

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD
Data-base: 30/11/2017

O relatório Análise de Investimentos apresenta os principais pontos de acompanhamento mensal da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e rentabilidade. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o adequado entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações contidas nesse relatório foram extraídas dos relatórios de risco 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	92.496.547,71	100,00%			-	0,74%	2,04%	5,03%	10,17%	11,37%	28,02%	45,86%
Benchmark:	SELIC					0,57%	1,87%	4,35%	9,38%	10,60%	26,16%	42,60%
Multimercados	85.416.443,33	92,35%			0,36%	-	-	-	-	-	-	-
GAP OABPREVGO TO FI MULT	25.496.314,14	27,56%	GAP	100,00%	0,18%	0,56%	1,81%	4,45%	9,28%	10,51%	25,91%	41,91%
TC OABPREVGO TO FI MULT	32.919.895,06	35,59%	TC	100,00%	0,40%	0,94%	2,44%	6,18%	12,44%	13,92%	33,76%	54,53%
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	20.759.268,60	22,44%	MONGERAL AEGON	100,00%	0,88%	0,54%	1,90%	4,97%	10,19%	11,31%	27,22%	-
MERITO MULT I FICFI	6.240.965,53	6,75%	TC	23,45%	1,01%	1,86%	3,32%	6,64%	12,23%	13,78%	33,08%	51,31%
Benchmark:	CDI					0,57%	1,87%	4,35%	9,36%	10,59%	26,12%	42,51%
Renda Fixa	7.080.104,38	7,65%			0,73%	-	-	-	-	-	-	-
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	673.208,04	0,73%	CAIXA	0,00%	0,12%	0,59%	1,94%	4,82%	10,31%	11,61%	27,86%	43,78%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	350.829,88	0,38%	ITAU	0,00%	0,00%	0,56%	1,84%	4,35%	9,32%	10,52%	25,81%	41,99%
SANTANDER FICFI INSTITUCIONAL RF REF DI	1.093.215,92	1,18%	SANTANDER	0,02%	0,01%	0,56%	1,88%	4,44%	9,59%	10,83%	26,57%	43,32%
BB PREV RF IRF M FI	1.277.978,21	1,38%	BB	0,03%	1,17%	0,07%	1,60%	6,41%	13,52%	15,57%	40,63%	49,20%
NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	1.768.561,44	1,91%	NOVERO	1,44%	1,99%	0,42%	0,99%	2,65%	6,05%	6,72%	24,27%	49,05%
DELTA CRED PRIV FC FIRF	1.916.310,89	2,07%	NOVERO	5,36%	0,00%	-0,16%	-0,59%	-0,75%	-1,04%	-1,18%	-	-
Benchmark:	CDI					0,57%	1,87%	4,35%	9,36%	10,59%	26,12%	42,51%
Total	92.496.547,71	100,00%			0,38%	0,74%	2,04%	5,03%	10,17%	11,37%	28,02%	45,86%
Benchmark:	INPC + 5% a.a.					0,57%	1,72%	2,85%	6,42%	7,02%	20,65%	40,52%

* As rentabilidades dos fundos de investimentos apresentadas nesse relatórios foram obtidas através dos valores das cotas desses fundos, não refletindo, portanto, eventuais movimentações feitas pela EFPC.

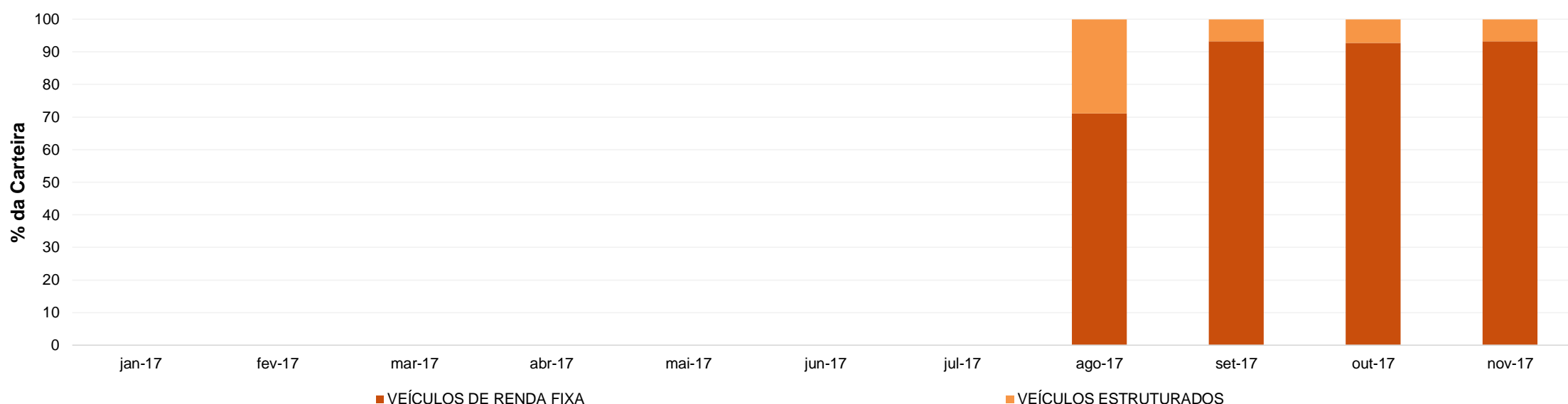


Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira, e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.
Nenhuma das análises aqui apresentadas pode ser interpretada como recomendação de investimento ou de desinvestimento.

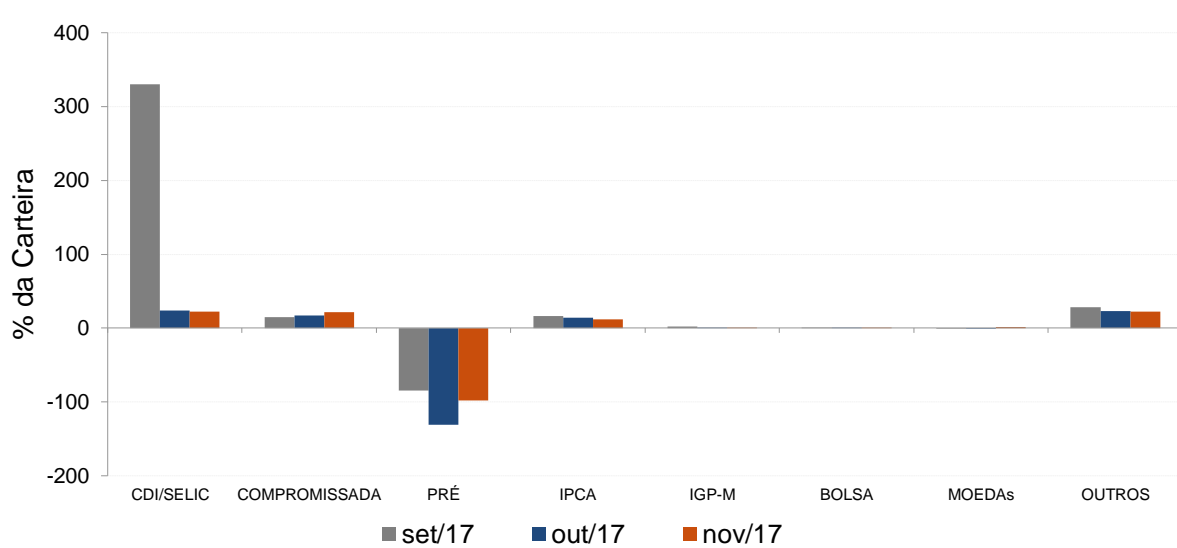
Distribuição da Carteira

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.

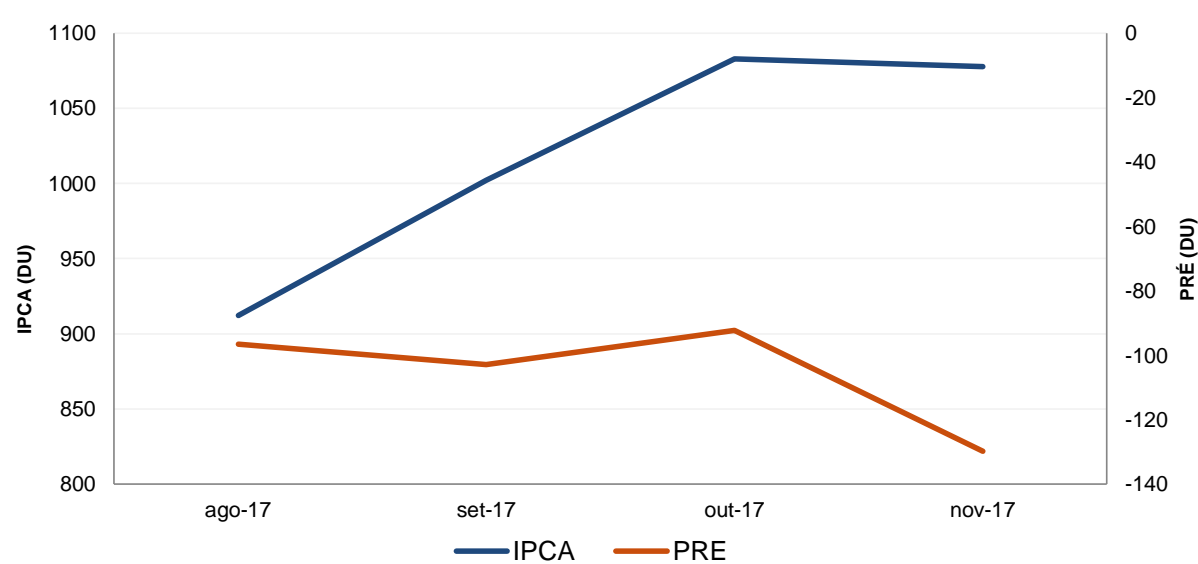
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
ITUB4	Intermediários Financeiros	87,10	9,58	102,98	8,95
BBDC4	Intermediários Financeiros	74,99	8,25	87,46	7,61
VALE3	Mineração	69,62	7,66	55,04	4,79
PETRA	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	51,59	5,68	77,31	6,72
BVMF3	Serviços Financeiros Diversos	49,75	5,48	67,75	5,89
ABEV3	Bebidas	47,04	5,18	49,78	4,33
ITSA4	Intermediários Financeiros	42,97	4,73	39,10	3,40
LREN3	Comércio	39,28	4,32	51,69	4,50
RENT3	Diversos	39,11	4,30	38,70	3,37
BBAS3	Intermediários Financeiros	29,78	3,28	45,48	3,95

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

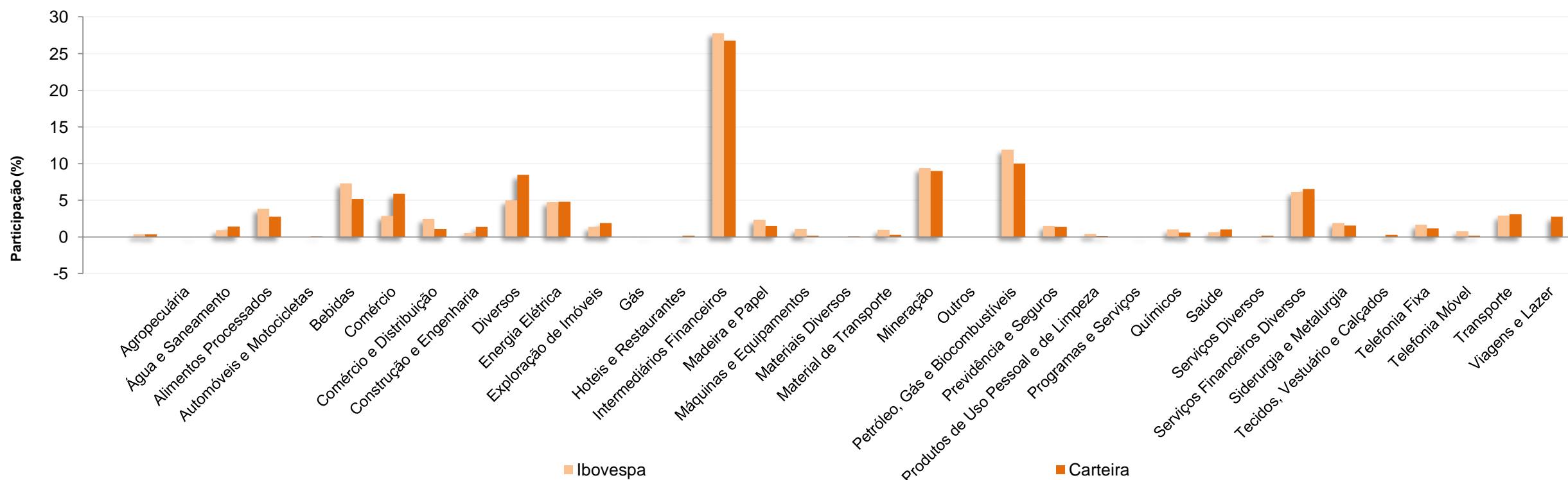
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmorte
ITUB4	87,10	9,58	0,00	1
BBDC4	74,99	8,25	0,00	1
VALE3	69,62	7,66	0,00	1
PETRA	51,59	5,68	0,00	1
BVMF3	49,75	5,48	0,00	1
ABEV3	47,04	5,18	0,00	1
ITSA4	42,97	4,73	0,00	1
LREN3	39,28	4,32	0,00	1
RENT3	39,11	4,30	0,00	1
BBAS3	29,78	3,28	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

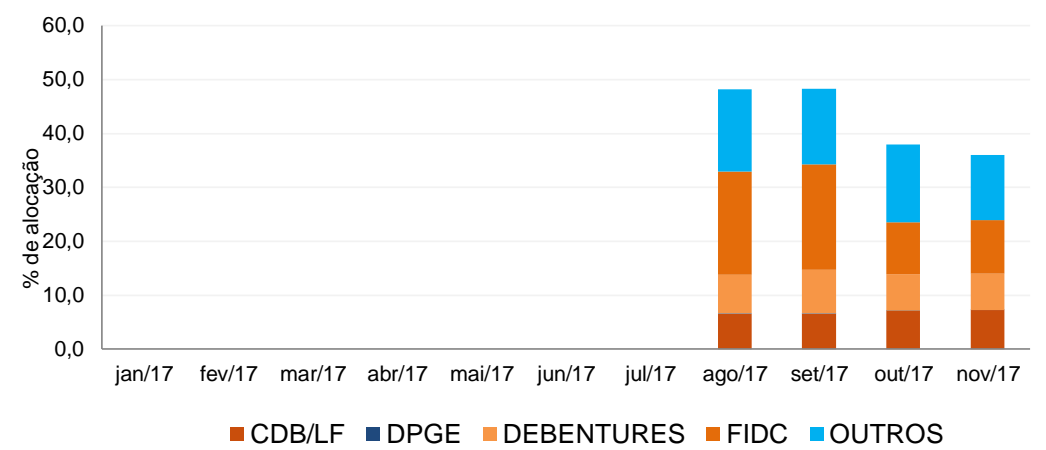
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

Empresas Emissoras e Ratings de Longo Prazo

Nome	MtM*	%	Fitch	Moody's	S&P
FORTE SECURITIZADORA S.A.	7.816,72	8,38			
SECURITIZADORA CREDITOS IMOBILIAF	2.350,02	2,52			
BCO DAYCOVAL SA	942,13	1,01	AA (bra)	Aa2.br	brA+
BCO SAFRA SA	925,34	0,99		Aa1.br	brAA-
SPE SAO FRANCISCO EMPREENDIMENT	826,50	0,89			
BCO BRADESCO SA	710,31	0,76	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
PARANA BCO SA	612,55	0,66	AA- (bra)		brA+
LOCALIZA RENT A CAR SA	541,51	0,58	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
HABITASEC SECURITIZADORA SA	504,93	0,54			
NATURA COSMETICOS SA	499,92	0,54			brAA-

* 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.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Anterior	Atual	Agência	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
Nenhuma mudança de rating encontrada.									

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 investidos.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2018-03-01	01-mar-18	851	0,00%	Selic	10-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	580	0,00%	Selic	07-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	580	0,00%	Selic	29-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	387	0,00%	Selic	13-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	271	0,00%	Selic	06-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	193	0,00%	Selic	01-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	166	0,00%	Selic	20-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	133	0,00%	Selic	17-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-09-01	01-set-18	1.547	0,00%	Selic	10-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-09-01	01-set-18	773	0,00%	Selic	16-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-09-01	01-set-18	387	0,00%	Selic	08-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2019-03-01	01-mar-19	580	0,00%	Selic	13-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2020-09-01	01-set-20	263	0,00%	Selic	17-nov-17	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	1.271	0,00%	PRE	10-nov-17	7,00%	6,97%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	627	0,00%	PRE	06-nov-17	7,00%	7,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	328	0,00%	PRE	24-nov-17	7,00%	6,88%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	271	0,00%	PRE	21-nov-17	7,00%	6,92%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	213	0,00%	PRE	20-nov-17	7,00%	6,93%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	213	0,00%	PRE	01-nov-17	7,00%	7,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	164	0,00%	PRE	20-nov-17	7,00%	6,93%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	148	0,00%	PRE	27-nov-17	7,00%	6,86%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	135	0,00%	PRE	24-nov-17	7,00%	6,88%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	135	0,00%	PRE	07-nov-17	7,00%	7,01%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	119	0,00%	PRE	17-nov-17	7,00%	6,93%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	61	0,00%	PRE	16-nov-17	7,00%	6,95%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	45	0,00%	PRE	01-nov-17	7,00%	7,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	41	0,00%	PRE	20-nov-17	7,00%	6,93%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	214	0,00%	PRE	24-nov-17	7,00%	6,83%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	161	0,00%	PRE	21-nov-17	7,00%	6,89%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	97	0,00%	PRE	27-nov-17	7,00%	6,81%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	89	0,00%	PRE	24-nov-17	7,00%	6,83%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	959	0,00%	PRE	10-nov-17	7,00%	7,06%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	475	0,00%	PRE	06-nov-17	7,00%	7,07%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	246	0,00%	PRE	24-nov-17	7,00%	6,92%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	202	0,00%	PRE	21-nov-17	7,00%	6,99%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	151	0,00%	PRE	20-nov-17	7,00%	7,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	111	0,00%	PRE	27-nov-17	7,00%	6,90%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	99	0,00%	PRE	17-nov-17	7,00%	7,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	99	0,00%	PRE	24-nov-17	7,00%	6,92%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	44	0,00%	PRE	16-nov-17	7,00%	7,04%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	28	0,00%	PRE	20-nov-17	7,00%	7,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	12	0,00%	PRE	17-nov-17	0,00%	7,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
NTN-F 2018-01-01	01-jan-18	2.184	0,00%	PRE	21-nov-17	7,00%	7,12%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
NTN-F 2018-01-01	01-jan-18	371	0,00%	PRE	24-nov-17	7,00%	7,08%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
NTN-F 2018-01-01	01-jan-18	66	0,00%	PRE	22-nov-17	7,00%	7,11%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
NTN-F 2018-01-01	01-jan-18	39	0,00%	PRE	20-nov-17	7,00%	7,15%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF