

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 29/05/2020

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	102.375.428,58	88,85%				0,81%	-0,53%	0,69%	-0,13%	3,58%	11,77%	18,33%	
Benchmark:	CDI					0,24%	0,87%	1,93%	1,54%	4,88%	11,57%	20,14%	
Multimercados	83.339.730,61	72,33%				1,77%							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	39.886.270,69	34,62%	MONGERAL AEGON	100%	2,29%	0,98%	-0,98%	0,00%	-0,67%	2,85%	11,07%	21,33%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	43.453.459,92	37,71%	VINCI	100%	1,45%	0,84%	0,82%	2,40%	1,21%	6,53%	14,58%	23,16%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,40%	1,36%	2,92%	2,36%	6,97%	16,06%	27,44%	
Renda Fixa	19.035.697,97	16,52%				0,40%							
BB PREV RF IRF M FI	3.195.076,73	2,77%	BB	0,06%	2,38%	1,38%	2,35%	4,51%	3,88%	10,99%	25,54%	38,26%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	14.909.751,17	12,94%	ITAU	0,08%	0,01%	0,23%	0,82%	1,83%	1,46%	4,71%	11,22%	19,67%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	768.530,10	0,67%	NOVERO	1,44%	0,05%	-0,18%	4,48%	3,82%	3,94%	-0,32%	-29,17%	-57,86%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	162.339,97	0,14%	NOVERO	5,36%	0,24%	0,04%	-81,67%	-81,72%	-81,70%	-87,27%	-87,42%	-91,59%	
Benchmark:	CDI					0,24%	0,87%	1,93%	1,54%	4,88%	11,57%	20,14%	
Renda Variável	12.848.437,41	11,15%				8,31%	-20,13%	-17,87%	-25,30%	-3,60%	23,89%		
Benchmark:	IBOVESPA					8,57%	-16,10%	-19,25%	-24,42%	-9,92%	13,87%	39,37%	
Renda Variável	12.848.437,41	11,15%				4,95%							
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	3.878.140,26	3,37%	BC GESTAO	1,05%	28,93%	7,65%	-24,45%	-22,00%	-28,79%	-5,60%	29,39%	55,07%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4.241.555,91	3,68%	CONSTANCIA	0,60%	25,51%	6,15%	-20,88%	-14,68%	-23,90%	2,09%	38,74%	72,32%	
MOAT CAPITAL FIC FIA	3.224.861,53	2,80%	MOAT CAPITAL	0,18%	41,58%	12,34%	-13,31%	-14,49%	-21,42%	2,19%	37,34%	102,81%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	1.503.879,71	1,31%	SANTANDER	0,21%	29,96%	7,94%	-19,69%	-22,08%	-27,61%	-12,74%	9,31%	31,67%	
Benchmark:	IBOVESPA					8,57%	-16,10%	-19,25%	-24,42%	-9,92%	13,87%	39,37%	
Total	115.223.865,99	100%				4,64%	1,60%	-3,19%	-1,78%	-3,76%	2,28%	11,06%	19,81%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					0,07%	0,69%	3,28%	1,70%	6,21%	15,82%	22,62%	

* 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.

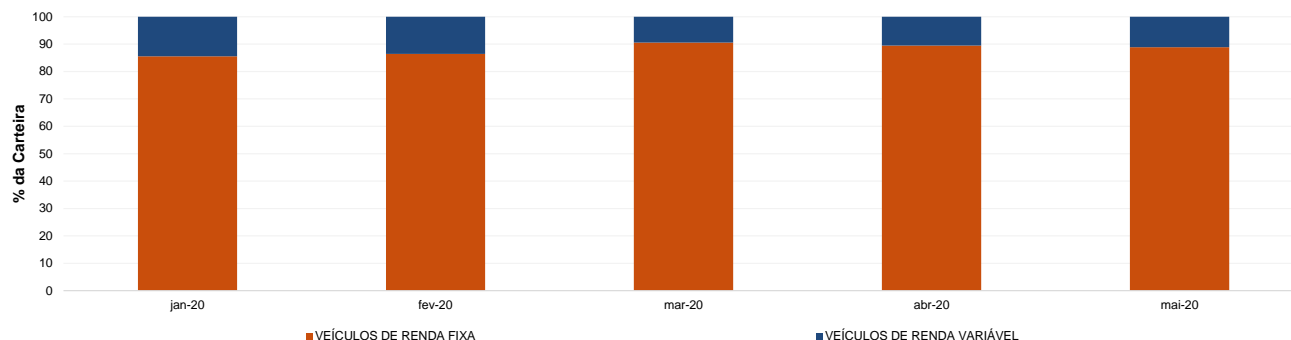
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

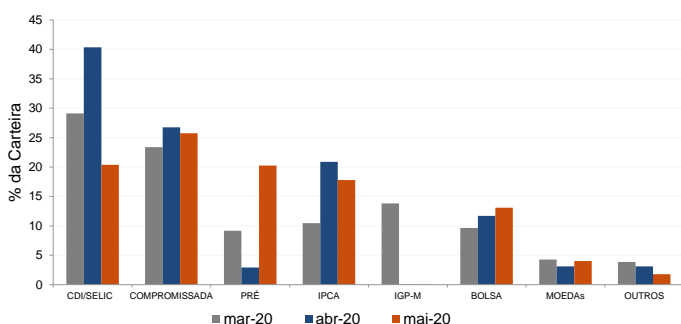
Distribuição da Carteira

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.

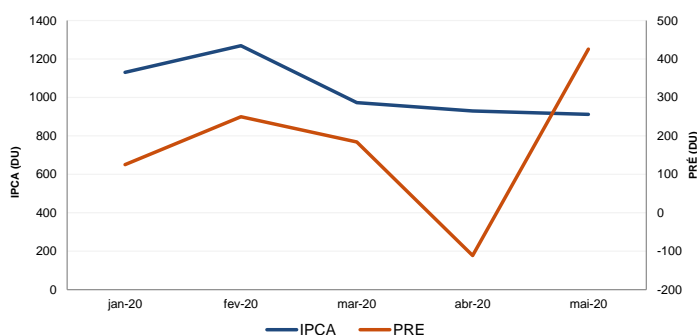
Evolução do Patrimônio Líquido



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	705,31	4,91	600,18	4,32
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	584,91	4,07	520,49	3,75
ITUB4	Intermediários Financeiros	417,76	2,91	235,57	1,70
SULA11	Previdência e Seguros	415,07	2,89	435,36	3,14
MGLU3	Comércio	390,10	2,72	307,53	2,22
VVAR3	Comércio	388,97	2,71	350,63	2,53
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	383,86	2,67	320,93	2,31
BBAS3	Intermediários Financeiros	366,04	2,55	323,40	2,33
ALUP11	Energia Elétrica	330,30	2,30	301,53	2,17
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	292,28	2,04	314,75	2,27

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

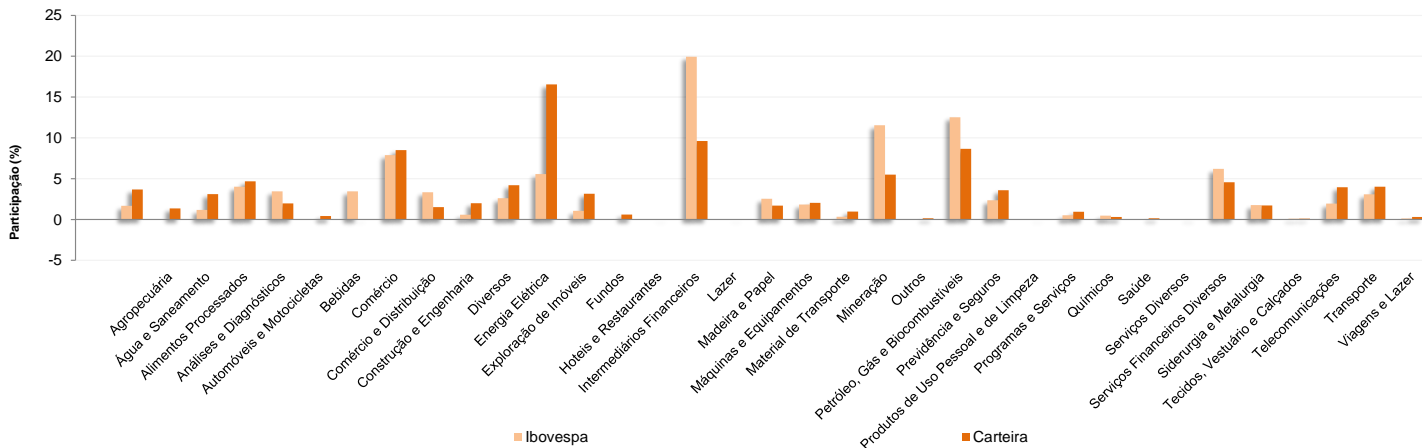
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	8,41	0,06	0,01	9
VALE3	705,31	4,91	0,00	1
B3SA3	584,91	4,07	0,00	1
ITUB4	417,76	2,91	0,00	1
SULA11	415,07	2,89	0,00	1
MGLU3	390,10	2,72	0,00	1
VVAR3	388,97	2,71	0,00	1
PETR4	383,86	2,67	0,00	1
BBAS3	366,04	2,55	0,00	1
ALUP11	330,30	2,30	0,01	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.



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.

Análises de Contrapartes

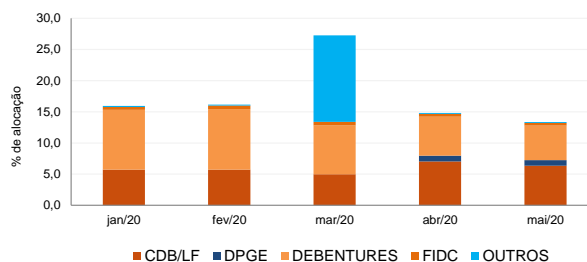
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	2.335,72	1,99	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.801,47	1,54	Faixa 1
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.078,68	0,92	Faixa 2
BANCO AGIBANK S.A.	1.065,81	0,91	Faixa 4
IOCHPE MAXION SA	897,04	0,77	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	837,33	0,72	Faixa 2
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	755,42	0,65	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	719,99	0,61	Faixa 2
VALE SA	705,31	0,60	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	695,97	0,59	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: 29/05/2020

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 2021-09-01	01-set-21	2.125.808	1,82%	Selic	29-mai-20	0,02%	0,02%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
LFT 2024-03-01	01-mar-24	4.247.667	3,63%	Selic	22-mai-20	0,03%	0,00%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.136.171	0,97%	IPCA	15-mai-20	2,21%	1,96%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.102.423	0,94%	IPCA	14-mai-20	2,11%	2,05%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	896.188	0,77%	IPCA	19-mai-20	1,83%	1,75%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	870.570	0,74%	IPCA	27-mai-20	2,36%	2,33%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P

