

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/06/2020

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	103.131.998,42	87,30%				0,74%	1,88%	0,61%	0,61%	3,92%	11,90%	18,14%	
Benchmark:	CDI					0,22%	0,74%	1,76%	1,76%	4,62%	11,23%	19,43%	
Multimercados Institucionais	84.037.720,39	71,13%				1,86%							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	40.176.863,30	34,01%	MONGERAL AEGON	100%	2,26%	0,73%	1,01%	0,05%	0,05%	2,97%	11,14%	21,18%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	43.860.857,09	37,13%	VINCI	100%	1,71%	0,93%	3,05%	2,15%	2,15%	6,27%	15,00%	23,27%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,38%	1,22%	2,75%	2,75%	6,72%	15,71%	26,69%	
Renda Fixa	19.094.278,03	16,16%				0,29%							
BB PREV RF IRF M FI	3.219.741,92	2,73%	BB	0,06%	1,71%	0,77%	3,26%	4,68%	4,68%	9,51%	26,49%	37,50%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	14.939.990,46	12,65%	ITAU	0,08%	0,01%	0,20%	0,70%	1,67%	1,67%	4,44%	10,89%	18,91%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	772.633,20	0,65%	NOVERO	1,44%	0,05%	0,53%	0,11%	4,50%	4,50%	0,47%	-29,00%	-57,68%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	161.912,45	0,14%	NOVERO	5,36%	0,00%	-0,26%	-0,03%	-81,75%	-81,75%	-82,06%	-87,45%	-91,61%	
Benchmark:	CDI					0,22%	0,74%	1,76%	1,76%	4,62%	11,23%	19,43%	
Renda Variável	15.009.274,17	12,70%				10,20%	34,99%	-17,68%	-17,68%	1,32%	43,89%		
Benchmark:	IBOVESPA					8,76%	30,18%	-17,80%	-17,80%	-5,85%	30,64%	51,12%	
Renda Variável	15.009.274,17	12,70%				4,68%							
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	4.349.097,02	3,68%	BC GESTAO	0,62%	28,33%	12,14%	35,63%	-20,15%	-20,15%	1,34%	50,62%	70,04%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4.538.506,47	3,84%	CONSTANCIA	0,51%	22,70%	7,00%	23,70%	-18,57%	-18,57%	3,90%	55,68%	83,46%	
MOAT CAPITAL FIC FIA	3.885.621,44	3,29%	MOAT CAPITAL	0,19%	41,20%	12,72%	53,89%	-11,42%	-11,42%	9,27%	63,39%	128,36%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2.236.049,24	1,89%	SANTANDER	0,30%	28,19%	7,70%	29,43%	-22,03%	-22,03%	-9,48%	24,10%	41,38%	
Benchmark:	IBOVESPA					8,76%	30,18%	-17,80%	-17,80%	-5,85%	30,64%	51,12%	
Total	118.141.272,59	100%				5,09%	1,79%	5,00%	-2,03%	-2,03%	3,49%	12,56%	20,90%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					0,64%	0,79%	2,34%	2,34%	6,55%	14,53%	23,36%	

* 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.

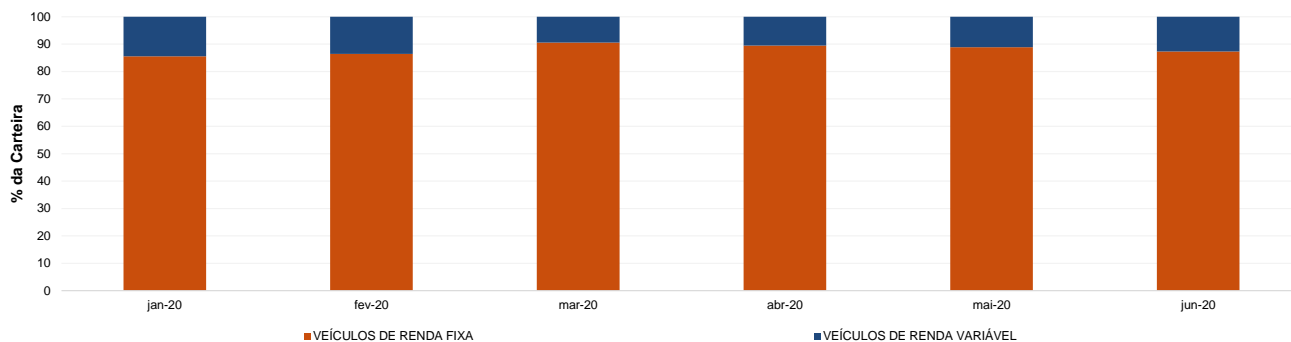
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

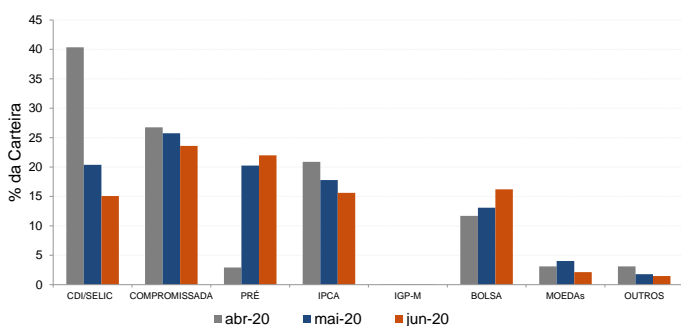
Distribuição da Carteira

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.

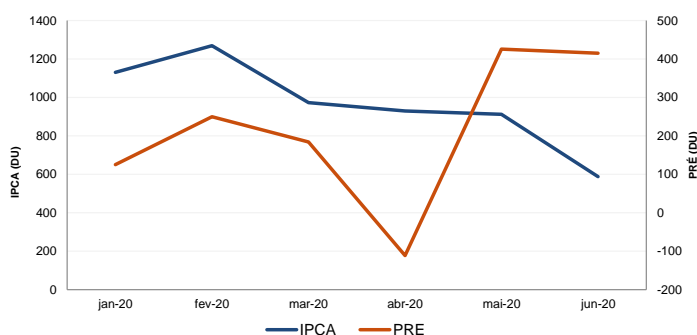
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	788,97	4,71	705,31	4,91
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	720,37	4,30	584,91	4,07
VVAR3	Comércio	642,39	3,83	388,97	2,71
ITUB4	Intermediários Financeiros	562,13	3,35	417,76	2,91
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	482,96	2,88	383,86	2,67
BBAS3	Intermediários Financeiros	428,53	2,56	366,04	2,55
SULA11	Previdência e Seguros	390,04	2,33	415,07	2,89
TIMP3	Telecomunicações	342,53	2,04	252,40	1,76
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	341,99	2,04	292,28	2,04
ALUP11	Energia Elétrica	328,10	1,96	330,30	2,30

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

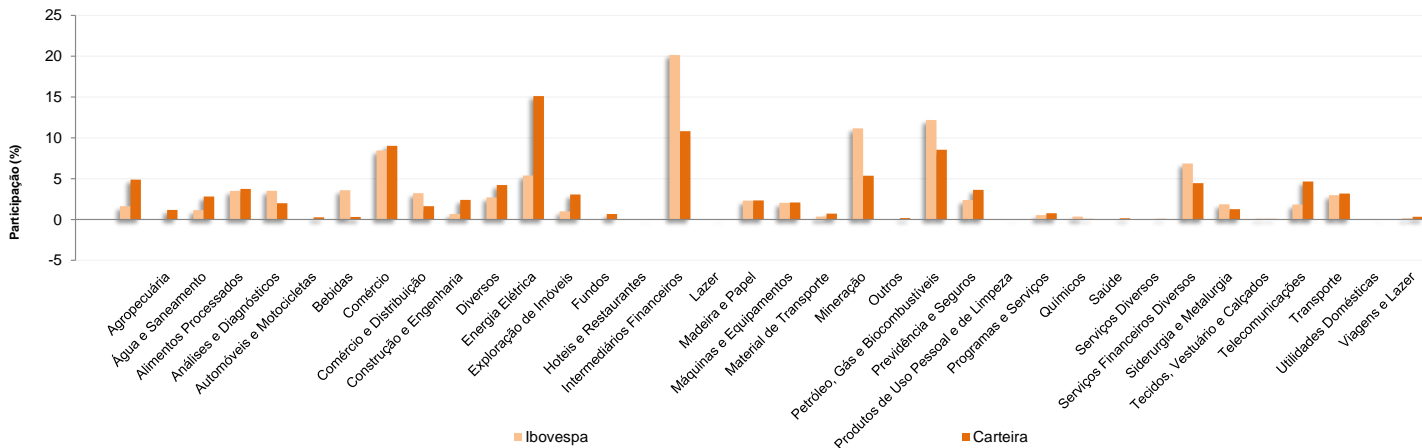
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BPAC13	27,95	0,17	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	6,96	0,04	0,01	2
VALE3	788,97	4,71	0,00	1
B3SA3	720,37	4,30	0,00	1
VVAR3	642,39	3,83	0,00	1
ITUB4	562,13	3,35	0,00	1
PETR4	482,96	2,88	0,00	1
BBAS3	428,53	2,56	0,00	1
SULA11	390,04	2,33	0,00	1
TIMP3	342,53	2,04	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.



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.

Análises de Contrapartes

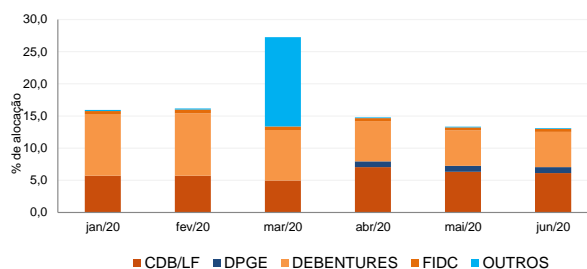
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	2.419,75	2,04	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.805,55	1,52	Faixa 2
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.086,29	0,92	Faixa 2
BANCO AGIBANK S.A.	1.077,61	0,91	Faixa 4
IOCHPE MAXION SA	888,75	0,75	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	868,81	0,73	Faixa 2
BCO DAYCOVAL SA	838,65	0,71	Faixa 2
VALE SA	788,97	0,67	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA SA)	756,57	0,64	Faixa 2
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	720,37	0,61	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: 30/06/2020

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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
CMTR33	15-fev-22	38.000	0,03%	IPCA	CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	17-jun-20	3,99%	Faixa 4	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
CMTR33	15-fev-22	32.571	0,03%	IPCA	CEMIG GERACAO TRANSMISSAO SA	24-jun-20	3,80%	Faixa 4	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	1.314.141	1,11%	IPCA	19-jun-20	0,30%	-0,43%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	1.121.400	0,95%	IPCA	25-jun-20	0,43%	-0,59%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	480.099	0,40%	IPCA	30-jun-20	0,47%	-0,52%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.327.824	1,12%	IPCA	02-jun-20	2,27%	2,18%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	234.322	0,20%	IPCA	17-jun-20	2,14%	2,12%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P