

## OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/08/2019

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
<b>Renda Fixa</b>	<b>98.659.993,89</b>	<b>87,18%</b>				<b>0,31%</b>	<b>1,38%</b>	<b>3,21%</b>	<b>4,60%</b>	<b>7,37%</b>	<b>13,32%</b>	<b>26,37%</b>
Benchmark:	CDI					0,50%	1,55%	3,11%	4,18%	6,28%	13,55%	27,25%
<b>Multimercados</b>	<b>79.385.218,30</b>	<b>70,15%</b>			<b>0,85%</b>							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	38.573.537,95	34,08%	MONGERAL AEGON	100%	0,58%	0,42%	1,68%	3,60%	4,99%	7,83%	16,45%	30,56%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	40.811.680,35	36,06%	VINCI	100%	1,12%	0,19%	2,15%	3,92%	5,77%	8,14%	15,10%	28,80%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,68%	2,06%	4,14%	5,57%	8,38%	18,09%	34,98%
<b>Renda Fixa</b>	<b>19.274.775,59</b>	<b>17,03%</b>			<b>0,20%</b>							
BB PREV RF IRF M FI	2.526.049,20	2,23%	BB	0,05%	1,55%	0,24%	3,48%	6,51%	8,26%	16,43%	23,07%	44,90%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	15.091.578,47	13,34%	ITAU	0,13%	0,00%	0,49%	1,51%	3,03%	4,08%	6,13%	13,23%	26,78%
NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	756.634,38	0,67%	NOVERO	1,44%	0,07%	-0,12%	-1,86%	-2,24%	-13,47%	-27,33%	-55,21%	-51,66%
DELTA CRED PRIV FC FIRF	900.513,54	0,80%	NOVERO	5,36%	0,03%	-0,10%	-29,36%	-29,64%	-29,87%	-30,10%	-53,29%	-53,39%
Benchmark:	CDI					0,50%	1,55%	3,11%	4,18%	6,28%	13,55%	27,25%
<b>Renda Variável</b>	<b>14.510.005,45</b>	<b>12,82%</b>				<b>0,74%</b>	<b>8,86%</b>	<b>10,74%</b>	<b>20,86%</b>	<b>47,76%</b>		
Benchmark:	IBOVESPA					-0,67%	4,23%	5,81%	15,07%	31,90%	42,77%	74,67%
<b>Renda Variável</b>	<b>14.510.005,45</b>	<b>12,82%</b>			<b>2,34%</b>							
BRASIL CAPITAL 30 FC FIA	4.552.350,78	4,02%	BC GESTAO	0,43%	5,89%	1,62%	10,81%	15,51%	30,45%	57,00%	60,34%	97,00%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4.638.082,25	4,10%	CONSTANCIA	1,52%	6,34%	0,98%	11,64%	13,96%	25,56%	51,68%	64,41%	113,02%
MOAT CAPITAL FIC FIA	3.512.735,37	3,10%	MOAT CAPITAL	0,14%	7,65%	-0,08%	11,31%	13,04%	23,13%	54,71%	83,25%	158,05%
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	1.806.837,05	1,60%	SANTANDER	0,29%	6,46%	0,22%	4,84%	6,96%	15,54%	33,60%	40,96%	71,96%
Benchmark:	IBOVESPA					-0,67%	4,23%	5,81%	15,07%	31,90%	42,77%	74,67%
<b>Total</b>	<b>113.169.999,34</b>	<b>100%</b>			<b>1,39%</b>	<b>0,31%</b>	<b>1,72%</b>	<b>3,45%</b>	<b>5,04%</b>	<b>8,17%</b>	<b>14,85%</b>	<b>29,16%</b>
Benchmark:	INPC + 4.19% a.a.					0,48%	1,28%	3,87%	5,53%	7,56%	16,11%	23,05%

\* 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.

