

## OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/09/2019

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>99.779.154,86</b>	<b>86,99%</b>				<b>0,68%</b>	<b>1,65%</b>	<b>3,44%</b>	<b>5,31%</b>	<b>7,46%</b>	<b>13,24%</b>	<b>26,12%</b>
Benchmark:	CDI					0,47%	1,54%	3,11%	4,67%	6,28%	13,35%	26,45%
<b>Multimercados</b>	<b>80.403.221,48</b>	<b>70,10%</b>				<b>0,79%</b>						
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	39.006.279,92	34,01%	MONGERAL AEGON	100%	0,65%	0,54%	1,61%	3,54%	5,55%	7,81%	16,12%	30,00%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	41.396.941,56	36,09%	VINCI	100%	0,94%	0,88%	1,83%	4,55%	6,70%	8,62%	15,28%	28,45%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,63%	2,07%	4,15%	6,23%	8,39%	17,90%	34,12%
<b>Renda Fixa</b>	<b>19.375.933,38</b>	<b>16,89%</b>				<b>0,13%</b>						
BB PREV RF IRF M FI	2.561.834,98	2,23%	BB	0,05%	1,01%	1,42%	2,75%	7,41%	9,80%	16,58%	23,02%	44,13%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	15.159.977,98	13,22%	ITAU	0,12%	0,00%	0,45%	1,51%	3,03%	4,55%	6,12%	13,03%	25,98%
NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	754.959,36	0,66%	NOVERO	1,44%	0,02%	-0,22%	-1,83%	-2,36%	-13,66%	-27,50%	-55,44%	-52,24%
DELTA CRED PRIV FC FIRF	899.161,06	0,78%	NOVERO	5,36%	0,00%	-0,15%	-0,35%	-29,69%	-29,98%	-30,15%	-53,31%	-54,08%
Benchmark:	CDI					0,47%	1,54%	3,11%	4,67%	6,28%	13,35%	26,45%
<b>Renda Variável</b>	<b>14.921.237,71</b>	<b>13,01%</b>				<b>2,83%</b>	<b>6,77%</b>	<b>15,26%</b>	<b>24,28%</b>	<b>49,92%</b>		
Benchmark:	IBOVESPA					3,57%	3,74%	9,78%	19,18%	32,02%	40,99%	79,46%
<b>Renda Variável</b>	<b>14.921.237,71</b>	<b>13,01%</b>				<b>2,22%</b>						
BRASIL CAPITAL 30 FC FIA	4.736.698,98	4,13%	BC GESTAO	0,37%	5,30%	4,05%	10,37%	21,23%	35,73%	61,95%	59,84%	102,55%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4.702.671,05	4,10%	CONSTANCIA	1,59%	6,12%	1,39%	7,66%	17,52%	27,31%	56,80%	57,82%	115,07%
MOAT CAPITAL FIC FIA	3.624.524,97	3,16%	MOAT CAPITAL	0,13%	7,00%	3,18%	8,95%	18,43%	27,05%	59,34%	75,81%	164,98%
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	1.857.342,71	1,62%	SANTANDER	0,27%	5,88%	2,80%	3,80%	10,63%	18,77%	32,51%	36,03%	74,79%
Benchmark:	IBOVESPA					3,57%	3,74%	9,78%	19,18%	32,02%	40,99%	79,46%
<b>Total</b>	<b>114.700.392,57</b>	<b>100%</b>				<b>1,28%</b>	<b>0,92%</b>	<b>2,07%</b>	<b>4,04%</b>	<b>6,00%</b>	<b>8,50%</b>	<b>15,08%</b>
Benchmark:	INPC + 4,19% a.a.					0,29%	1,25%	3,06%	5,84%	7,22%	16,09%	22,89%

\* As rentabilidades dos fundos de investimentos foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.

O valor total apresentado é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

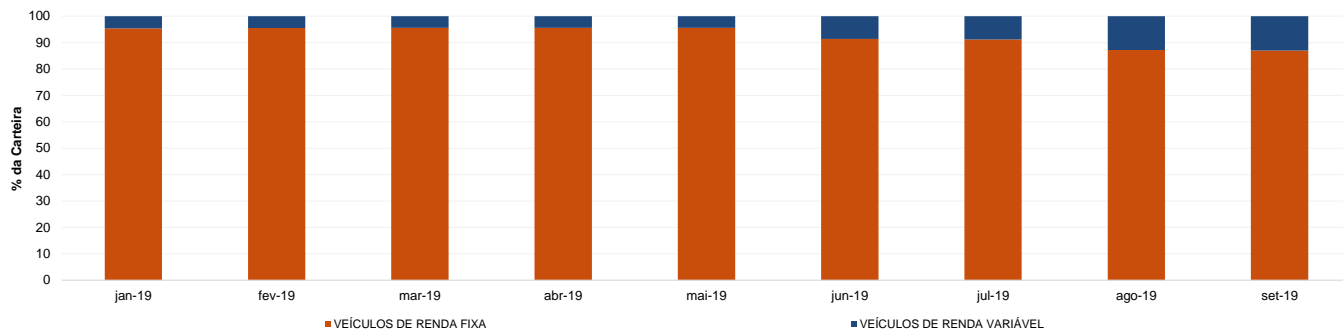
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

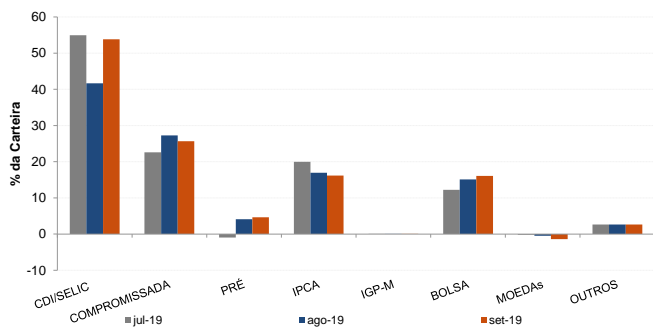
## Distribuição da Carteira

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.

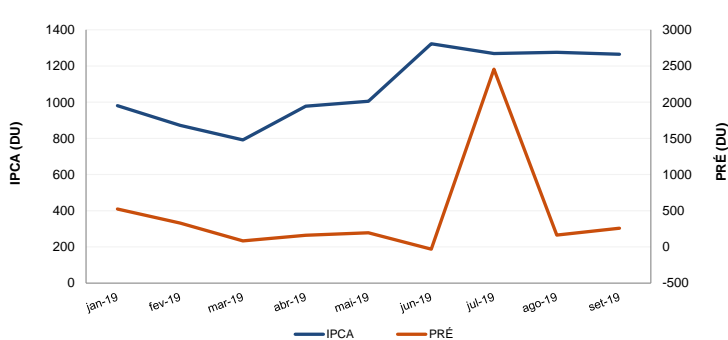
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	1.161,57	6,41	1.086,90	6,03
ITSA4	Intermediários Financeiros	544,28	3,01	467,77	2,60
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	541,10	2,99	473,03	2,63
VALE3	Mineração	521,26	2,88	572,55	3,18
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	473,24	2,61	517,28	2,87
ALSO3		470,21	2,60	484,51	2,69
ALUP11	Energia Elétrica	460,75	2,54	540,88	3,00
SULA11	Previdência e Seguros	409,38	2,26	158,99	0,88
ITUB4	Intermediários Financeiros	400,78	2,21	438,46	2,43
BBAS3	Intermediários Financeiros	374,54	2,07	484,75	2,69

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

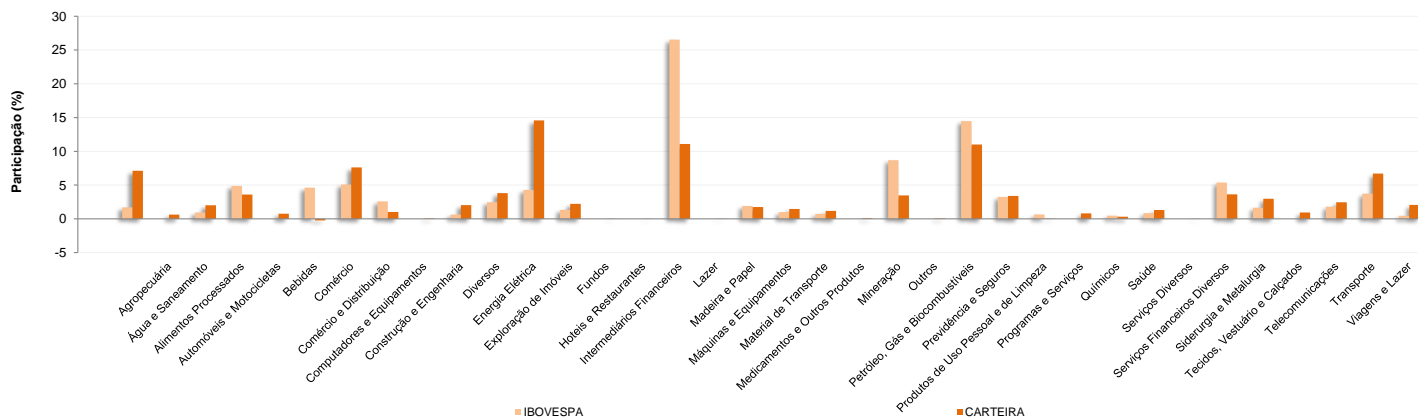
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
MTSA4	35,68	0,20	0,06	3
CRIV4	17,41	0,10	0,01	3
PPLA11	50,62	0,28	0,00	2
EMAE4	13,32	0,07	0,00	2
PETR4	1.161,57	6,41	0,00	1
ITSA4	544,28	3,01	0,00	1
CSAN3	541,10	2,99	0,01	1
VALE3	521,26	2,88	0,00	1
B3SA3	473,24	2,61	0,00	1
ALSO3	470,21	2,60	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: 30/09/2019

## Análises de Contrapartes

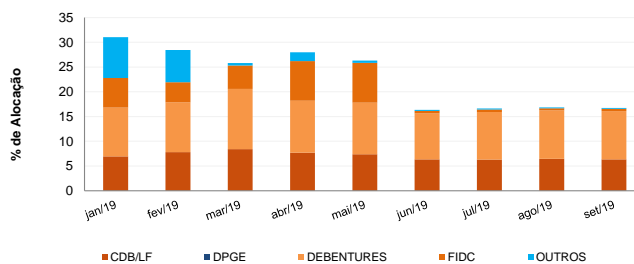
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição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

### Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
BANCO RCI BRASIL SA	1.749,71	1,51		Aaa.br	
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.415,13	1,22	AA (bra)		brAAA
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.282,55	1,10	AA+ (bra)		
BCO BRADESCO SA	1.171,85	1,01	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
IOCHPE MAXION SA	1.061,09	0,91			brAAA
BCO DAYCOVAL SA	959,01	0,83	AA (bra)	Aa2.br	brAA+
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM <sup>A</sup> )	859,53	0,74	AAA (bra)	Aa2.br	brAAA
LOJAS AMERICANAS SA	851,19	0,73	AA (bra)		
BCO SAFRA SA	765,02	0,66		Aa1.br	brAAA
GUARARAPES CONFECÇOES SA (EX CO	701,31	0,60	AA- (bra)		

\* 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 chegadas primeiro verificando o rating da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Anterior	Atual	Agência	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
------------------	-----------------	-------------	----------	-------	---------	-------	--------	------	---------

Nenhuma mudança de rating encontrada.

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base:

30/09/2019

## 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
LAME19	25-jun-24	224.541	0,19%	CDI	LOJAS AMERICANAS SA	30-set-19	113,00%	AA (bra)	Fitch	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	2.067.257	1,78%	Selic	25-set-19	0,02%	0,01%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	11.505	0,01%	IPCA	30-set-19	6,00%	1,96%	NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO

