

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/01/2018

Este relatório apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e rentabilidade. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o 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	94.534.835,25	100,00%				-0,14%	1,40%	3,63%	-0,14%	9,72%	25,58%	44,03%
Benchmark:	CDI					0,58%	1,70%	3,84%	0,58%	9,40%	24,76%	41,44%
Multimercados	87.478.331,77	92,54%			0,52%							
GAP OABPREVGO TO FI MULT	25.760.242,77	27,25%	GAP	100%	0,26%	0,45%	1,60%	3,70%	0,45%	9,13%	24,25%	41,27%
TC OABPREVGO TO FI MULT	33.494.043,92	35,43%	TC	100%	0,46%	0,92%	2,70%	5,33%	0,92%	13,08%	32,51%	54,17%
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	21.797.437,17	23,06%	MONGERAL AEGON	100%	0,96%	0,95%	2,46%	4,98%	0,95%	11,16%	25,95%	44,79%
MERITO MULT I FICFI	6.426.607,91	6,80%	TC	23,22%	2,95%	1,58%	4,76%	7,32%	1,58%	14,50%	34,85%	52,64%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,76%	2,20%	4,87%	0,76%	11,57%	29,78%	50,04%
Renda Fixa	7.056.503,48	7,46%			1,03%							
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF	680.888,85	0,72%	CAIXA	0,00%	0,10%	0,57%	1,74%	4,02%	0,57%	10,18%	25,79%	42,65%
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	495.465,21	0,52%	ITAU	0,00%	0,00%	0,57%	1,66%	3,78%	0,57%	9,35%	24,45%	40,91%
SANTANDER FICFI INSTITUCIONAL RF REF DI	1.115.467,24	1,18%	SANTANDER	0,02%	0,01%	0,58%	1,68%	3,89%	0,58%	9,59%	25,18%	42,21%
BB PREV RF IRF M FI	1.972.863,52	2,09%	BB	0,04%	1,13%	1,29%	2,59%	5,25%	1,29%	13,78%	39,58%	50,47%
NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	1.495.518,54	1,58%	NOVERO	1,44%	3,76%	-15,32%	-14,66%	-13,68%	-15,32%	-10,54%	2,09%	22,99%
DELTA CRED PRIV FC FIRF	1.296.300,12	1,37%	NOVERO	5,36%	0,01%	-32,32%	-32,46%	-32,80%	-32,32%	-33,03%	-	-
Benchmark:	CDI					0,58%	1,70%	3,84%	0,58%	9,40%	24,76%	41,44%
Total	94.534.835,25	100%			0,54%	-0,14%	1,40%	3,63%	-0,14%	9,72%	25,58%	44,03%
Benchmark:	INPC + 5% a.a.					0,66%	1,89%	3,49%	0,66%	6,91%	18,38%	38,27%

* 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.

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.

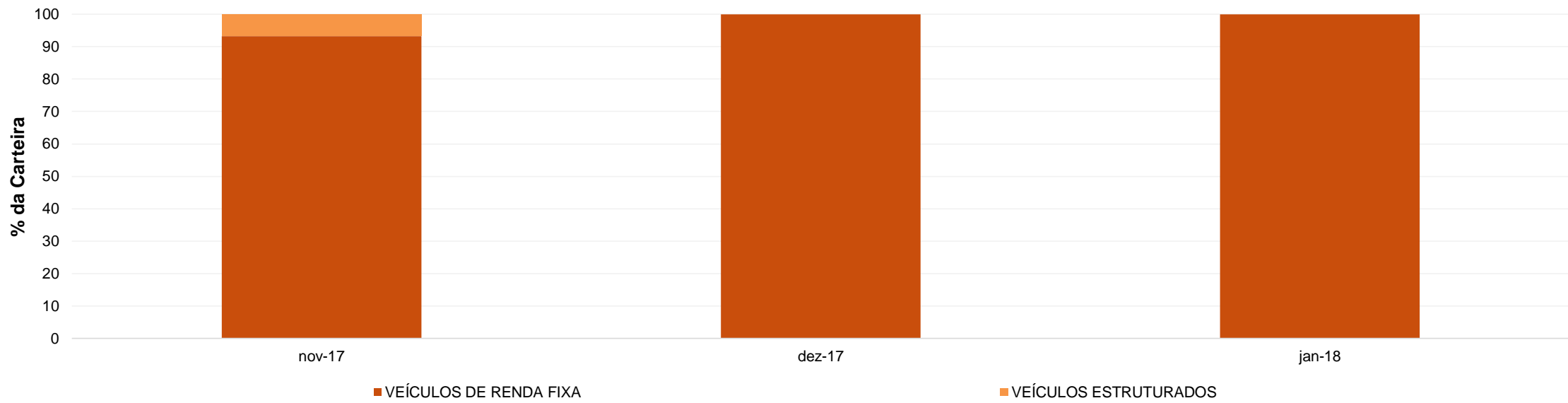
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

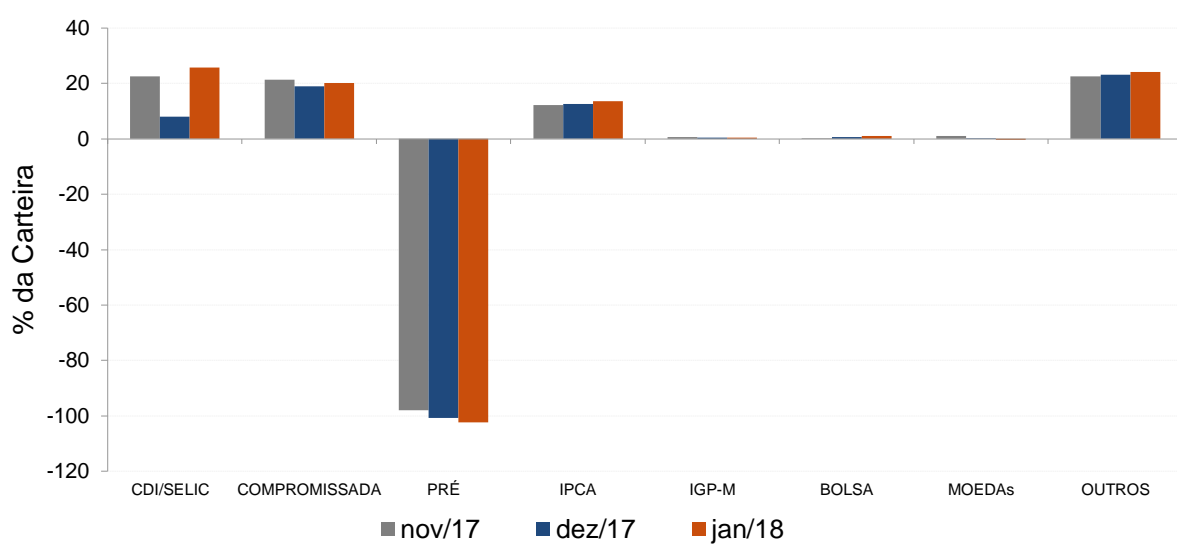
Distribuição da Carteira

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.

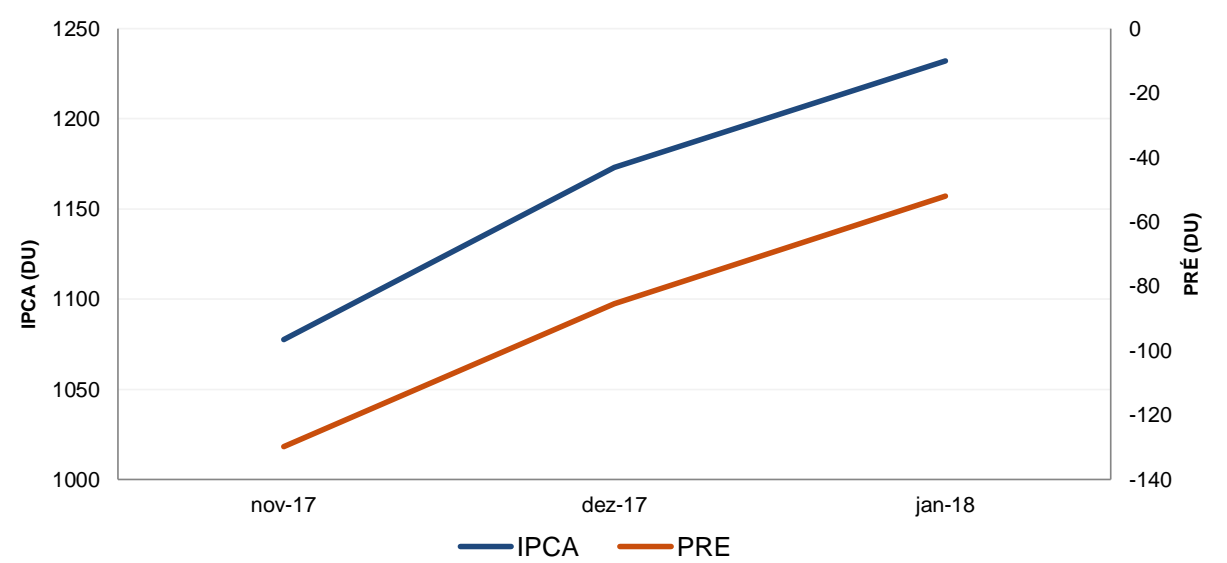
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
ITUB4	Intermediários Financeiros	105,28	12,71	79,43	9,50
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	82,54	9,96	54,39	6,51
BBDC4	Intermediários Financeiros	69,88	8,44	62,01	7,42
BVMF3	Serviços Financeiros Diversos	64,01	7,73	53,27	6,37
VALE3	Mineração	57,63	6,96	65,87	7,88
RENT3	Diversos	52,59	6,35	44,73	5,35
ESTC3	Diversos	38,16	4,61	30,63	3,66
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	32,69	3,95	27,33	3,27
CVCB3	Viagens e Lazer	30,55	3,69	33,00	3,95
ITSA4	Intermediários Financeiros	27,88	3,37	31,06	3,72

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

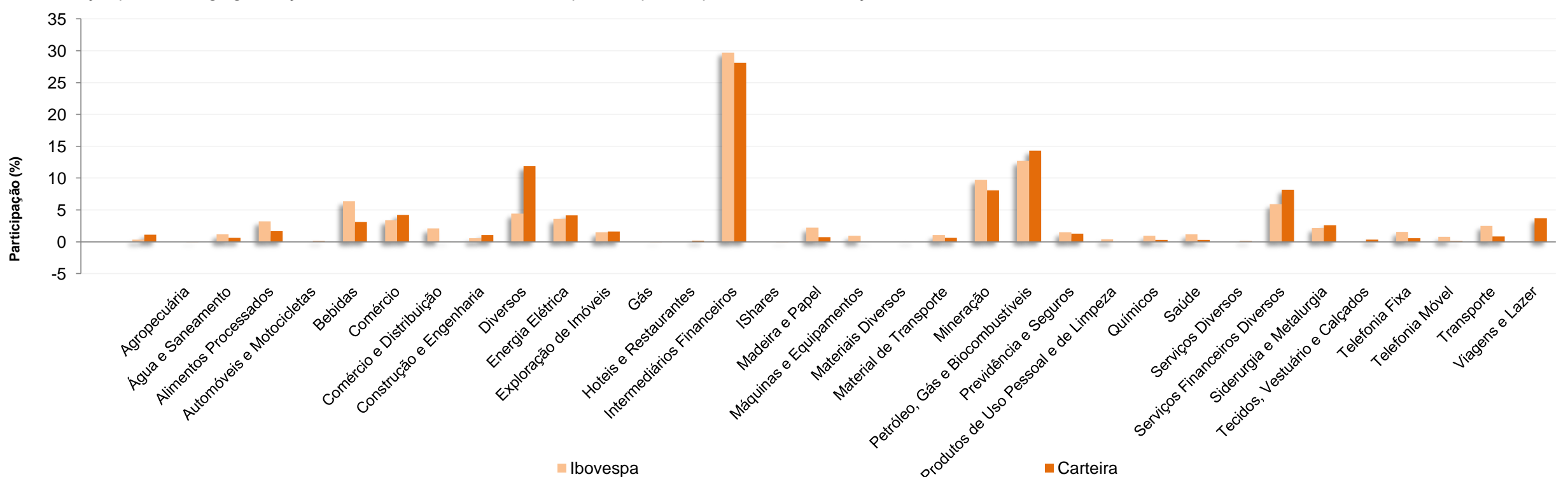
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
SUZB5	1,15	0,14	0,00	Sem Liquidez
ITUB4	105,28	12,71	0,00	1
PETR4	82,54	9,96	0,00	1
BBDC4	69,88	8,44	0,00	1
BVMF3	64,01	7,73	0,00	1
VALE3	57,63	6,96	0,00	1
RENT3	52,59	6,35	0,00	1
ESTC3	38,16	4,61	0,00	1
PETR3	32,69	3,95	0,00	1
CVCB3	30,55	3,69	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.



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.

Análises de Contrapartes

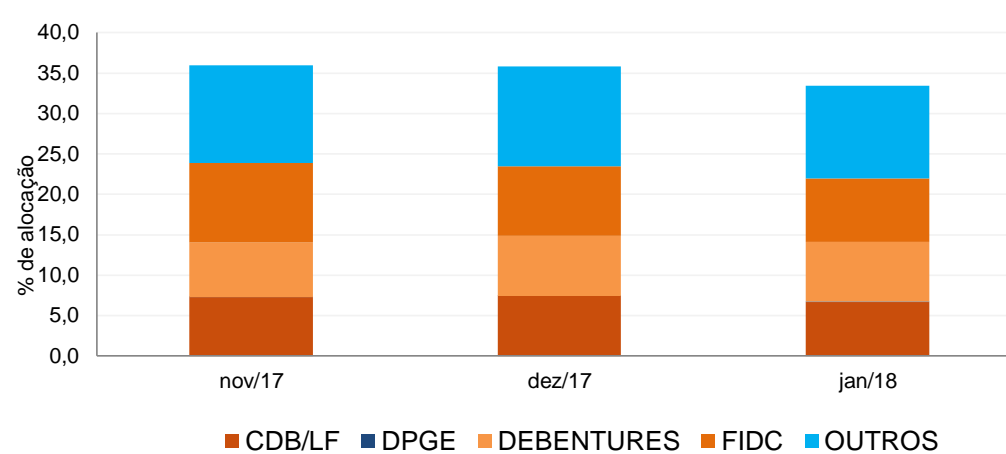
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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.	8.196,18	8,57			
SECURITIZADORA CREDITOS IMOBILIAF	1.551,86	1,62			
BCO SAFRA SA	982,79	1,03		Aa1.br	brAA-
SPE SAO FRANCISCO EMPREENDIMENT	863,59	0,90			
BCO DAYCOVAL SA	843,81	0,88	AA (bra)	Aa2.br	brA+
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL IN\	795,23	0,83	AA (bra)	Aa1.br	
BCO BRADESCO SA	598,50	0,63	AAA (bra)	Aa1.br	brAA-
LOCALIZA RENT A CAR SA	590,94	0,62	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
HABITASEC SECURITIZADORA SA	511,54	0,54			
NATURA COSMETICOS SA	466,11	0,49			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
CSSA12	0,00	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	20-jun-18	CDI	1,09%	BNPP MASTER DI FI RF REF
CSSA12	0,00	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	20-jun-18	CDI	1,09%	BNPP MASTER DI FI RF REF
CSSA12	0,03	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	20-jun-18	CDI	1,09%	BNPP MASTER DI FI RF REF
CSSA12	0,00	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	20-jun-18	CDI	1,09%	BNPP MASTER DI FI RF REF
CSSA12	1,29	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	20-jun-18	CDI	24,48%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CREI
CSSA12	0,00	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	20-jun-18	CDI	27,54%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CREI
CSSA12	0,73	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	20-jun-18	CDI	33,15%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CREI
CSSA12	0,05	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	20-jun-18	CDI	1,09%	BNPP MASTER DI FI RF REF
CSSA12	0,00	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	20-jun-18	CDI	1,09%	BNPP MASTER DI FI RF REF
CSSA12	0,00	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	20-jun-18	CDI	1,09%	BNPP MASTER DI FI RF REF
CSSA13	1,49	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	10-mar-19	CDI	1,40%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CREI
CSSA13	0,00	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	10-mar-19	CDI	1,40%	BRASIL PLURAL YIELD FI RF REF DI
CSSA13	0,28	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	10-mar-19	CDI	1,40%	BRASIL PLURAL YIELD FI RF REF DI
CSSA13	0,19	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	10-mar-19	CDI	1,40%	BRASIL PLURAL YIELD FI RF REF DI
CSSA13	0,03	CENTROVIAS SISTEMAS RODOVIARIOS SA	A1.br	Aa2.br	Moody's	10-mar-19	CDI	1,40%	BRASIL PLURAL YIELD FI RF REF DI

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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Rating	Agência	Veículo
CRI SCCI 1 14	10-out-50	-8.992	-0,01%	IPCA	SECURITIZADORA CREDITOS IMOBILIARI	03-jan-18	13,56%	Rating	Agência	NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2018-03-01	01-mar-18	1.820	0,00%	Selic		11-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	649	0,00%	Selic		18-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	546	0,00%	Selic		04-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	364	0,00%	Selic		19-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	364	0,00%	Selic		08-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	364	0,00%	Selic		02-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-03-01	01-mar-18	7	0,00%	Selic		16-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-09-01	01-set-18	2.002	0,00%	Selic		24-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-09-01	01-set-18	2.002	0,00%	Selic		19-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-09-01	01-set-18	910	0,00%	Selic		18-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-09-01	01-set-18	546	0,00%	Selic		15-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2018-09-01	01-set-18	364	0,00%	Selic		19-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2019-03-01	01-mar-19	6.177	0,01%	Selic		11-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2020-03-01	01-mar-20	728	0,00%	Selic		31-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2020-03-01	01-mar-20	728	0,00%	Selic		29-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2020-03-01	01-mar-20	400	0,00%	Selic		18-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2020-03-01	01-mar-20	218	0,00%	Selic		19-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LFT 2020-03-01	01-mar-20	153	0,00%	Selic		31-jan-18	0,00%	0,00%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	1.400	0,00%	PRE		05-jan-18	7,00%	6,71%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	910	0,00%	PRE		02-jan-18	7,00%	6,74%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	772	0,00%	PRE		11-jan-18	7,00%	6,75%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	625	0,00%	PRE		11-jan-18	7,00%	6,75%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	455	0,00%	PRE		03-jan-18	7,00%	6,69%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-04-01	01-abr-18	50	0,00%	PRE		03-jan-18	7,00%	6,69%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	1.071	0,00%	PRE		02-jan-18	7,00%	6,62%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	759	0,00%	PRE		11-jan-18	7,00%	6,64%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	653	0,00%	PRE		02-jan-18	7,00%	6,62%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	410	0,00%	PRE		11-jan-18	7,00%	6,64%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	402	0,00%	PRE		10-jan-18	7,00%	6,63%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	255	0,00%	PRE		31-jan-18	7,00%	6,56%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	142	0,00%	PRE		26-jan-18	7,00%	6,55%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	91	0,00%	PRE		02-jan-18	7,00%	6,62%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	72	0,00%	PRE		04-jan-18	7,00%	6,58%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	15	0,00%	PRE		09-jan-18	7,00%	6,60%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-07-01	01-jul-18	8	0,00%	PRE		08-jan-18	7,00%	6,60%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	4.108	0,00%	PRE		02-jan-18	7,00%	6,67%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	1.143	0,00%	PRE		04-jan-18	7,00%	6,61%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	713	0,00%	PRE		02-jan-18	7,00%	6,67%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	493	0,00%	PRE		19-jan-18	7,00%	6,69%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	336	0,00%	PRE		11-jan-18	7,00%	6,71%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	302	0,00%	PRE		10-jan-18	7,00%	6,68%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	210	0,00%	PRE		31-jan-18	7,00%	6,61%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	194	0,00%	PRE		24-jan-18	7,00%	6,62%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	179	0,00%	PRE		22-jan-18	7,00%	6,69%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	161	0,00%	PRE		15-jan-18	7,00%	6,71%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	112	0,00%	PRE		31-jan-18	7,00%	6,61%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	93	0,00%	PRE		02-jan-18	7,00%	6,67%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	75	0,00%	PRE		15-jan-18	7,00%	6,71%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	56	0,00%	PRE		24-jan-18	7,00%	6,62%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	26	0,00%	PRE		10-jan-18	7,00%	6,68%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2018-10-01	01-out-18	7	0,00%	PRE		08-jan-18	7,00%	6,64%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	1.101	0,00%	PRE		03-jan-18	7,00%	6,69%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	738	0,00%	PRE		03-jan-18	7,00%	6,69%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	734	0,00%	PRE		03-jan-18	7,00%	6,69%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	734	0,00%	PRE		03-jan-18	7,00%	6,69%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	474	0,00%	PRE		10-jan-18	7,00%	6,82%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	277	0,00%	PRE		03-jan-18	7,00%	6,69%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	257	0,00%	PRE		15-jan-18	7,00%	6,84%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	257	0,00%	PRE		31-jan-18	7,00%	6,76%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	209	0,00%	PRE		05-jan-18	7,00%	6,73%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	138	0,00%	PRE		23-jan-18	7,00%	6,83%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	125	0,00%	PRE		05-jan-18	7,00%	6,73%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	55	0,00%	PRE		30-jan-18	7,00%	6,76%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	46	0,00%	PRE		24-jan-18	7,00%	6,76%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
LTN 2019-01-01	01-jan-19	33	0,00%	PRE		15-jan-18	7,00%	6,84%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
NTN-F 2019-01-01	01-jan-19	202	0,00%	PRE		03-jan-18	7,00%	6,73%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
NTN-F 2019-01-01	01-jan-19	21	0,00%	PRE		09-jan-18	7,00%	6,76%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF
NTN-F 2019-01-01	01-jan-19	14	0,00%	PRE		09-jan-18	7,00%	6,76%	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TP RF

