

## OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/10/2019

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>100.498.642,59</b>	<b>86,87%</b>				<b>0,72%</b>	<b>1,72%</b>	<b>3,58%</b>	<b>6,07%</b>	<b>7,02%</b>	<b>13,17%</b>	<b>25,66%</b>	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,46%	3,07%	5,17%	6,21%	13,17%	25,74%	
<b>Multimercados</b>	<b>81.032.802,66</b>	<b>70,04%</b>				<b>0,68%</b>							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	39.208.436,91	33,89%	MONGERAL AEGON	100%	0,63%	0,49%	1,45%	3,42%	6,06%	7,22%	16,08%	29,54%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	41.824.365,75	36,15%	VINCI	100%	0,73%	1,03%	2,12%	5,02%	7,80%	8,33%	15,87%	28,33%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,66%	1,98%	4,13%	6,94%	8,34%	17,72%	33,40%	
<b>Renda Fixa</b>	<b>19.465.839,93</b>	<b>16,83%</b>				<b>0,15%</b>							
BB PREV RF IRF M FI	2.604.953,54	2,25%	BB	0,05%	1,14%	1,68%	3,37%	8,58%	11,65%	14,44%	25,00%	44,78%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	15.230.885,44	13,17%	ITAU	0,11%	0,00%	0,47%	1,42%	2,99%	5,04%	6,05%	12,83%	25,28%	
NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	741.139,30	0,64%	NOVERO	1,44%	0,01%	-1,83%	-2,17%	-4,06%	-15,24%	-28,69%	-56,37%	-53,48%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	888.861,65	0,77%	NOVERO	5,36%	0,00%	-1,15%	-1,39%	-30,42%	-30,78%	-30,89%	-53,69%	-54,99%	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,46%	3,07%	5,17%	6,21%	13,17%	25,74%	
<b>Renda Variável</b>	<b>15.192.306,32</b>	<b>13,13%</b>				<b>1,82%</b>	<b>5,47%</b>	<b>15,46%</b>	<b>26,54%</b>	<b>27,84%</b>			
Benchmark:	IBOVESPA					2,36%	5,31%	11,28%	22,00%	22,64%	44,29%	65,15%	
<b>Renda Variável</b>	<b>15.192.306,32</b>	<b>13,13%</b>				<b>1,77%</b>							
BRASIL CAPITAL 30 FC FIA	4.893.686,28	4,23%	BC GESTAO	0,31%	4,27%	3,31%	9,24%	22,73%	40,23%	48,42%	64,11%	95,10%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4.784.260,86	4,14%	CONSTANCIA	1,38%	4,68%	1,73%	4,17%	18,80%	29,52%	37,30%	60,55%	101,65%	
MOAT CAPITAL FIC FIA	3.612.671,77	3,12%	MOAT CAPITAL	0,12%	4,72%	-0,33%	2,77%	16,09%	26,63%	27,75%	72,89%	129,64%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	1.901.687,41	1,64%	SANTANDER	0,26%	5,16%	2,39%	5,48%	11,56%	21,60%	23,20%	41,07%	60,90%	
Benchmark:	IBOVESPA					2,36%	5,31%	11,28%	22,00%	22,64%	44,29%	65,15%	
<b>Total</b>	<b>115.690.948,91</b>	<b>100%</b>				<b>1,02%</b>	<b>0,86%</b>	<b>2,11%</b>	<b>4,30%</b>	<b>6,91%</b>	<b>7,78%</b>	<b>15,42%</b>	<b>28,71%</b>
Benchmark:	INPC + 4,19% a.a.					0,42%	1,19%	2,52%	6,27%	6,85%	15,75%	22,79%	

\* 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.

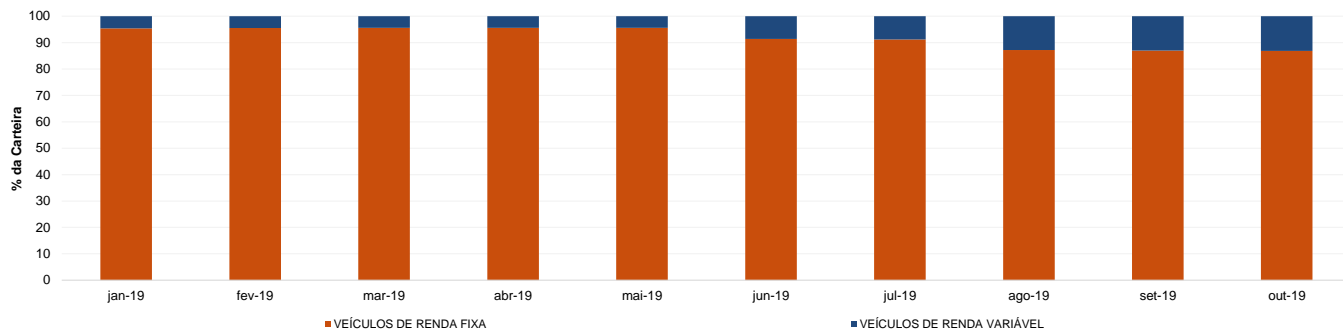
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

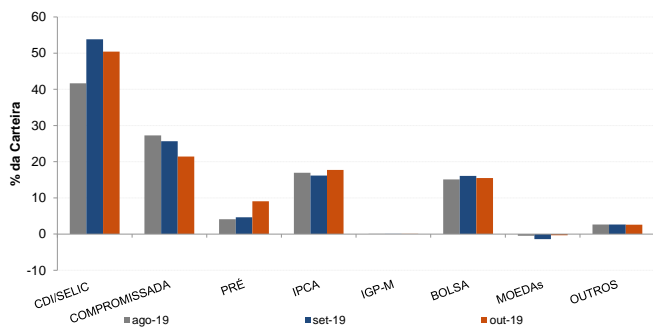
## Distribuição da Carteira

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.

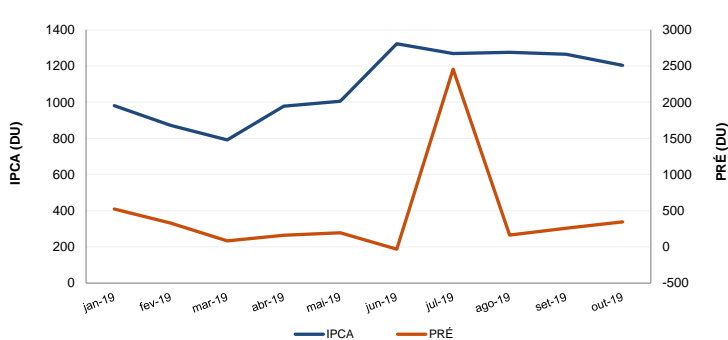
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	1.246,68	6,87	1.161,57	6,41
BBAS3	Intermediários Financeiros	643,27	3,55	374,54	2,07
ITUB4	Intermediários Financeiros	577,10	3,18	400,78	2,21
ITSA4	Intermediários Financeiros	559,03	3,08	544,28	3,01
VALE3	Mineração	548,45	3,02	521,26	2,88
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	543,54	3,00	541,10	2,99
ALSO3	Exploração de Imóveis	489,05	2,70	470,21	2,60
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	472,88	2,61	473,24	2,61
ALUP11	Energia Elétrica	435,71	2,40	460,75	2,54
SULA11	Previdência e Seguros	385,64	2,13	409,38	2,26

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

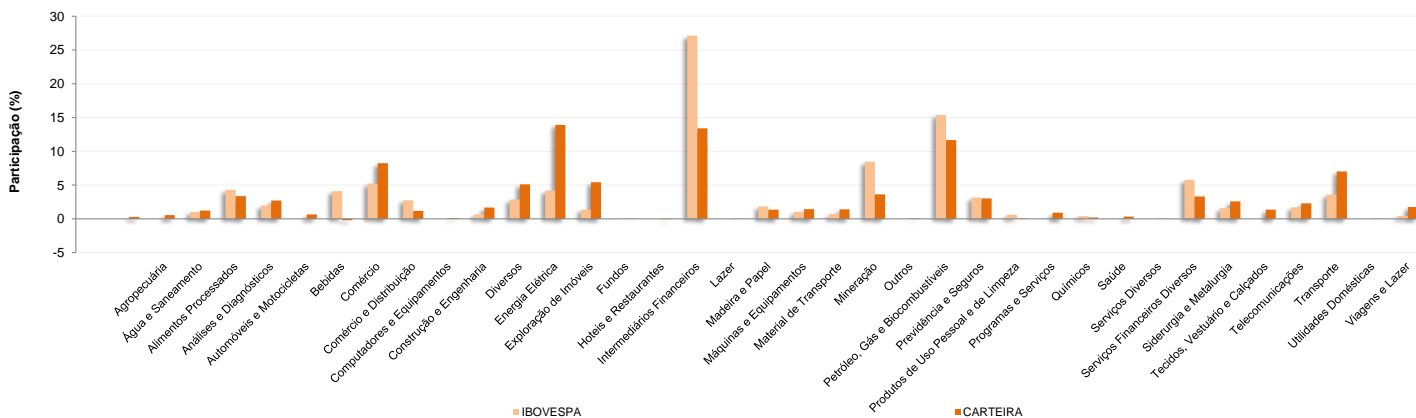
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CEAB3	29,44	0,16	0,00	Sem Liquidez
BMGB11	22,88	0,13	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	15,58	0,09	0,01	25
EMAE4	12,10	0,07	0,00	18
MTSA4	30,26	0,17	0,05	5
SHUL4	108,57	0,60	0,03	2
KEPL3	68,19	0,38	0,01	2
OFSA3	63,33	0,35	0,01	2
CGRA4	35,68	0,20	0,02	2
CRPG5	28,28	0,16	0,01	2

\* 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: 31/10/2019

## Análises de Contrapartes

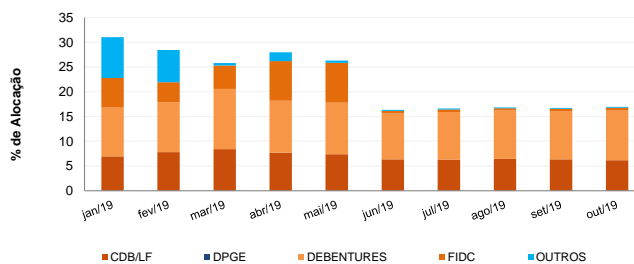
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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	1.759,15	1,50		Aaa.br	
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.506,12	1,28	AA (bra)		brAAA
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.285,62	1,10	AA+ (bra)		
BCO BRADESCO SA	1.096,53	0,93	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
IOCHPE MAXION SA	1.033,36	0,88			brAAA
BCO DAYCOVAL SA	922,55	0,79	AA (bra)	Aa2.br	brAA+
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM)	854,85	0,73	AAA (bra)	Aa2.br	brAAA
LOJAS AMERICANAS SA	827,89	0,71	AA (bra)		
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	702,12	0,60	AAA (bra)	A1.br	brAAA
VALE SA	696,07	0,59	AAA (bra)	Aaa.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
ANHB10	54,17	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDI	Novo	brAAA	S&P	21-out-26	CDI	1,20%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
ANHB10	11,65	CONCESSIONARIA SISTEMA ANHANGUERA BANDI	Novo	brAAA	S&P	21-out-26	CDI	1,22%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base:

31/10/2019

## 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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2020-03-01	01-mar-20	727.386	0,62%	Selic	15-out-19	0,00%	0,00%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV
LFT 2023-03-01	01-mar-23	4.154.883	3,54%	Selic	15-out-19	0,01%	0,01%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV
LFT 2026-03-01	01-mar-26	25.062	0,02%	Selic	18-out-19	0,02%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2021-07-01	01-jul-21	10.475	0,01%	PRE	31-out-19	0,00%	4,69%	NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	516.732	0,44%	IPCA	09-out-19	2,57%	2,53%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	512.876	0,44%	IPCA	09-out-19	2,57%	2,53%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	65.556	0,06%	IPCA	09-out-19	2,57%	2,53%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT
NTN-F 2021-01-01	01-jan-21	13.188	0,01%	PRE	03-out-19	4,88%	4,88%	BB PREV RF IRF M FI

