

## OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/05/2019

Este relatório apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e rentabilidade. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações contidas nesse relatório foram extraídas dos relatórios de risco 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	
<b>Renda Fixa</b>	<b>6.602.540,73</b>	<b>5,99%</b>				<b>0,76%</b>	<b>1,80%</b>	<b>3,75%</b>	<b>3,18%</b>	<b>7,90%</b>	<b>14,24%</b>	<b>28,84%</b>	
Benchmark:	CDI					0,54%	1,54%	3,10%	2,59%	6,37%	14,54%	29,73%	
<b>Renda Fixa</b>	<b>6.602.540,73</b>	<b>5,99%</b>				<b>0,32%</b>							
BB PREV RF IRF M FI	2.441.059,81	2,21%	BB	0,05%	0,77%	1,75%	2,93%	6,20%	4,62%	13,10%	24,56%	46,22%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	2.115.703,15	1,92%	ITAU	0,02%	0,00%	0,53%	1,50%	3,03%	2,53%	6,22%	14,29%	29,24%	
NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	770.974,62	0,70%	NOVERO	1,44%	0,04%	-0,19%	-0,39%	-12,04%	-11,83%	-27,34%	-53,61%	-48,83%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	1.274.803,15	1,16%	NOVERO	5,36%	0,16%	-0,21%	-0,40%	-0,80%	-0,72%	-1,23%	-33,98%	-	
Benchmark:	CDI					0,54%	1,54%	3,10%	2,59%	6,37%	14,54%	29,73%	
<b>Renda Variável</b>	<b>4.879.274,24</b>	<b>4,42%</b>				<b>1,30%</b>	<b>1,72%</b>	<b>9,17%</b>	<b>11,02%</b>	<b>28,52%</b>			
Benchmark:	IBOVESPA					0,70%	1,51%	8,41%	10,40%	26,42%	54,73%	100,18%	
<b>Renda Variável</b>	<b>4.879.274,24</b>	<b>4,42%</b>				<b>1,91%</b>							
MOAT CAPITAL FIC FIA	3.155.813,01	2,86%	MOAT CAPITAL	0,19%	7,60%	1,41%	1,56%	8,38%	10,62%	34,40%	98,47%	208,58%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	1.723.461,23	1,56%	SANTANDER	0,35%	5,46%	1,10%	2,02%	9,22%	10,21%	25,27%	50,89%	93,67%	
Benchmark:	IBOVESPA					0,70%	1,51%	8,41%	10,40%	26,42%	54,73%	100,18%	
<b>Estruturado</b>	<b>98.824.144,46</b>	<b>89,59%</b>											
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,72%	2,03%	4,11%	3,44%	8,49%	19,13%	37,62%	
<b>Multimercados</b>	<b>98.824.144,46</b>	<b>89,59%</b>				<b>0,31%</b>							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULTI	37.590.667,21	34,08%	MONGERAL AEGON	100%	0,16%	0,68%	1,89%	3,89%	3,25%	8,00%	17,98%	32,68%	
TC OABPREVGO TO FI MULT	21.622.277,38	19,60%	TC	100%	0,44%	0,65%	1,88%	3,94%	3,25%	9,13%	21,65%	41,01%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	39.611.199,87	35,91%	VINCI	100%	0,70%	0,88%	1,73%	3,93%	3,55%	7,55%	15,61%	30,71%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,72%	2,03%	4,11%	3,44%	8,49%	19,13%	37,62%	
<b>Total</b>	<b>110.305.959,43</b>	<b>100%</b>				<b>0,57%</b>	<b>0,74%</b>	<b>1,70%</b>	<b>3,71%</b>	<b>3,26%</b>	<b>8,11%</b>	<b>16,21%</b>	<b>31,53%</b>
Benchmark:	INPC + 4.19% a.a.					0,51%	2,56%	4,68%	4,19%	9,15%	15,68%	24,56%	

\* 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.

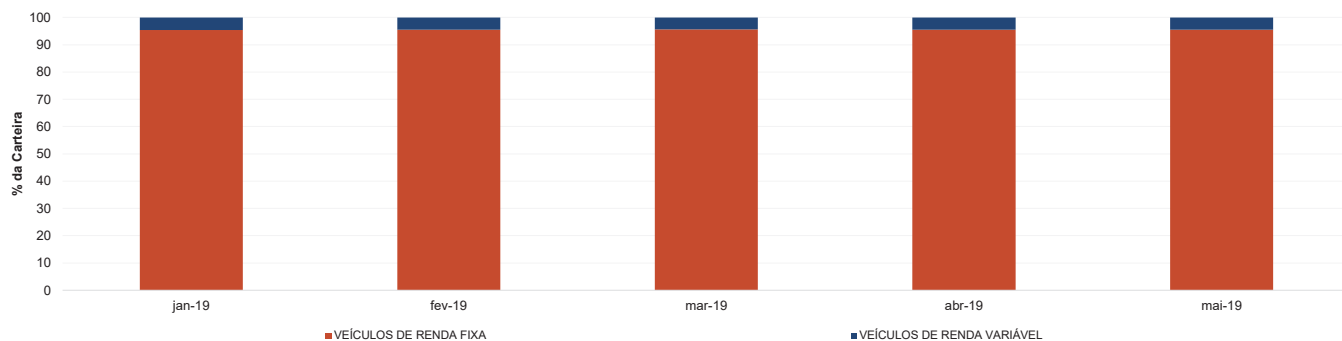
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

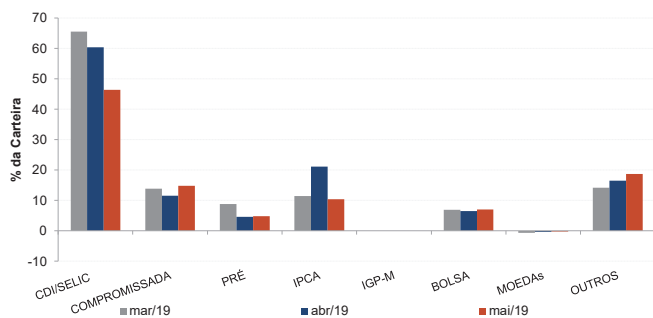
## Distribuição da Carteira

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.

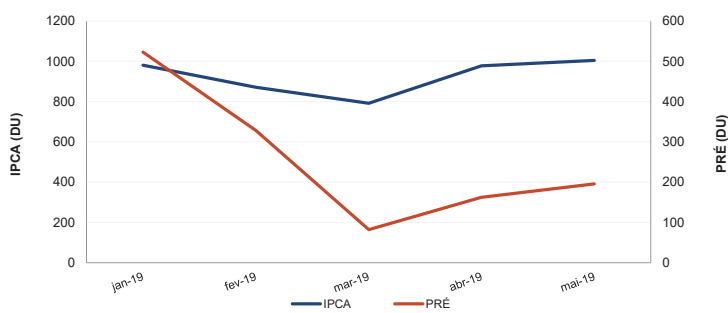
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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	571,63	6,82	327,69	4,00
PETRA	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	552,11	6,59	689,08	8,42
BBDC4	Intermediários Financeiros	488,75	5,83	326,91	3,99
ITUB4	Intermediários Financeiros	352,14	4,20	309,52	3,78
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	343,71	4,10	236,00	2,88
CMIG4	Energia Elétrica	335,31	4,00	318,30	3,89
MULT3	Exploração de Imóveis	307,66	3,67	264,03	3,23
SBSP3	Água e Saneamento	278,61	3,33	290,83	3,55
PCAR4	Comércio e Distribuição	273,09	3,26	241,17	2,95
LAME4	Comércio	236,41	2,82	244,75	2,99

\* 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
VALE3	571,63	6,82	0,00	1
PETRA	552,11	6,59	0,00	1
BBDC4	488,75	5,83	0,00	1
ITUB4	352,14	4,20	0,00	1
GGBR4	343,71	4,10	0,00	1
CMIG4	335,31	4,00	0,00	1
MULT3	307,66	3,67	0,00	1
SBSP3	278,61	3,33	0,00	1
PCAR4	273,09	3,26	0,00	1
LAME4	236,41	2,82	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.

