

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 29/11/2019

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	
Renda Fixa	100.558.060,85	86,54%				0,06%	1,46%	2,87%	6,14%	6,73%	13,39%	24,41%	
Benchmark:	CDI					0,38%	1,33%	2,90%	5,57%	6,09%	12,96%	24,92%	
Multimercados	81.050.204,95	69,75%				0,78%							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	39.255.307,40	33,78%	MONGERAL AEGON	100%	0,78%	0,12%	1,15%	2,84%	6,19%	6,85%	15,59%	28,66%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	41.794.897,55	35,97%	VINCI	100%	0,79%	-0,07%	1,85%	4,03%	7,72%	8,12%	15,14%	27,25%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,54%	1,84%	3,94%	7,51%	8,21%	17,50%	32,53%	
Renda Fixa	19.507.855,90	16,79%				0,20%							
BB PREV RF IRF M FI	2.592.619,02	2,23%	BB	0,05%	1,51%	-0,47%	2,64%	6,21%	11,12%	12,80%	24,32%	43,68%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	15.286.991,35	13,16%	ITAU	0,11%	0,00%	0,37%	1,29%	2,82%	5,43%	5,94%	12,62%	24,47%	
NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	740.220,79	0,64%	NOVERO	1,44%	0,02%	-0,12%	-2,17%	-3,99%	-15,35%	-15,55%	-56,61%	-53,69%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	888.024,74	0,76%	NOVERO	5,36%	0,00%	-0,09%	-1,39%	-30,34%	-30,84%	-30,90%	-53,66%	-54,21%	
Benchmark:	CDI					0,38%	1,33%	2,90%	5,57%	6,09%	12,96%	24,92%	
Renda Variável	15.644.602,10	13,46%				2,98%	7,82%	17,38%	30,31%	28,14%			
Benchmark:	IBOVESPA					0,95%	7,02%	11,55%	23,15%	20,93%	50,39%	74,83%	
Renda Variável	15.644.602,10	13,46%				1,83%							
BRASIL CAPITAL 30 FC FIA	4.971.961,33	4,28%	BC GESTAO	0,26%	4,64%	1,60%	9,22%	21,02%	42,47%	42,23%	68,30%	117,07%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4.971.285,79	4,28%	CONSTANCIA	1,36%	6,09%	3,91%	7,18%	19,66%	34,58%	37,02%	76,30%	117,40%	
MOAT CAPITAL FIC FIA	3.771.227,38	3,25%	MOAT CAPITAL	0,11%	5,11%	4,39%	7,36%	19,50%	32,19%	29,51%	88,23%	149,67%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	1.930.127,60	1,66%	SANTANDER	0,27%	5,06%	1,50%	6,82%	11,99%	23,42%	22,31%	47,49%	73,01%	
Benchmark:	IBOVESPA					0,95%	7,02%	11,55%	23,15%	20,93%	50,39%	74,83%	
Total	116.202.662,95	100%				1,14%	0,44%	2,24%	4,00%	7,38%	7,85%	15,07%	28,15%
Benchmark:	INPC + 4.19% a.a.					0,87%	1,58%	2,88%	7,20%	7,70%	16,16%	23,37%	

* 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.

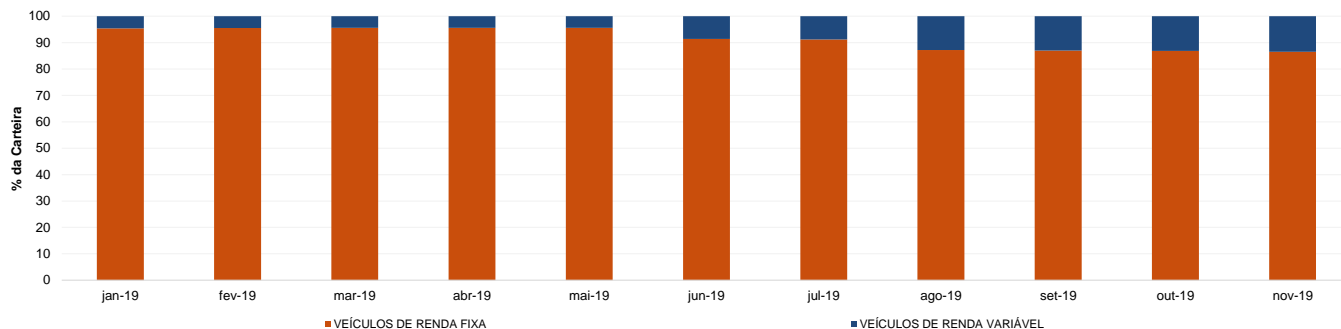
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

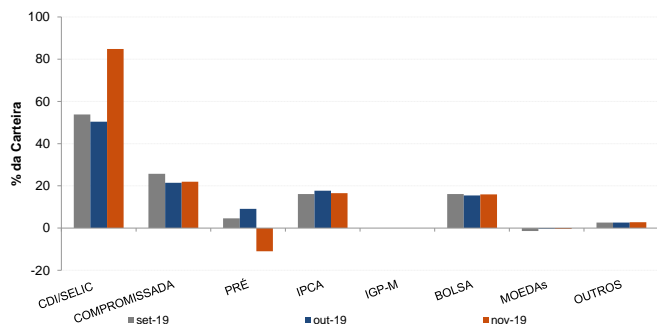
Distribuição da Carteira

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.

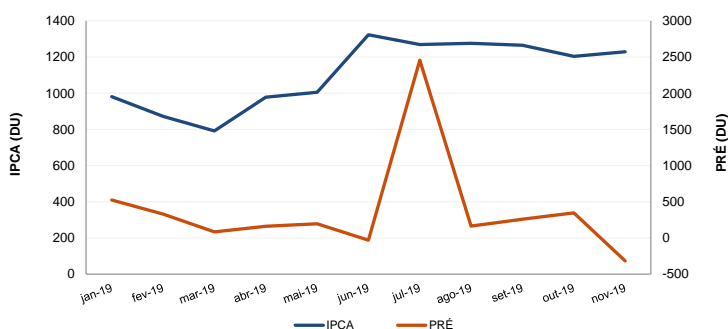
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
PETRA	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	1.256,30	6,74	1.246,68	6,87
VALE3	Mineração	707,61	3,80	548,45	3,02
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	578,20	3,10	543,54	3,00
BBAS3	Intermediários Financeiros	563,01	3,02	643,27	3,55
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	498,30	2,67	329,10	1,81
ITUB4	Intermediários Financeiros	495,30	2,66	577,10	3,18
ITSA4	Intermediários Financeiros	489,58	2,63	559,03	3,08
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	463,54	2,49	472,88	2,61
RAIL3	Transporte	442,82	2,38	373,70	2,06
ALUP11	Energia Elétrica	438,44	2,35	435,71	2,40

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

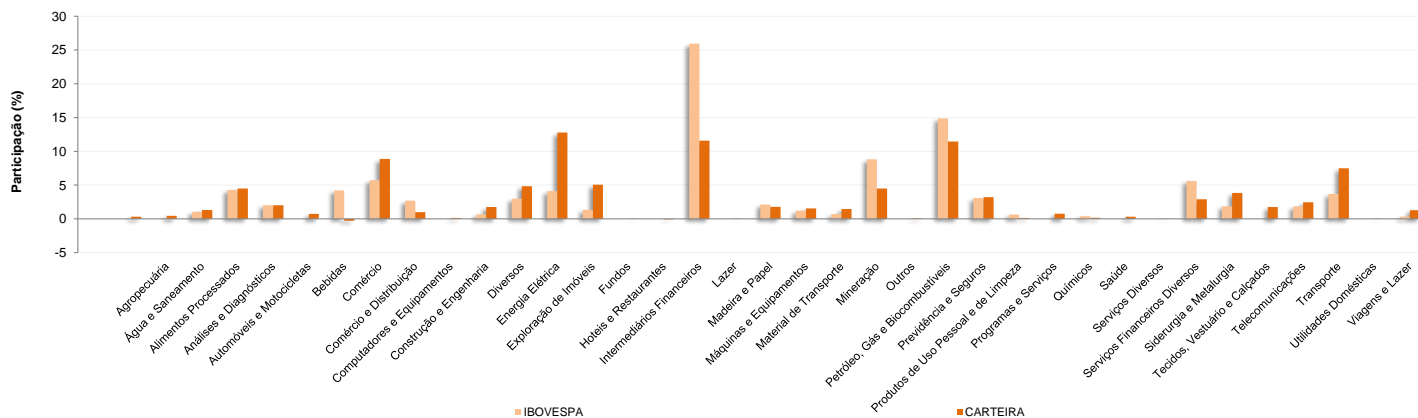
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	14,98	0,08	0,01	11
MTSA4	28,52	0,15	0,05	2
PETRA	1.256,30	6,74	0,00	1
VALE3	707,61	3,80	0,00	1
CSAN3	578,20	3,10	0,01	1
BBAS3	563,01	3,02	0,00	1
GGBR4	498,30	2,67	0,00	1
ITUB4	495,30	2,66	0,00	1
ITSA4	489,58	2,63	0,00	1
B3SA3	463,54	2,49	0,00	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.



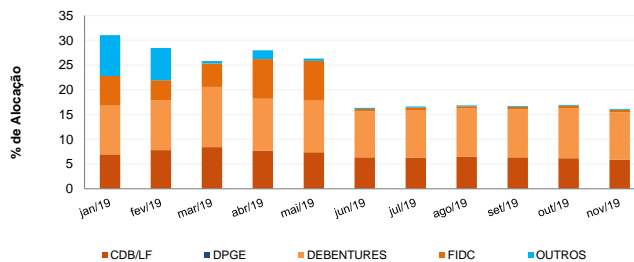
Análises de Contrapartes

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	1.766,19	1,50		Aaa.br	
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.522,19	1,29	AA (bra)		brAAA
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.282,11	1,09	AA+ (bra)		
BCO BRADESCO SA	1.110,30	0,94	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
IOCHPE MAXION SA	1.036,11	0,88			brAAA
BCO DAYCOVAL SA	972,10	0,83	AA (bra)	Aa2.br	brAA+
LOJAS AMERICANAS SA	920,02	0,78	AA (bra)		
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROMA)	843,61	0,72	AAA (bra)	Aa2.br	brAAA
VALE SA	762,32	0,65	AAA (bra)	Aaa.br	brAAA
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INV	682,32	0,58	AA (bra)	Aa1.br	

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

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Anterior	Atual	Agência	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
DASA17	12,01	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	19-dez-21	CDI	112,25%	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP
DASA17	8,41	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	19-dez-21	CDI	112,25%	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP
DASA17	0,75	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	19-dez-21	CDI	112,25%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
DASA17	0,27	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	19-dez-21	CDI	112,25%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
DASAA1	0,95	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	10-jun-26	CDI	108,50%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
DASAA1	0,43	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	10-jun-26	CDI	108,50%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
DASAA1	47,86	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	10-jun-26	CDI	108,50%	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP
DASAA1	402,04	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	10-jun-26	CDI	108,50%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT
DASAC0	0,06	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	10-dez-26	CDI	112,50%	SPX NIMITZ MASTER FI MULT
DASAC0	2,22	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	AA+ (bra)	AAA (bra)	Fitch	10-dez-26	CDI	112,50%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT14	5,19	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-24	CDI	1,76%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	10,02	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,80%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	2,60	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,08%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	10,68	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,04%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	1,84	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,21%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	1,90	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,08%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	1,87	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,04%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	0,67	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,21%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	0,80	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,16%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	0,73	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,08%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	3,34	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,04%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	0,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,04%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	1,03	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,08%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	5,38	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,04%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	0,70	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,16%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	2,70	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,25%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PRIV LP
SMFT24	29,32	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,12%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
SMFT24	21,66	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,11%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
SMFT24	10,41	SMARTFIT ESCOLA GINASTICA DANCA SA	A (bra)	AA- (bra)	Fitch	20-abr-26	CDI	2,17%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base:

29/11/2019

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 2024-09-01	01-set-24	1.042.259	0,89%	Selic	25-nov-19	0,02%	0,00%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV
LFT 2025-09-01	01-set-25	156.314	0,13%	Selic	25-nov-19	0,02%	0,02%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	9.530	0,01%	IPCA	29-nov-19	6,00%	1,97%	NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO

