

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/11/2020

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	105.667.954,67	85,60%				0,70%	0,75%	2,69%	2,55%	3,40%	10,35%	17,25%
Benchmark:	CDI					0,15%	0,46%	1,04%	2,60%	2,99%	9,26%	16,33%
Multimercados Institucionais	90.378.621,40	73,22%				0,48%						
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	42.781.143,15	34,66%	MONGERAL AEGON	100%	0,29%	0,87%	0,90%	3,18%	2,48%	3,18%	10,25%	19,26%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	47.597.478,25	38,56%	VINCI	100%	0,68%	0,74%	0,80%	3,01%	4,25%	5,48%	14,05%	21,46%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,31%	0,95%	2,05%	4,46%	5,03%	13,65%	23,41%
Renda Fixa	15.289.333,27	12,39%				0,16%						
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	14.764.808,18	11,96%	ITAU	0,09%	0,17%	0,11%	0,24%	0,77%	2,25%	2,62%	8,71%	15,57%
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	368.207,67	0,30%	NOVERO	1,44%		-0,10%	-0,33%	-0,08%	3,97%	3,74%	-12,18%	-55,14%
DELTA CRED PRIV FC FIRF	156.317,42	0,13%	NOVERO	5,36%	0,00%	-2,49%	-2,92%	-3,71%	-82,38%	-82,40%	-87,84%	-91,84%
Benchmark:	CDI					0,15%	0,46%	1,04%	2,60%	2,99%	9,26%	16,33%
Renda Variável	17.371.164,28	14,07%				14,08%	6,35%	24,03%	-7,36%	1,86%	30,53%	
Benchmark:	IBOVESPA					15,90%	9,58%	24,59%	-5,84%	0,61%	21,66%	51,30%
Renda Variável	17.371.164,28	14,07%				2,25%						
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	5.031.142,35	4,08%	BC GESTAO	0,89%	11,77%	13,04%	7,12%	29,73%	-7,62%	1,19%	43,93%	70,31%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4.917.339,46	3,98%	CONSTANCIA	0,43%	12,44%	13,48%	6,55%	15,93%	-11,77%	-1,09%	35,53%	74,39%
MOAT CAPITAL FIC FIA	4.905.036,78	3,97%	MOAT CAPITAL	0,19%	14,62%	16,14%	5,17%	28,54%	1,01%	9,92%	42,36%	106,90%
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2.517.645,69	2,04%	SANTANDER	0,37%	12,82%	13,44%	6,73%	21,27%	-12,21%	-5,51%	15,57%	39,36%
Benchmark:	IBOVESPA					15,90%	9,58%	24,59%	-5,84%	0,61%	21,66%	51,30%
Imobiliário	400.059,53	0,32%				-0,09%	-0,28%					
Benchmark:	INPC					0,95%	2,73%	3,87%	3,93%	5,20%	8,74%	12,61%
FI	400.059,53	0,32%										
SAO FRANCISCO 34 FI-UNICA	400.059,53	0,32%	TREK	0,96%		-0,09%	-0,28%	-0,67%	-	-	-	-
Benchmark:	IFIX					1,51%	0,95%	5,68%	-12,17%	-2,83%	22,09%	26,91%
Total	123.439.178,48	100%				2,08%	2,38%	1,49%	5,12%	1,17%	3,24%	11,72%
Benchmark:	INPC + 4,09% a.a.					1,27%	3,75%	5,99%	7,79%	9,47%	17,78%	26,92%

* 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.

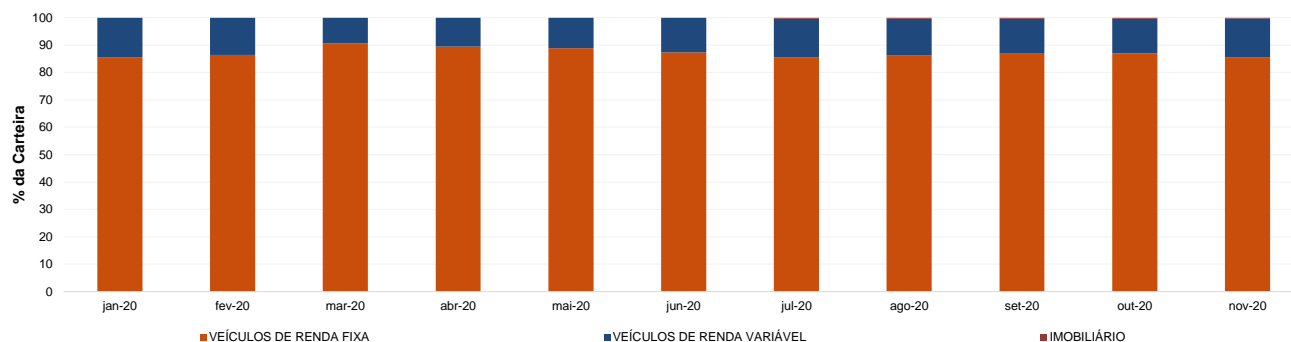
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

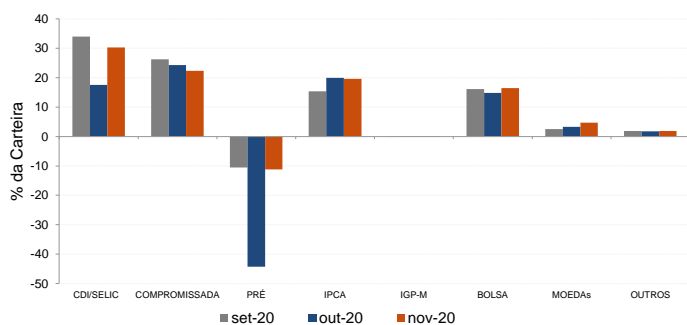
Distribuição da Carteira

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.

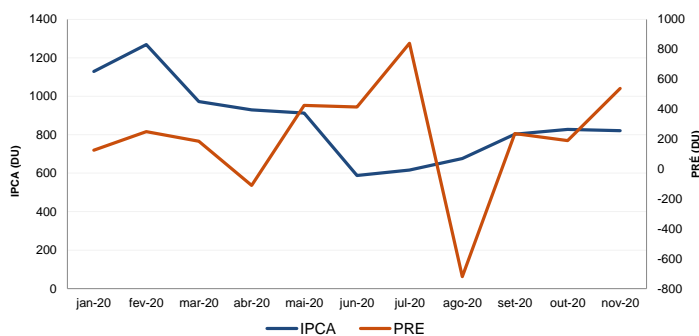
Evolução do Patrimônio Líquido



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	1.088,89	5,20	968,43	5,30
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	834,62	3,99	701,39	3,84
PETRA	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	833,44	3,98	524,38	2,87
ITUB4	Intermediários Financeiros	803,22	3,84	767,21	4,20
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	633,90	3,03	535,72	2,93
SUZB3	Madeira e Papel	629,57	3,01	605,40	3,31
VVAR3	Comércio	561,00	2,68	709,11	3,88
BBAS3	Intermediários Financeiros	558,51	2,67	466,36	2,55
OIBR3	Telecomunicações	504,83	2,41	342,99	1,88
CRFB3	Comércio e Distribuição	459,99	2,20	433,67	2,37

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

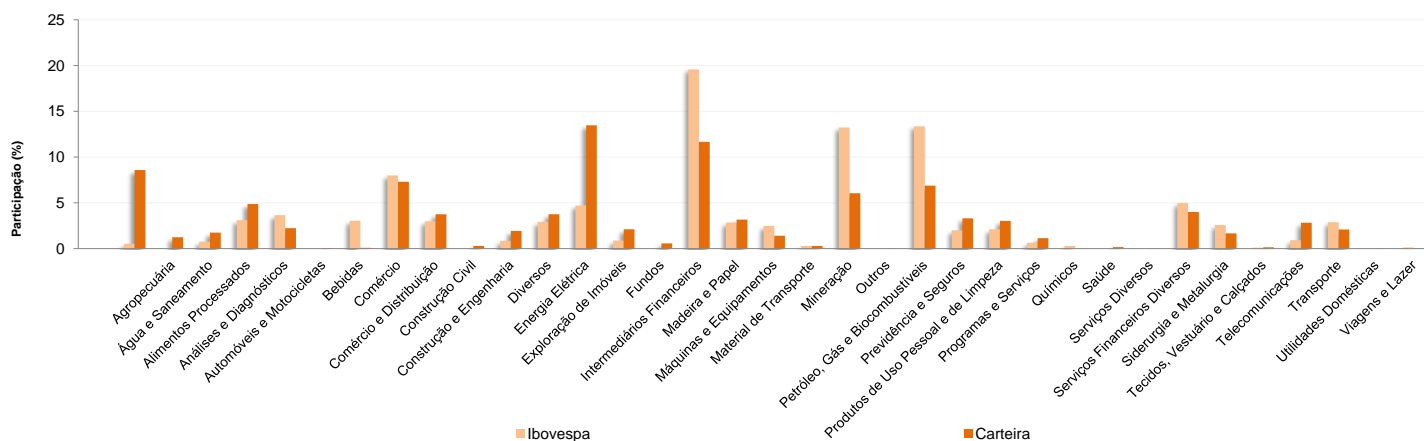
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	6,81	0,03	0,01	3
VALE3	1.088,89	5,20	0,00	1
B3SA3	834,62	3,99	0,00	1
PETRA	833,44	3,98	0,00	1
ITUB4	803,22	3,84	0,00	1
NTCO3	633,90	3,03	0,00	1
SUZB3	629,57	3,01	0,00	1
VVAR3	561,00	2,68	0,00	1
BBAS3	558,51	2,67	0,00	1
OIBR3	504,83	2,41	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.



Análises de Contrapartes

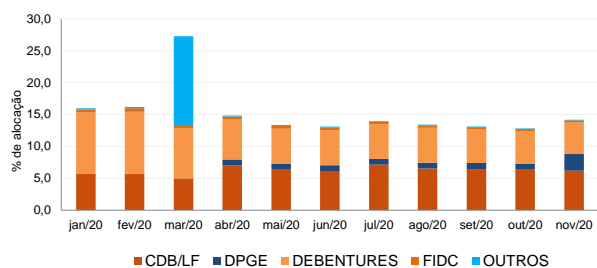
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	2.672,85	2,16	Faixa 2
BANCO C6 S.A.	2.114,47	1,71	Sem Faixa
BANCO RCI BRASIL SA	1.821,17	1,47	Faixa 2
BCO SAFRA SA	1.150,53	0,93	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.145,95	0,93	Faixa 2
BANCO AGIBANK S.A.	1.118,83	0,91	Faixa 4
SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	1.099,35	0,89	Faixa 2
VALE SA	1.088,89	0,88	Faixa 1
NATURA COSMETICOS SA	971,75	0,79	Faixa 2
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	864,47	0,70	Sem Faixa

* 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: 30/11/2020

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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
DPGE CDI	10-nov-22	1.001.831	0,81%	CDI	BANCO C6 S.A.	10-nov-20	1,42%	Sem Faixa	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
DPGE IPCA	03-nov-22	1.041.833	0,84%	IPCA	BANCO C6 S.A.	03-nov-20	2,15%	Sem Faixa	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	589.553	0,48%	IPCA		30-nov-20	0,03%	0,05%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	563.099	0,46%	IPCA		27-nov-20	6,00%	0,03%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	415.710	0,34%	IPCA		27-nov-20	6,00%	0,03%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.443.246	1,17%	IPCA		30-nov-20	2,43%	2,36%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	682.616	0,55%	IPCA		30-nov-20	2,38%	2,36%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	288.649	0,23%	IPCA		27-nov-20	2,43%	2,34%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	168.483	0,14%	IPCA		30-nov-20	4,25%	4,23%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	159.615	0,13%	IPCA		11-nov-20	4,21%	4,28%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML