

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/03/2020

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	100.749.150,96	90,57%				-1,65%	-1,25%	0,34%	-1,25%	3,80%	11,08%	19,35%	
Benchmark:	CDI					0,34%	1,01%	2,27%	1,01%	5,45%	12,14%	21,57%	
Multimercados	82.334.655,92	74,02%				1,34%							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	39.774.865,86	35,76%	MONGERAL AEGON	100%	1,97%	-1,25%	-0,95%	0,33%	-0,95%	3,88%	11,21%	23,39%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	42.559.790,06	38,26%	VINCI	100%	1,12%	-1,26%	-0,87%	1,26%	-0,87%	5,86%	13,10%	22,28%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,51%	1,51%	3,29%	1,51%	7,57%	16,67%	28,96%	
Renda Fixa	18.414.495,04	16,55%				0,41%							
BB PREV RF IRF M FI	2.644.269,73	2,38%	BB	0,05%	2,80%	-0,11%	1,38%	3,22%	1,38%	10,87%	20,76%	35,94%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	14.836.489,88	13,34%	ITAU	0,09%	0,01%	0,32%	0,96%	2,18%	0,96%	5,28%	11,79%	21,12%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	771.775,98	0,69%	NOVERO	1,44%	0,00%	5,08%	4,54%	2,38%	4,54%	-0,04%	-47,16%	-52,97%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	161.959,45	0,15%	NOVERO	5,36%	0,00%	-81,71%	-81,74%	-81,99%	-81,74%	-87,34%	-87,47%	-91,63%	
Benchmark:	CDI					0,34%	1,01%	2,27%	1,01%	5,45%	12,14%	21,57%	
Renda Variável	10.489.200,39	9,43%				-34,79%	-39,02%	-29,70%	-39,02%	-18,98%	-6,59%		
Benchmark:	IBOVESPA					-29,90%	-36,86%	-30,29%	-36,86%	-23,47%	-14,46%	12,37%	
Renda Variável	10.489.200,39	9,43%				11,46%							
BRASIL CAPITAL 30 FC FIA	3.206.546,24	2,88%	BC GESTAO	0,39%	50,28%	-37,53%	-41,13%	-32,30%	-41,13%	-17,93%	-2,93%	25,33%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	3.668.993,18	3,30%	CONSTANCIA	0,69%	47,11%	-31,56%	-34,17%	-21,98%	-34,17%	-8,31%	11,62%	45,98%	
MOAT CAPITAL FIC FIA	2.362.177,97	2,12%	MOAT CAPITAL	0,18%	57,49%	-36,50%	-42,44%	-34,83%	-42,44%	-22,82%	-5,18%	40,68%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	1.251.483,00	1,13%	SANTANDER	0,21%	42,85%	-33,16%	-39,76%	-32,62%	-39,76%	-25,46%	-17,96%	5,38%	
Benchmark:	IBOVESPA					-29,90%	-36,86%	-30,29%	-36,86%	-23,47%	-14,46%	12,37%	
Total	111.238.351,35	100%				4,82%	-6,15%	-6,75%	-3,59%	-6,75%	0,31%	7,38%	16,91%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					0,53%	1,54%	4,43%	1,54%	7,57%	17,16%	23,76%	

* 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.

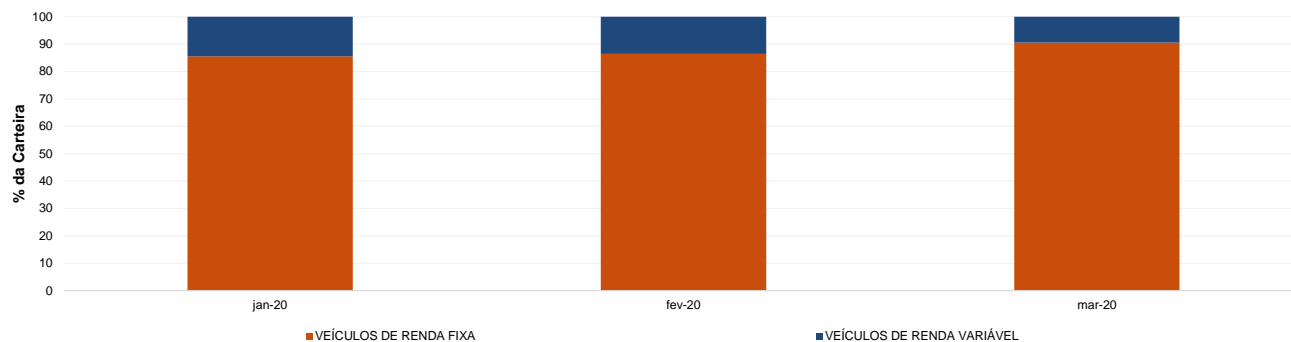
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

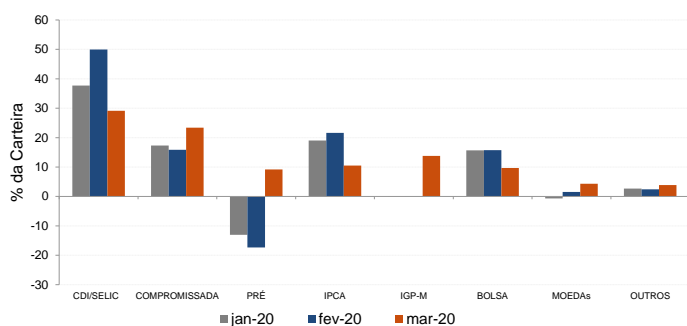
Distribuição da Carteira

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.

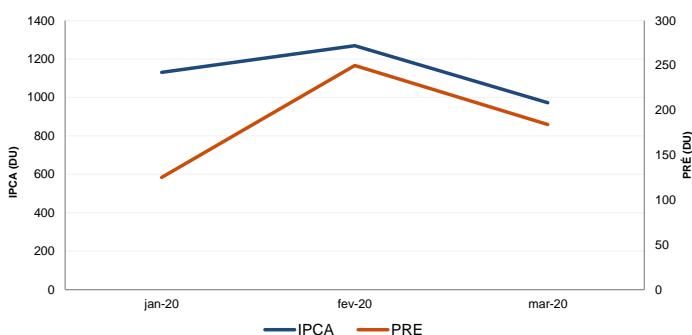
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	476,61	3,74	670,10	3,56
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	453,15	3,56	1.053,70	5,60
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	453,01	3,56	630,71	3,35
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	443,70	3,48	472,61	2,51
ITUB4	Intermediários Financeiros	420,53	3,30	584,78	3,11
RAIL3	Transporte	408,41	3,21	442,79	2,35
BBAS3	Intermediários Financeiros	358,93	2,82	684,51	3,64
LAME4	Comércio	300,08	2,36	457,63	2,43
ALUP11	Energia Elétrica	288,86	2,27	377,39	2,01
SULA11	Previdência e Seguros	264,44	2,08	342,42	1,82

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

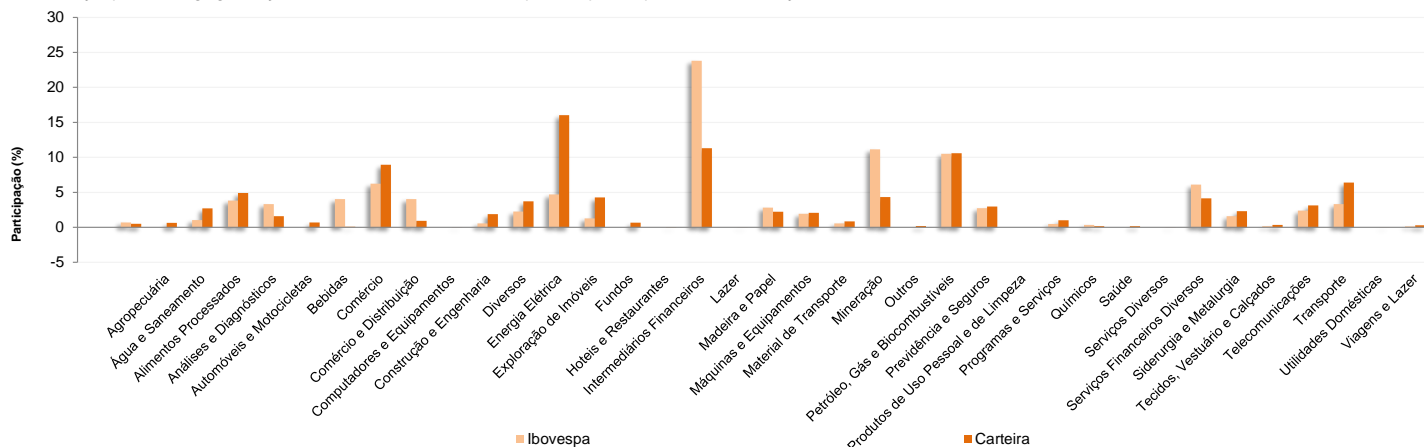
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PCAR4	-14,50	-0,11	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	10,21	0,08	0,01	3
VALE3	476,61	3,74	0,00	1
PETR4	453,15	3,56	0,00	1
CSAN3	453,01	3,56	0,01	1
B3SA3	443,70	3,48	0,00	1
ITUB4	420,53	3,30	0,00	1
RAIL3	408,41	3,21	0,00	1
BBAS3	358,93	2,82	0,00	1
LAME4	300,08	2,36	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: 31/03/2020

Análises de Contrapartes

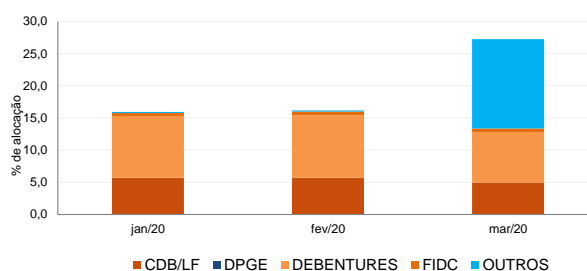
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
HABITASEC SECURITIZADORA SA	18.551,10	13,81	Sem Faixa
BANCO RCI BRASIL SA	1.791,58	1,33	Faixa 1
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.234,36	0,92	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	1.137,55	0,85	Faixa 2
IOCHPE MAXION SA	965,44	0,72	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	955,28	0,71	Faixa 2
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	831,69	0,62	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	797,70	0,59	Faixa 2
LOJAS AMERICANAS SA	756,61	0,56	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	692,14	0,52	Faixa 2

* 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: 31/03/2020

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 2024-09-01	01-set-24	1.056.400	0,79%	Selic	04-mar-20	0,02%	0,00%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
LFT 2025-03-01	01-mar-25	105.616	0,08%	Selic	04-mar-20	36,69%	0,03%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
LFT 2025-09-01	01-set-25	2.111.989	1,57%	Selic	16-mar-20	0,03%	0,03%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
LFT 2025-09-01	01-set-25	2.111.989	1,57%	Selic	16-mar-20	0,03%	0,03%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
LTN 2022-04-01	01-abr-22	7.456	0,01%	PRE	04-mar-20	4,64%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2022-04-01	01-abr-22	7.456	0,01%	PRE	05-mar-20	4,36%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2024-01-01	01-jan-24	10.817	0,01%	PRE	04-mar-20	5,62%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2024-01-01	01-jan-24	10.817	0,01%	PRE	05-mar-20	5,38%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI