

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/09/2020

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	104.682.210,88	86,85%				-0,25%	0,92%	2,82%	1,54%	3,18%	10,87%	16,84%	
Benchmark:	CDI					0,16%	0,51%	1,26%	2,29%	3,56%	10,06%	17,39%	
Multimercados Institucionais	89.161.522,19	73,97%				0,78%							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	42.235.041,24	35,04%	MONGERAL AEGON	100%	0,85%	-0,39%	1,12%	2,15%	1,18%	2,48%	10,48%	19,00%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	46.926.480,95	38,93%	VINCI	100%	0,84%	-0,20%	1,04%	4,13%	3,22%	5,44%	14,53%	21,56%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,32%	1,03%	2,27%	3,81%	5,63%	14,49%	24,53%	
Renda Fixa	15.520.688,69	12,88%				0,10%							
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	14.991.051,54	12,44%	ITAU	0,07%	0,10%	0,01%	0,34%	1,04%	2,02%	3,25%	9,57%	16,70%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	369.003,51	0,31%	NOVERO	1,44%		-0,11%	-0,40%	-0,43%	4,08%	1,94%	-26,09%	-54,58%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	160.633,64	0,13%	NOVERO	5,36%	0,00%	-0,24%	-0,79%	-0,82%	-81,89%	-82,14%	-87,52%	-91,66%	
Benchmark:	CDI					0,16%	0,51%	1,26%	2,29%	3,56%	10,06%	17,39%	
Renda Variável	15.448.382,91	12,82%				-5,43%	0,09%	35,11%	-17,61%	-5,02%	42,39%		
Benchmark:	IBOVESPA					-4,80%	-0,48%	29,56%	-18,20%	-9,68%	19,23%	27,34%	
Renda Variável	15.448.382,91	12,82%				1,50%							
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	4.476.824,82	3,71%	BC GESTAO	0,89%	13,43%	-4,68%	2,94%	39,62%	-17,80%	-5,49%	53,07%	51,07%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4.407.372,72	3,66%	CONSTANCIA	0,47%	9,72%	-4,50%	-2,89%	20,12%	-20,92%	-6,28%	46,96%	47,91%	
MOAT CAPITAL FIC FIA	4.305.611,14	3,57%	MOAT CAPITAL	0,19%	15,05%	-7,68%	0,10%	54,04%	-11,33%	0,39%	59,96%	76,50%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2.258.574,23	1,87%	SANTANDER	0,30%	11,36%	-4,26%	1,01%	30,73%	-21,25%	-11,91%	16,72%	19,83%	
Benchmark:	IBOVESPA					-4,80%	-0,48%	29,56%	-18,20%	-9,68%	19,23%	27,34%	
Imobiliário	400.781,32	0,33%				-0,10%	-0,27%						
Benchmark:	INPC					0,87%	1,68%	1,49%	2,04%	3,89%	6,93%	11,17%	
FII	400.781,32	0,33%											
SÃO FRANCISCO 34 FII	400.781,32	0,33%		0,96%		0,03%	-0,20%	-0,56%	-	-	-	-	
Benchmark:	IFIX					0,46%	-0,41%	12,06%	-12,59%	4,12%	30,92%	25,84%	
Total	120.531.375,11	100%				2,16%	-0,95%	0,79%	5,82%	-1,26%	2,07%	11,22%	18,35%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					1,21%	2,74%	3,55%	5,14%	8,14%	15,83%	25,30%	

* 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.

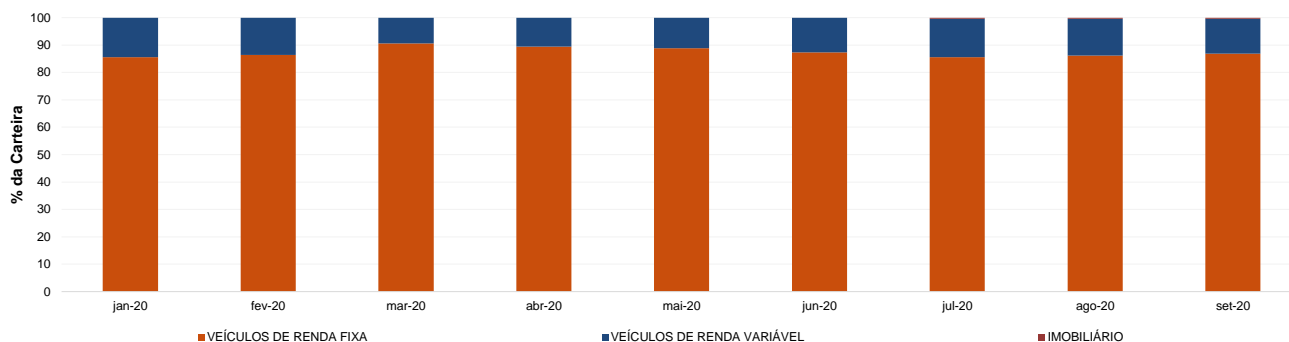
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

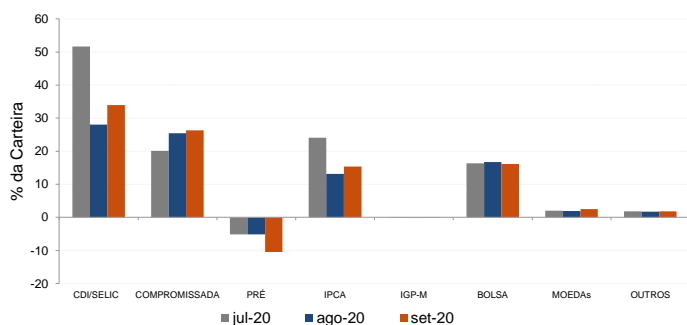
Distribuição da Carteira

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.

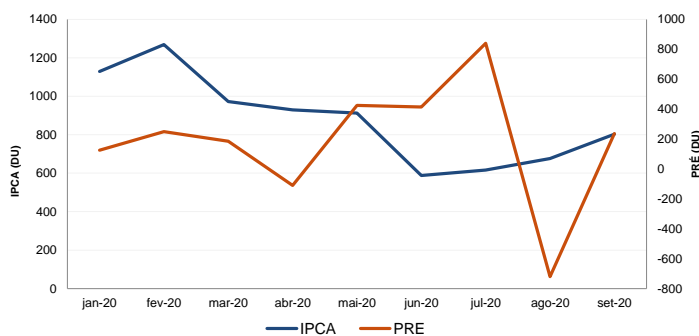
Evolução do Patrimônio Líquido



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	867,66	4,74	827,78	4,38
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	741,46	4,05	730,80	3,87
ITUB4	Intermediários Financeiros	712,73	3,90	721,95	3,82
VVAR3	Comércio	644,18	3,52	748,04	3,96
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	541,12	2,96	486,93	2,58
BBAS3	Intermediários Financeiros	462,49	2,53	521,08	2,76
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	452,11	2,47	475,53	2,52
CRFB3	Comércio e Distribuição	431,91	2,36	284,31	1,50
LAME4	Comércio	421,39	2,30	518,57	2,74
BBDC4	Intermediários Financeiros	404,89	2,21	329,26	1,74

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

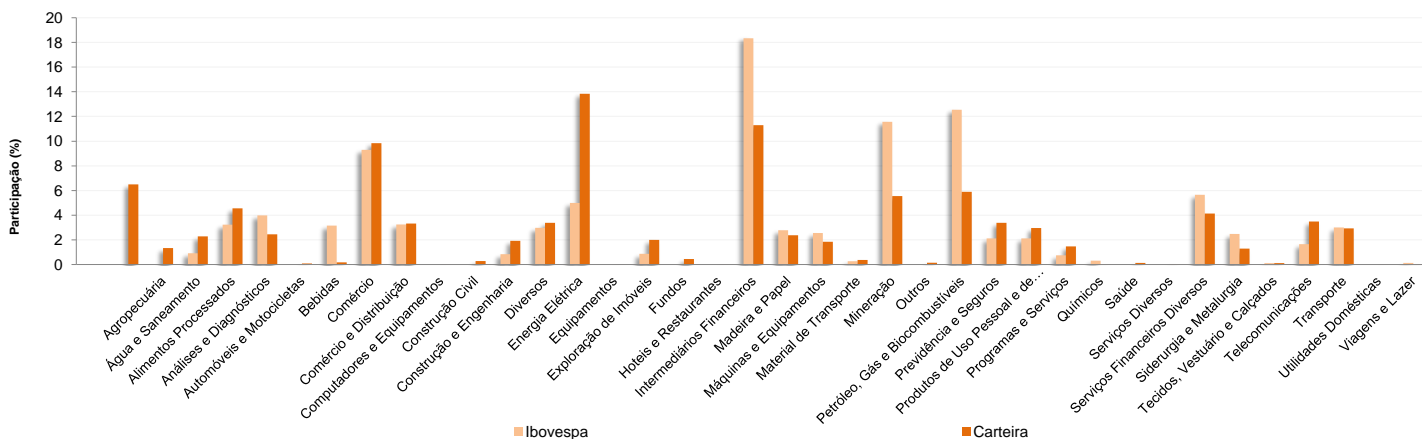
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
GEPA4	10,10	0,06	0,01	3
CRIV4	6,76	0,04	0,01	3
VALE3	867,66	4,74	0,00	1
B3SA3	741,46	4,05	0,00	1
ITUB4	712,73	3,90	0,00	1
VVAR3	644,18	3,52	0,00	1
NTCO3	541,12	2,96	0,00	1
BBAS3	462,49	2,53	0,00	1
PETR4	452,11	2,47	0,00	1
CRFB3	431,91	2,36	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.



Análises de Contrapartes

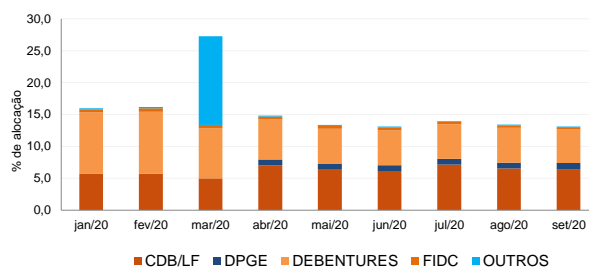
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	2.633,58	2,19	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.815,31	1,51	Faixa 2
BCO SAFRA SA	1.193,94	0,99	Faixa 2
BANCO AGIBANK S.A.	1.099,05	0,91	Faixa 4
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.091,00	0,91	Faixa 2
NATURA COSMETICOS SA	882,59	0,73	Faixa 2
VALE SA	867,66	0,72	Faixa 1
LOJAS AMERICANAS SA	828,81	0,69	Faixa 1
BCO DAYCOVAL SA	805,12	0,67	Faixa 2
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	774,49	0,64	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: 30/09/2020

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
LTN 2024-01-01	01-out-20	-52.777	-0,04%	PRE	30-set-20	1,90%	0,00%	SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTII
LTN 2024-01-01	01-jan-24	52.777	0,04%	PRE	30-set-20	0,00%	0,00%	SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTII
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	11.559	0,01%	IPCA	16-set-20	0,08%	0,30%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	11.828	0,01%	IPCA	23-set-20	2,07%	2,15%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	339.081	0,28%	IPCA	02-set-20	4,00%	4,02%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	167.394	0,14%	IPCA	28-set-20	4,16%	4,37%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	163.102	0,14%	IPCA	02-set-20	3,99%	4,02%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	158.810	0,13%	IPCA	04-set-20	4,00%	4,00%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	25.753	0,02%	IPCA	23-set-20	4,28%	4,29%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML