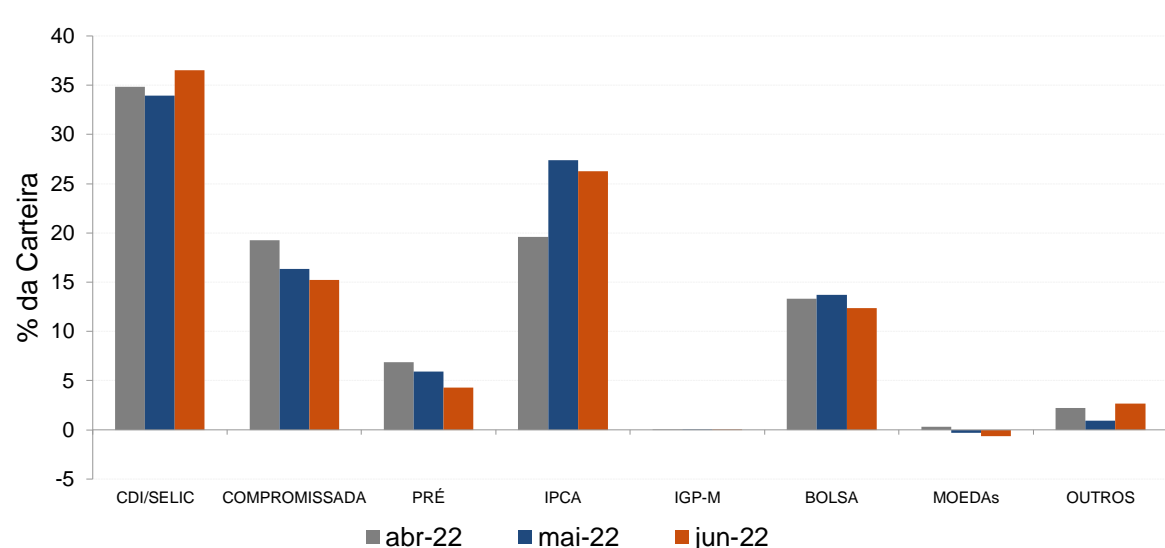
Distribuição da Carteira

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.

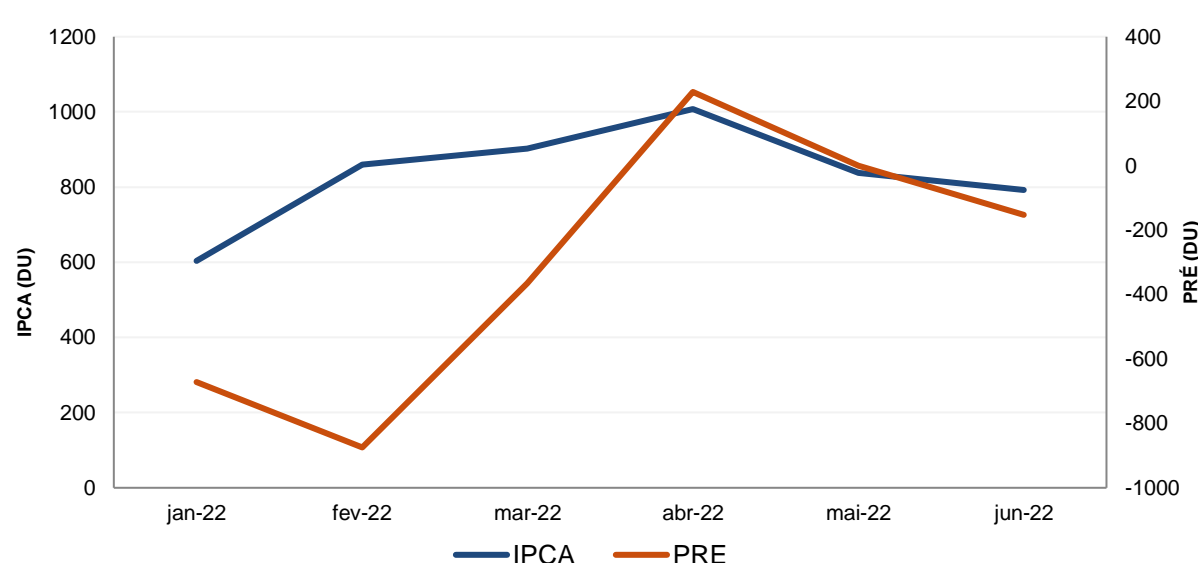
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | Setor | Atual* | % | Anterior* | % |
|--------|---------------------------------|--------|------|-----------|------|
| VALE3 | Mineração | 946,92 | 5,98 | 868,69 | 4,71 |
| EQTL3 | Energia Elétrica | 735,14 | 4,64 | 773,59 | 4,19 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 657,99 | 4,16 | 725,75 | 3,93 |
| PETRA | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 651,74 | 4,12 | 821,47 | 4,45 |
| ELET3 | Energia Elétrica | 541,99 | 3,42 | 98,02 | 0,53 |
| CSAN3 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 487,99 | 3,08 | 567,70 | 3,08 |
| BPAC11 | Intermediários Financeiros | 462,79 | 2,92 | 569,05 | 3,08 |
| LCAM3 | Diversos | 447,30 | 2,83 | 487,32 | 2,64 |
| SUZB3 | Madeira e Papel | 398,39 | 2,52 | 444,31 | 2,41 |
| RAIL3 | Transporte | 397,37 | 2,51 | 405,51 | 2,20 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

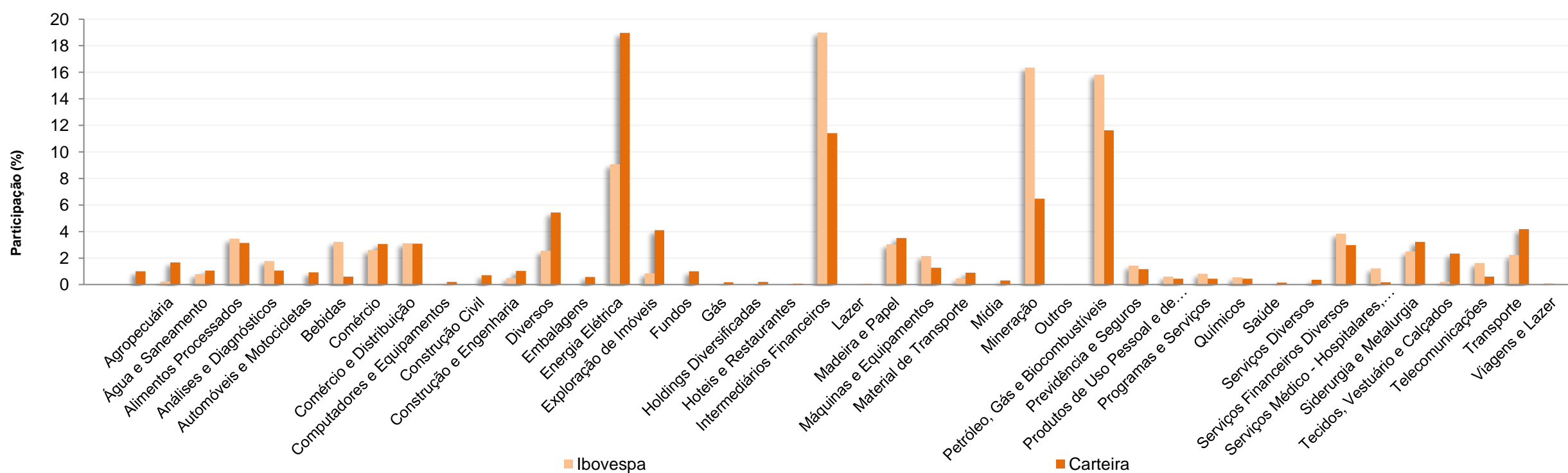
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|--------|--------|------|--------------|--------------------|
| PASS12 | 26,81 | 0,17 | 0,00 | Sem Liquidez |
| CRIV4 | 5,41 | 0,03 | 0,01 | 6 |
| MTSA4 | 25,27 | 0,16 | 0,02 | 2 |
| GEPA4 | 4,97 | 0,03 | 0,01 | 2 |
| VALE3 | 946,92 | 5,98 | 0,00 | 1 |
| EQTL3 | 735,14 | 4,64 | 0,00 | 1 |
| ITUB4 | 657,99 | 4,16 | 0,00 | 1 |
| PETRA | 651,74 | 4,12 | 0,00 | 1 |
| ELET3 | 541,99 | 3,42 | 0,00 | 1 |
| CSAN3 | 487,99 | 3,08 | 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

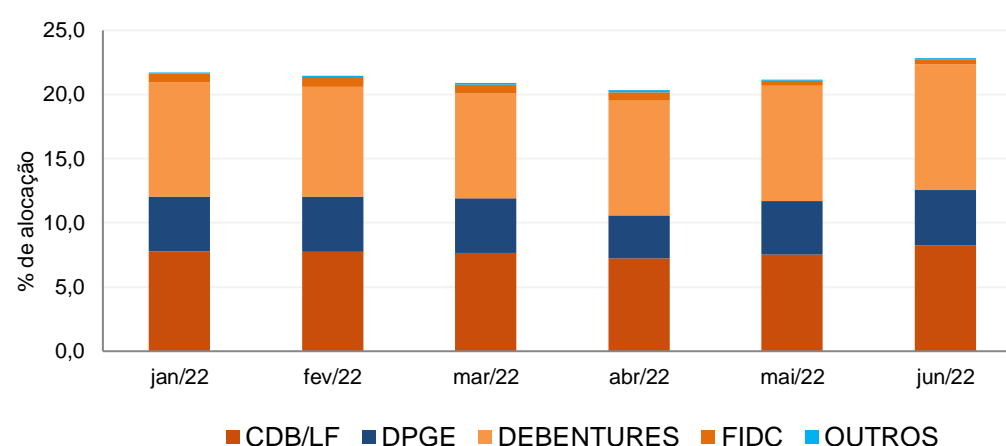
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|------------------------------------|----------|------|---------------------------|
| BCO SAFRA SA | 2.832,15 | 2,10 | Faixa 1 |
| BANCO C6 S.A. | 2.831,67 | 2,09 | Faixa 3 |
| BCO BRADESCO SA | 2.514,50 | 1,86 | Faixa 1 |
| BANCO AGIBANK S.A. | 2.393,26 | 1,77 | Faixa 4 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 1.763,63 | 1,30 | Faixa 1 |
| CIA LOCACAO AMERICAS | 1.348,21 | 1,00 | Faixa 2 |
| BCO DAYCOVAL SA | 1.333,01 | 0,99 | Faixa 2 |
| BANCO RCI BRASIL SA | 1.256,93 | 0,93 | Faixa 2 |
| ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA | 1.173,67 | 0,87 | Faixa 1 |
| BCO MODAL SA | 1.106,02 | 0,82 | 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 |
|--------------------|-----------------|---|----------------|-------------|-----------|--------|--------|------------------------------------|
| CRI HABITASEC 1 33 | 9,28 | HABITASEC SECURITIZADORA SA | Faixa 3 | Sem Faixa | 10-dez-23 | IGP-M | 7,75% | NOVERO CRED PRIV FI RF |
| CRI HBSC 1 32 | 27,80 | HABITASEC SECURITIZADORA SA | Faixa 2 | Sem Faixa | 05-dez-35 | IPCA | 9,00% | NOVERO CRED PRIV FI RF |
| CRI SCCI 1 14 | 1,13 | SECURITIZADORA CREDITOS IMOBILIARIOS S.A. | Faixa 3 | Sem Faixa | 10-out-50 | IPCA | 12,72% | DELTA CRED PRIV MASTER FI RF |
| CRI SCCI 1 14 | 1,13 | SECURITIZADORA CREDITOS IMOBILIARIOS S.A. | Faixa 3 | Sem Faixa | 10-out-50 | IPCA | 12,72% | DELTA CRED PRIV MASTER FI RF |
| CRI SCCI 1 14 | -1,13 | SECURITIZADORA CREDITOS IMOBILIARIOS S.A. | Faixa 3 | Sem Faixa | 10-out-50 | IPCA | 13,64% | DELTA CRED PRIV MASTER FI RF |
| CRI SCCI 1 14 | -1,13 | SECURITIZADORA CREDITOS IMOBILIARIOS S.A. | Faixa 3 | Sem Faixa | 10-out-50 | IPCA | 13,64% | DELTA CRED PRIV MASTER FI RF |
| CRI SCCI 1 14 | 7,53 | SECURITIZADORA CREDITOS IMOBILIARIOS S.A. | Faixa 3 | Sem Faixa | 10-out-50 | IPCA | 12,72% | DELTA CRED PRIV MASTER FI RF |
| CRI SCCI 1 14 | 7,53 | SECURITIZADORA CREDITOS IMOBILIARIOS S.A. | Faixa 3 | Sem Faixa | 10-out-50 | IPCA | 12,72% | DELTA CRED PRIV MASTER FI RF |
| CRI SCCI 1 14 | -7,53 | SECURITIZADORA CREDITOS IMOBILIARIOS S.A. | Faixa 3 | Sem Faixa | 10-out-50 | IPCA | 13,64% | DELTA CRED PRIV MASTER FI RF |
| CRI SCCI 1 14 | -7,53 | SECURITIZADORA CREDITOS IMOBILIARIOS S.A. | Faixa 3 | Sem Faixa | 10-out-50 | IPCA | 13,64% | DELTA CRED PRIV MASTER FI RF |
| QUAL16 | 45,47 | QUALICORP SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 03-jun-27 | CDI | 1,85% | SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV |
| QUAL16 | 13,57 | QUALICORP SA | Sem Faixa | Faixa 1 | 03-jun-27 | CDI | 1,94% | JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR |



OABPREV - GO - OABPREV - GO PLANO CD

Data-base: 30/06/2022

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 |
|------------------|------------|---------|-----------------|-----------|---------------|-------------|--------------|-------------|------------------------|
| CDB CDI Mensal | 28-nov-22 | 500.530 | 0,37% | CDI | BANCO C6 S.A. | 01-jun-22 | 1,00% | Faixa 3 | MAG OABPREV GO FI MULT |

| Títulos Públicos | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | | Data Compra | Tx de Compra | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|----------|-----------------|-----------|--|-------------|--------------|----------------|------------------------|
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 959.563 | 0,71% | IPCA | | 15-jun-22 | 6,70% | 6,44% | MAG OABPREV GO FI MULT |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 959.563 | 0,71% | IPCA | | 15-jun-22 | 6,82% | 6,44% | MAG OABPREV GO FI MULT |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 959.563 | 0,71% | IPCA | | 17-jun-22 | 6,60% | 6,56% | MAG OABPREV GO FI MULT |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 959.563 | 0,71% | IPCA | | 17-jun-22 | 6,61% | 6,56% | MAG OABPREV GO FI MULT |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | 919.748 | 0,68% | IPCA | | 14-jun-22 | 6,60% | 6,70% | MAG OABPREV GO FI MULT |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | -75.650 | -0,06% | IPCA | | 30-jun-22 | 7,00% | 7,07% | MAG OABPREV GO FI MULT |
| NTN-B 2023-05-15 | 15-mai-23 | -919.748 | -0,68% | IPCA | | 30-jun-22 | 7,00% | 7,07% | MAG OABPREV GO FI MULT |
| NTN-B 2024-08-15 | 15-ago-24 | -661.414 | -0,49% | IPCA | | 30-jun-22 | 6,22% | 6,21% | MAG OABPREV GO FI MULT |