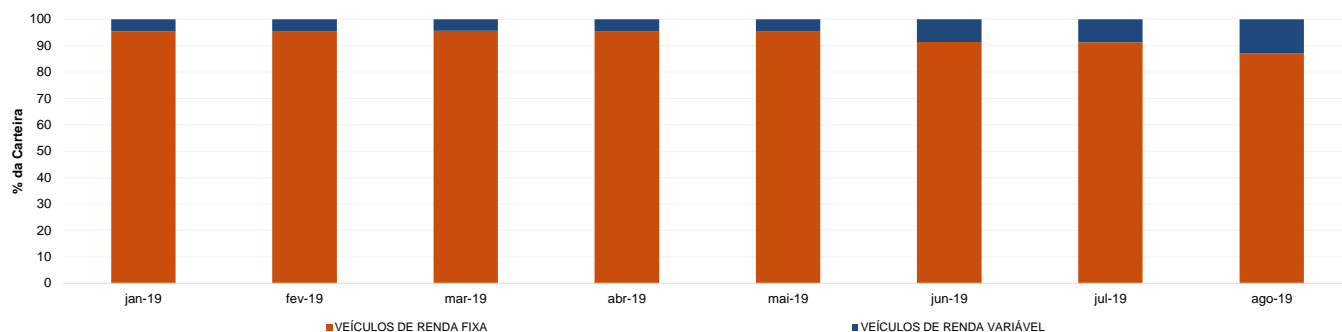
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

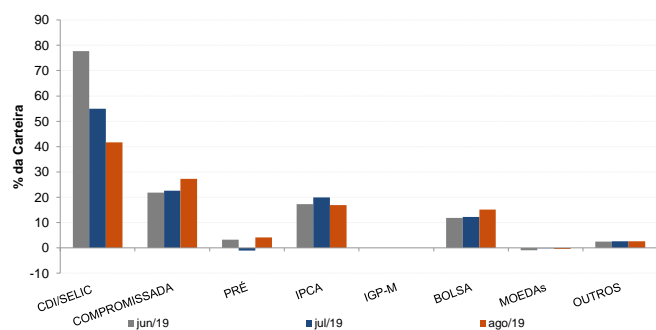
## Distribuição da Carteira

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.

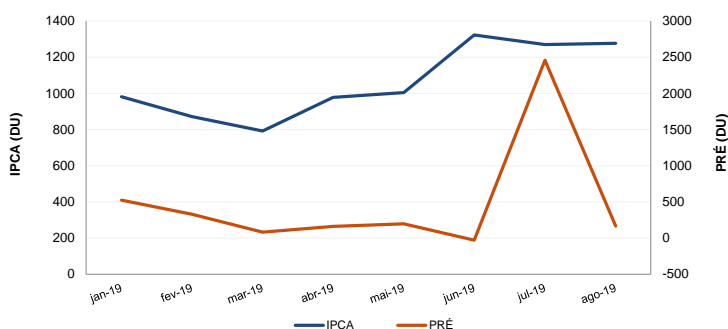
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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*	%
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	1.086,90	6,03	694,42	5,02
VALE3	Mineração	572,55	3,18	596,23	4,31
ALUP11	Energia Elétrica	540,88	3,00	216,48	1,56
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	517,28	2,87	243,54	1,76
CVCB3	Viagens e Lazer	498,75	2,77	37,92	0,27
BBAS3	Intermediários Financeiros	484,75	2,69	405,49	2,93
ALSO3		484,51	2,69	0,00	
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	473,03	2,63	65,24	0,47
ITSA4	Intermediários Financeiros	467,77	2,60	142,21	1,03
ITUB4	Intermediários Financeiros	438,46	2,43	320,60	2,32

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

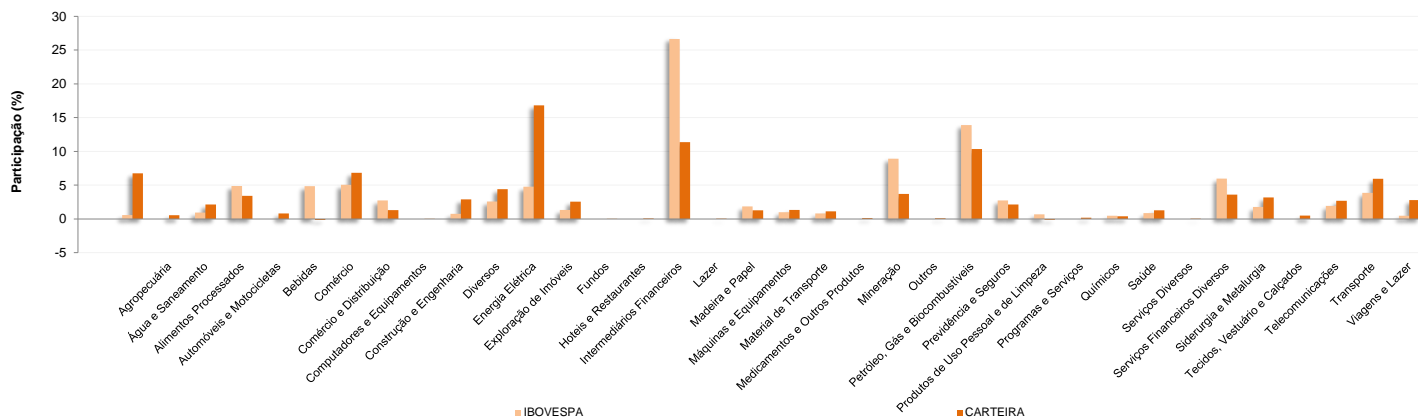
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	15,33	0,09	0,01	12
PPLA11	39,38	0,22	0,00	2
MTSA4	35,07	0,19	0,06	2
PETRA4	1.086,90	6,03	0,00	1
VALE3	572,55	3,18	0,00	1
ALUP11	540,88	3,00	0,01	1
B3SA3	517,28	2,87	0,00	1
CVCB3	498,75	2,77	0,01	1
BBAS3	484,75	2,69	0,00	1
ALSO3	484,51	2,69	0,01	1

\* em mil R\$

### Concentração por setor

A concentração por setor segregava 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: 30/08/2019

## Análises de Contrapartes

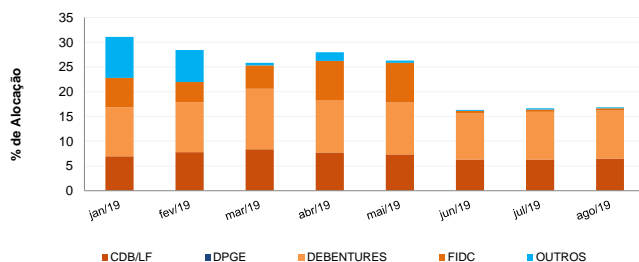
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

### Empresas Emisoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BANCO RCI BRASIL SA	1.821,33	1,59		Aaa.br	
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.281,20	1,12	AA (bra)		brAAA
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.276,41	1,11	AA+ (bra)		
BCO BRADESCO SA	1.219,26	1,06	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
IOCHPE MAXION SA	1.082,00	0,94			brAAA
BCO DAYCOVAL SA	997,68	0,87	AA (bra)	Aa2.br	brAA+
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM <sup>A</sup> )	876,16	0,76	AAA (bra)	Aa2.br	brAAA
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INV)	740,98	0,65	AA (bra)	Aa1.br	
BCO SAFRA SA	739,83	0,64		Aa1.br	brAAA
LOCALIZA RENT A CAR SA	699,41	0,61	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA

\* em mil R\$

### Alocação Por Tipo de Crédito



## Mudanças de Rating no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês. As alterações são cheçadas primeiro verificando o rating da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Anterior	Atual	Agência	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
CPGT13	18,38	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	AA- (bra)	AA (bra)	Fitch	20-out-22	CDI	126,00%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CPLE17	19,78	CIA PARANAENSE ENERGIA COPEL	AA- (bra)	AA (bra)	Fitch	19-jan-21	CDI	119,00%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
SNGO14	25,11	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	BBB+ (bra)	A- (bra)	Fitch	15-dez-21	CDI	2,16%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SNGO14	1,63	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	BBB+ (bra)	A- (bra)	Fitch	15-dez-21	CDI	2,19%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SNGO14	11,64	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	BBB+ (bra)	A- (bra)	Fitch	15-dez-21	CDI	1,58%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SNGO15	7,70	SANEAMENTO GOIAS SA SANEAGO	BBB+ (bra)	A- (bra)	Fitch	15-nov-23	CDI	2,62%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base:

30/08/2019

## 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.

No caso dos ratings, é apresentada a nota da emissão e, em caso de inexistência de nota, apresenta-se a nota do emissor.

Títulos Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Rating	Agência	Veículo
LORTB3	15-fev-25	283.566	0,25%	CDI	LOCALIZA RENT A CAR SA	12-ago-19	111,30%	AAA (bra)	Fitch	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT
NATUC0	26-ago-24	157.654	0,14%	CDI	NATURA COSMETICOS SA	29-ago-19	1,39%	brAAA	S&P	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2025-09-01	01-set-25	2.981.988	2,60%	Selic		23-ago-19	0,02%	0,02%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT
LFT 2025-09-01	01-set-25	4.980	0,00%	Selic		09-ago-19	0,02%	0,02%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2021-10-01	01-out-21	6.432	0,01%	PRE		07-ago-19	5,90%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	1.789.374	1,56%	IPCA		05-ago-19	2,84%	2,95%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	13.550	0,01%	IPCA		30-ago-19	6,00%	3,60%	NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO

