

## OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/07/2020

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	
<b>Renda Fixa</b>	<b>103.566.675,77</b>	<b>85,63%</b>				<b>0,81%</b>	<b>2,38%</b>	<b>1,00%</b>	<b>1,43%</b>	<b>4,08%</b>	<b>12,01%</b>	<b>18,25%</b>	
Benchmark:	CDI					0,19%	0,65%	1,58%	1,96%	4,23%	10,85%	18,71%	
<b>Multimercados Institucionais</b>	<b>84.812.419,69</b>	<b>70,12%</b>			<b>0,60%</b>								
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	40.627.496,63	33,59%	MONGERAL AEGON	100%	0,54%	1,12%	2,86%	0,69%	1,17%	3,46%	11,51%	21,29%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	44.184.923,06	36,53%	VINCI	100%	0,78%	0,74%	2,54%	2,52%	2,91%	6,25%	15,23%	23,06%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,38%	1,16%	2,57%	3,14%	6,32%	15,32%	25,94%	
<b>Renda Fixa</b>	<b>18.754.256,08</b>	<b>15,51%</b>			<b>0,18%</b>								
BB PREV RF IRF M FI	3.256.002,63	2,69%	BB	0,06%	1,01%	1,13%	3,31%	4,96%	5,86%	9,57%	26,04%	35,92%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	14.967.016,03	12,37%	ITAU	0,07%	0,01%	0,18%	0,61%	1,49%	1,85%	4,06%	10,50%	18,17%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	369.845,16	0,31%	NOVERO	1,44%		-0,17%	0,18%	4,45%	4,32%	1,82%	-28,43%	-54,07%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	161.392,26	0,13%	NOVERO	5,36%	0,00%	-0,32%	-0,54%	-81,79%	-81,81%	-82,10%	-87,48%	-91,63%	
Benchmark:	CDI					0,19%	0,65%	1,58%	1,96%	4,23%	10,85%	18,71%	
<b>Renda Variável</b>	<b>16.982.649,71</b>	<b>14,04%</b>				<b>10,03%</b>	<b>31,34%</b>	<b>-9,97%</b>	<b>-9,43%</b>	<b>8,16%</b>	<b>46,13%</b>		
Benchmark:	IBOVESPA					8,27%	27,83%	-9,54%	-11,01%	1,08%	29,91%	56,12%	
<b>Renda Variável</b>	<b>16.982.649,71</b>	<b>14,04%</b>			<b>1,37%</b>								
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	4.788.567,89	3,96%	BC GESTAO	0,92%	11,01%	10,10%	32,92%	-12,95%	-12,08%	6,90%	58,85%	79,63%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4.922.322,89	4,07%	CONSTANCIA	0,49%	8,78%	8,46%	23,19%	-13,17%	-11,68%	7,17%	56,52%	90,09%	
MOAT CAPITAL FIC FIA	4.842.194,71	4,00%	MOAT CAPITAL	0,20%	13,65%	12,57%	42,56%	0,39%	-0,28%	16,41%	68,44%	133,19%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2.429.564,21	2,01%	SANTANDER	0,29%	9,98%	8,65%	26,32%	-14,45%	-15,28%	-2,38%	24,16%	46,90%	
Benchmark:	IBOVESPA					8,27%	27,83%	-9,54%	-11,01%	1,08%	29,91%	56,12%	
<b>Imobiliário</b>	<b>401.582,61</b>	<b>0,33%</b>				<b>-0,07%</b>							
Benchmark:	INPC					0,44%	0,49%	0,61%	0,80%	2,69%	5,94%	9,76%	
<b>FII</b>	<b>401.582,61</b>	<b>0,33%</b>											
SÃO FRANCISCO 34 FII	401.582,61	0,33%		0,00%		-0,12%	-0,38%	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IFIX					-2,61%	4,97%	-11,18%	-14,53%	2,77%	26,86%	32,29%	
<b>Total</b>	<b>120.950.908,10</b>	<b>100%</b>				<b>1,92%</b>	<b>1,98%</b>	<b>5,47%</b>	<b>-0,53%</b>	<b>-0,09%</b>	<b>4,63%</b>	<b>13,71%</b>	<b>21,85%</b>
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					0,81%	1,52%	2,61%	3,17%	6,91%	14,76%	23,73%	

\* 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.

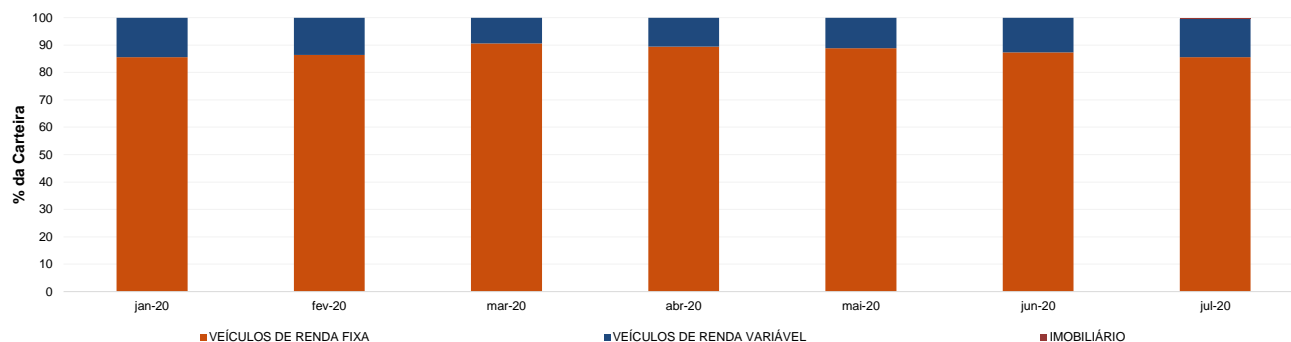
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

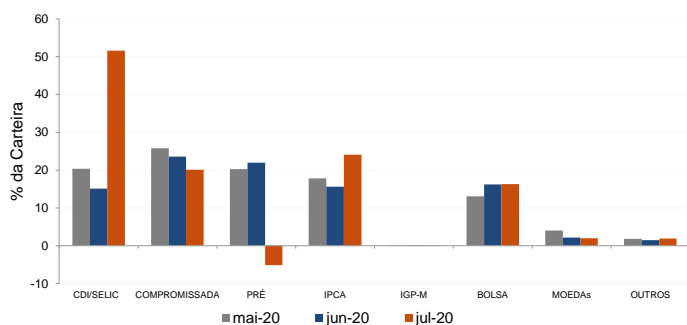
## Distribuição da Carteira

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.

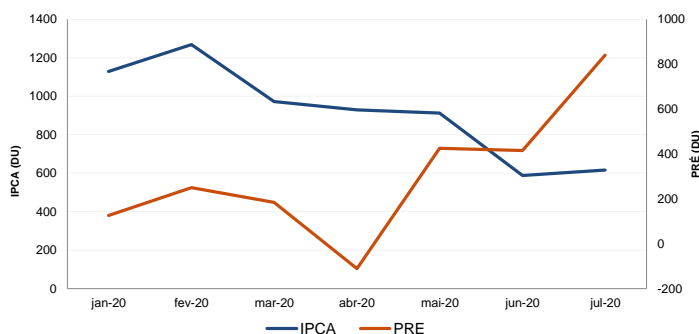
## Evolução do Patrimônio Líquido



## 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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	939,34	4,78	788,97	4,71
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	829,13	4,22	720,37	4,30
ITUB4	Intermediários Financeiros	814,52	4,14	562,13	3,35
VVAR3	Comércio	742,88	3,78	642,39	3,83
LAME4	Comércio	513,75	2,61	231,61	1,38
BBAS3	Intermediários Financeiros	513,41	2,61	428,53	2,56
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	491,72	2,50	482,96	2,88
SULA11	Previdência e Seguros	434,79	2,21	390,04	2,33
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	421,85	2,15	341,99	2,04
TIMP3	Telecomunicações	411,47	2,09	342,53	2,04

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

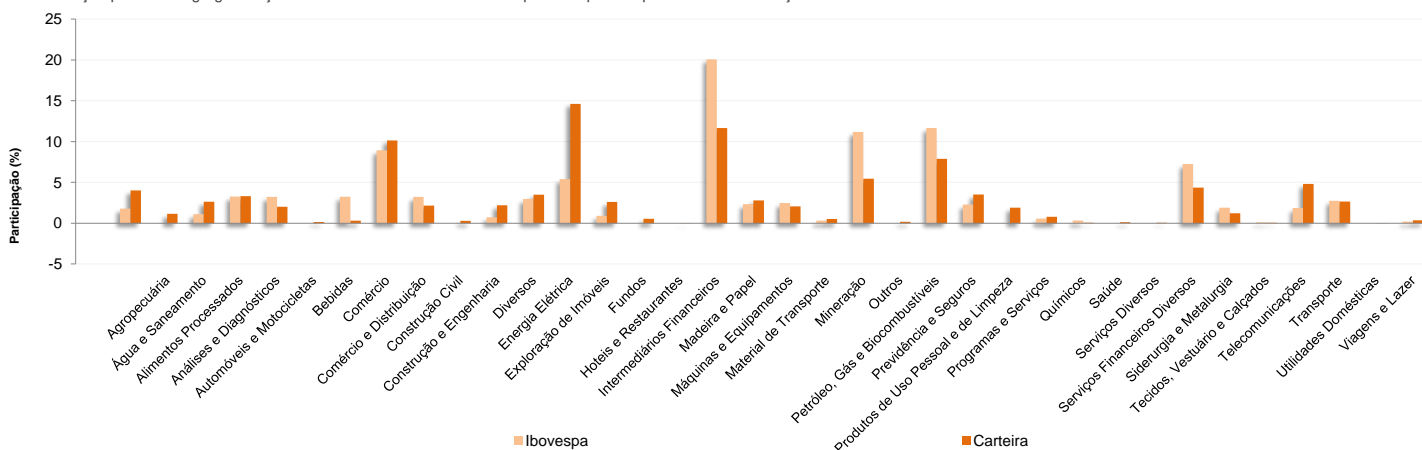
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	6,97	0,04	0,01	2
VALE3	939,34	4,78	0,00	1
B3SA3	829,13	4,22	0,00	1
ITUB4	814,52	4,14	0,00	1
VVAR3	742,88	3,78	0,00	1
LAME4	513,75	2,61	0,00	1
BBAS3	513,41	2,61	0,00	1
PETR4	491,72	2,50	0,00	1
SULA11	434,79	2,21	0,00	1
PETR3	421,85	2,15	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: 31/07/2020

## Análises de Contrapartes

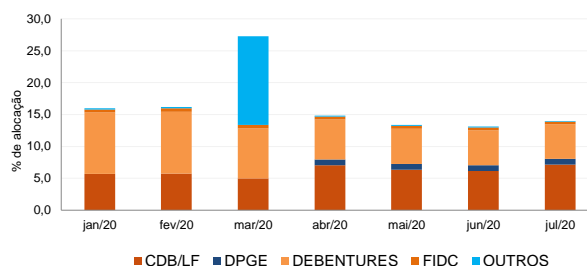
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	2.595,81	2,13	Faixa 2
BCO SAFRA SA	2.083,81	1,71	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.809,25	1,48	Faixa 2
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.098,82	0,90	Faixa 2
BANCO AGIBANK S.A.	1.085,30	0,89	Faixa 4
LOJAS AMERICANAS SA	957,76	0,79	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	953,18	0,78	Faixa 2
VALE SA	939,34	0,77	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	837,72	0,69	Faixa 2
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	829,13	0,68	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
IGSN15	25,97	IGUA SANEAMENTO SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-jul-34	IPCA	6,10%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
LAME19	333,31	LOJAS AMERICANAS SA	Faixa 2	Faixa 1	25-jun-24	CDI	113,00%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULTI
LAMEA2	13,18	LOJAS AMERICANAS SA	Faixa 2	Faixa 1	20-abr-23	CDI	116,00%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
LAMEA4	19,76	LOJAS AMERICANAS SA	Faixa 2	Faixa 1	18-mai-23	CDI	3,00%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
LIGHA9	22,87	LIGHT SERVICOS ELETRICIDADE SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-jul-25	IPCA	5,80%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
MULP18	10,99	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS S/	Sem Faixa	Faixa 1	30-jun-26	CDI	3,00%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
NP CDI	64,21	LOJAS AMERICANAS SA	Faixa 2	Faixa 1	28-jun-22	CDI	115,30%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
NP CDI	5,35	LOJAS AMERICANAS SA	Faixa 2	Faixa 1	28-jun-22	CDI	115,30%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/07/2020

## 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
LF IPCA	11-out-21	1.624.856	1,33%	IPCA	BCO SAFRA SA	07-jul-20	2,10%	Faixa 2	VINCI OABPREVGO TO FI MULT CRED P

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2026-09-01	01-set-26	32.406	0,03%	Selic		31-jul-20	4,00%	0,04%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2022-04-01	01-abr-22	9.668	0,01%	PRE		13-jul-20	3,40%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2022-04-01	01-abr-22	9.668	0,01%	PRE		13-jul-20	3,40%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2022-04-01	01-abr-22	9.668	0,01%	PRE		13-jul-20	3,40%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2024-01-01	01-jan-24	8.710	0,01%	PRE		13-jul-20	5,12%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2024-01-01	01-jan-24	8.710	0,01%	PRE		13-jul-20	5,12%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2024-01-01	01-jan-24	8.709	0,01%	PRE		13-jul-20	5,12%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	2.822.958	2,32%	IPCA		22-jul-20	0,68%	-0,68%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	481.625	0,40%	IPCA		01-jul-20	0,46%	-0,59%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.471.664	1,21%	IPCA		06-jul-20	1,86%	1,92%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.439.672	1,18%	IPCA		07-jul-20	1,85%	1,97%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.439.672	1,18%	IPCA		08-jul-20	1,89%	1,98%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML

