

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/10/2020

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	104.997.646,87	87,04%				0,30%	0,41%	2,80%	1,84%	2,75%	9,96%	16,28%	
Benchmark:	CDI					0,16%	0,48%	1,13%	2,45%	3,22%	9,63%	16,82%	
Multimercados Institucionais	89.460.016,23	74,16%			0,50%								
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	42.412.530,68	35,16%	MONGERAL AEGON	100%	0,42%	0,42%	0,42%	3,30%	1,60%	2,41%	9,80%	18,88%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	47.047.485,55	39,00%	VINCI	100%	0,64%	0,26%	0,56%	3,11%	3,49%	4,63%	13,35%	21,23%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,32%	0,97%	2,14%	4,14%	5,27%	14,05%	23,93%	
Renda Fixa	15.537.630,64	12,88%			0,18%								
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	15.008.724,09	12,44%	ITAU	0,08%	0,19%	0,12%	0,28%	0,89%	2,14%	2,89%	9,12%	16,09%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	368.591,55	0,31%	NOVERO	1,44%		-0,11%	-0,34%	-0,16%	3,97%	3,72%	-26,04%	-54,75%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	160.315,00	0,13%	NOVERO	5,36%	0,10%	-0,20%	-0,67%	-1,21%	-81,93%	-81,96%	-87,54%	-91,65%	
Benchmark:	CDI					0,16%	0,48%	1,13%	2,45%	3,22%	9,63%	16,82%	
Renda Variável	15.226.608,77	12,62%				-1,44%	-10,34%	17,76%	-18,79%	-8,06%	17,54%		
Benchmark:	IBOVESPA					-0,69%	-8,71%	16,70%	-18,76%	-12,37%	7,47%	26,44%	
Renda Variável	15.226.608,77	12,62%			1,23%								
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	4.450.566,42	3,69%	BC GESTAO	0,89%	9,64%	-0,59%	-7,06%	23,54%	-18,28%	-9,05%	34,98%	49,25%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4.333.203,83	3,59%	CONSTANCIA	0,42%	7,21%	-1,68%	-11,97%	8,45%	-22,25%	-9,43%	24,35%	45,41%	
MOAT CAPITAL FIC FIA	4.223.484,57	3,50%	MOAT CAPITAL	0,19%	11,34%	-1,91%	-12,78%	24,34%	-13,02%	-1,20%	26,22%	70,81%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2.219.353,95	1,84%	SANTANDER	0,35%	8,38%	-1,74%	-8,65%	15,39%	-22,61%	-15,46%	4,15%	19,26%	
Benchmark:	IBOVESPA					-0,69%	-8,71%	16,70%	-18,76%	-12,37%	7,47%	26,44%	
Imobiliário	400.411,55	0,33%				-0,09%	-0,29%						
Benchmark:	INPC					0,89%	2,13%	2,63%	2,95%	4,77%	7,45%	11,75%	
FII	400.411,55	0,33%											
SÃO FRANCISCO 34 FII	400.411,55	0,33%		0,00%		-0,22%	-0,29%	-0,67%	-	-	-	-	
Benchmark:	IFIX					-1,01%	1,23%	6,27%	-13,47%	-0,90%	23,38%	24,29%	
Total	120.624.667,19	100%				1,49%	0,08%	-1,10%	4,31%	-1,19%	1,29%	9,58%	17,76%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					1,23%	3,16%	4,73%	6,43%	9,02%	16,38%	25,95%	

* 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.

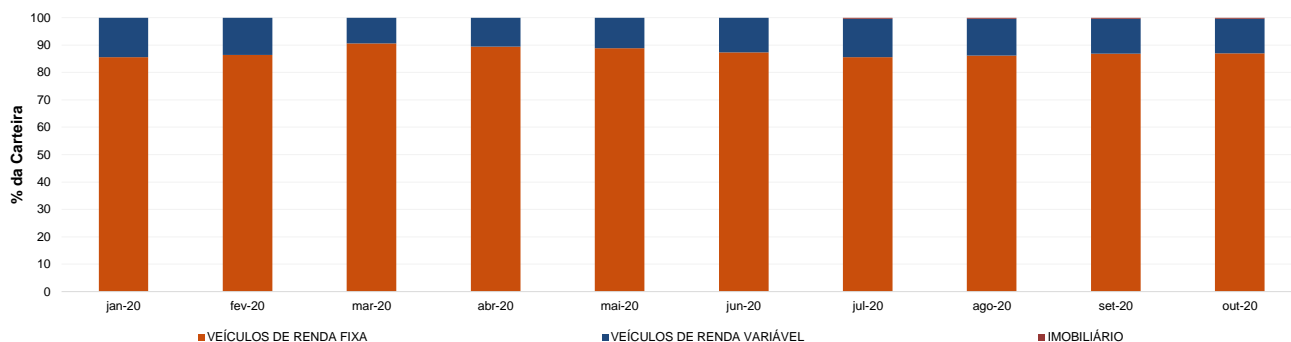
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

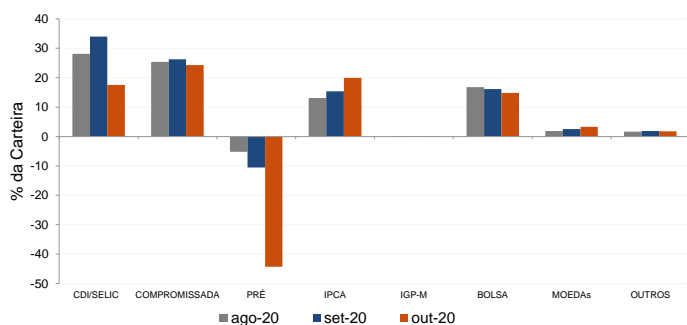
Distribuição da Carteira

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.

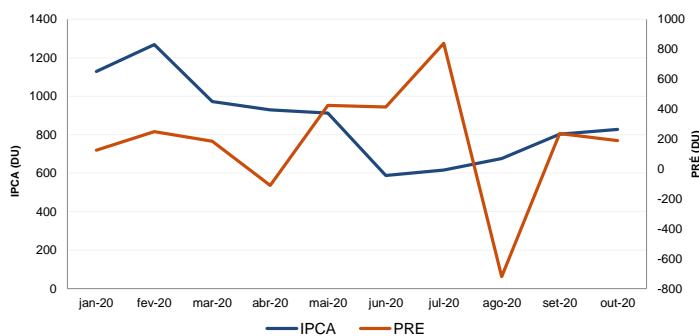
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	968,43	5,30	867,66	4,74
ITUB4	Intermediários Financeiros	767,21	4,20	712,73	3,90
VVAR3	Comércio	709,11	3,88	644,18	3,52
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	701,39	3,84	741,46	4,05
SUZB3	Madeira e Papel	605,40	3,31	365,46	2,00
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	535,72	2,93	541,12	2,96
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	524,38	2,87	452,11	2,47
BBAS3	Intermediários Financeiros	466,36	2,55	462,49	2,53
CRFB3	Comércio e Distribuição	433,67	2,37	431,91	2,36
BBDC4	Intermediários Financeiros	401,97	2,20	404,89	2,21

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

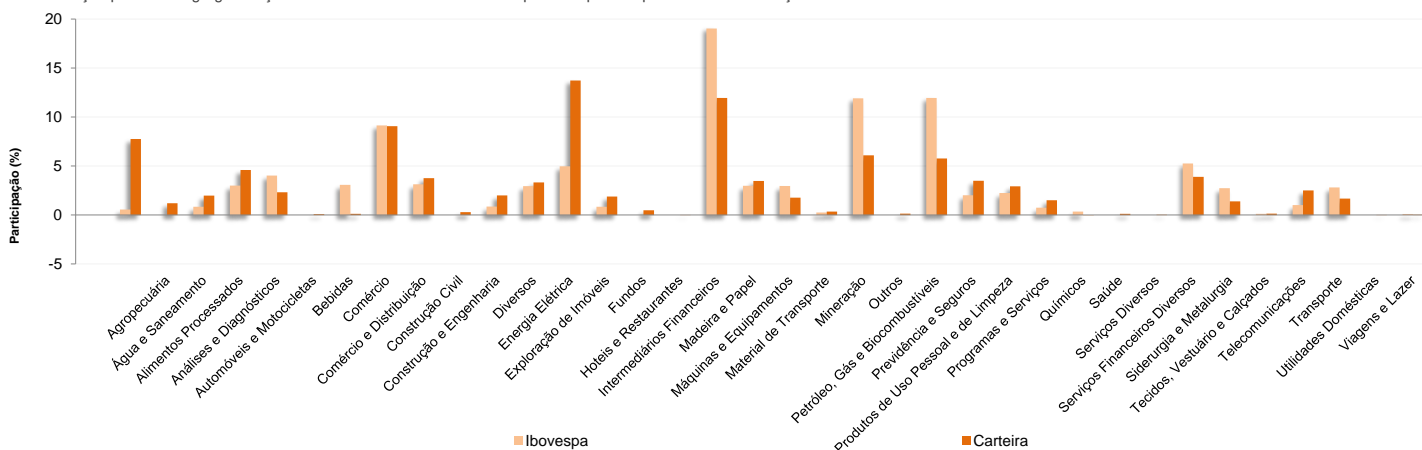
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
GEPA4	11,31	0,06	0,01	3
CRIV4	6,52	0,04	0,01	3
VALE3	968,43	5,30	0,00	1
ITUB4	767,21	4,20	0,00	1
VVAR3	709,11	3,88	0,00	1
B3SA3	701,39	3,84	0,00	1
SUZB3	605,40	3,31	0,00	1
NTCO3	535,72	2,93	0,00	1
PETR4	524,38	2,87	0,00	1
BBAS3	466,36	2,55	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: 30/10/2020

Análises de Contrapartes

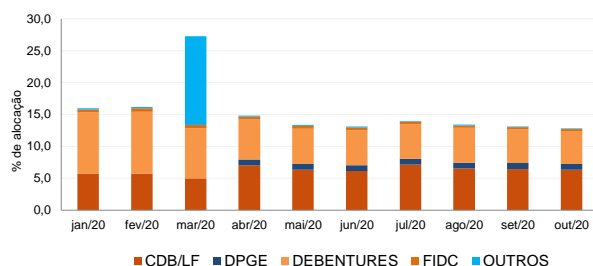
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	2.620,46	2,18	Faixa 2
BANCO RCI BRASIL SA	1.818,31	1,51	Faixa 2
BCO SAFRA SA	1.144,34	0,95	Faixa 2
BANCO AGIBANK S.A.	1.105,15	0,92	Faixa 4
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.095,36	0,91	Faixa 2
VALE SA	968,43	0,80	Faixa 1
NATURA COSMETICOS SA	875,88	0,73	Faixa 2
BCO DAYCOVAL SA	805,03	0,67	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	795,33	0,66	Faixa 2
IOCHPE MAXION SA	785,50	0,65	Faixa 2

* 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
ERDVA0	18,30	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	Sem Faixa	Faixa 2	13-jul-23	CDI	3,50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
NATU27	14,44	NATURA COSMETICOS SA	Faixa 2	Faixa 1	25-set-21	CDI	0,92%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
NATU27	26,30	NATURA COSMETICOS SA	Faixa 2	Faixa 1	25-set-21	CDI	0,70%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
NATU27	141,10	NATURA COSMETICOS SA	Faixa 2	Faixa 1	25-set-21	CDI	1,77%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT
NATUC0	11,45	NATURA COSMETICOS SA	Faixa 2	Faixa 1	26-ago-24	CDI	1,90%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
NATUC0	146,87	NATURA COSMETICOS SA	Faixa 2	Faixa 1	26-ago-24	CDI	1,38%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/10/2020

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
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.671.176	1,39%	IPCA	09-out-20	2,32%	2,25%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.655.411	1,37%	IPCA	14-out-20	2,25%	2,25%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.615.996	1,34%	IPCA	08-out-20	2,33%	2,32%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	167.945	0,14%	IPCA	13-out-20	4,24%	4,26%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML