

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 29/06/2018

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	95.920.270,61	97,23%				0,62%	1,13%	2,24%	2,24%	5,57%	18,72%	36,91%	
Benchmark:	CDI					0,52%	1,56%	3,18%	3,18%	7,37%	21,18%	38,26%	
Multimercados	90.639.884,55	91,88%				0,58%							
GAP OABPREVGO TO FI MULT	23.381.982,55	23,70%	GAP	100%	0,10%	0,57%	1,36%	2,89%	2,89%	7,19%	20,71%	37,63%	
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	25.678.986,66	26,03%	MONGERAL AEGON	100%	0,77%	0,67%	1,08%	3,78%	3,78%	9,03%	22,32%	41,33%	
TC OABPREVGO TO FI MULT	34.792.068,38	35,27%	TC	100%	0,85%	0,64%	2,37%	4,80%	4,80%	11,05%	28,17%	50,21%	
MERITO MULT I FICFI	6.786.846,96	6,88%	TC	22,76%	0,98%	1,33%	4,40%	8,15%	8,15%	15,66%	33,32%	54,49%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0,68%	2,06%	4,19%	4,19%	9,49%	26,04%	46,67%	
Renda Fixa	5.280.386,06	5,35%				1,15%							
BB PREV RF IRF M FI	1.991.830,38	2,02%	BB	0,04%	2,35%	0,01%	-1,42%	2,26%	2,26%	8,71%	26,69%	47,18%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	910.505,86	0,92%	ITAU	0,01%	0,00%	0,51%	1,52%	3,09%	3,09%	7,23%	20,90%	37,71%	
NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	1.088.148,64	1,10%	NOVERO	1,44%	1,71%	0,68%	-26,97%	-37,60%	-37,60%	-36,13%	-30,07%	-16,64%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	1.289.901,18	1,31%	NOVERO	5,36%	0,06%	-0,06%	-0,19%	-32,65%	-32,65%	-33,17%	-	-	
Benchmark:	CDI					0,52%	1,56%	3,18%	3,18%	7,37%	21,18%	38,26%	
Renda Variável	2.731.846,41	2,77%				-5,11%	-12,37%						
Benchmark:	IBOVESPA					-5,20%	-14,76%	-4,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	37,08%	
Renda Variável	2.731.846,41	2,77%											
MOAT CAPITAL FIC FIA	1.364.987,24	1,38%	MOAT CAPITAL	0,29%	12,18%	-5,25%	-10,69%	1,50%	1,50%	39,77%	95,38%	109,22%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	946.012,62	0,96%	SANTANDER	0,33%	11,23%	-5,14%	-14,44%	-5,57%	-5,57%	13,92%	38,93%	32,88%	
VERTRA INSTITUCIONAL FC FIA	420.846,55	0,43%	VERTRA	0,78%	6,68%	-4,62%	-15,61%	-14,86%	-14,86%	2,90%	21,17%	32,32%	
Benchmark:	IBOVESPA					-5,20%	-14,76%	-4,76%	-4,76%	15,68%	41,22%	37,08%	
Total	98.652.117,02	100%				0,84%	0,44%	0,83%	2,10%	2,10%	5,42%	18,55%	36,72%
Benchmark:	INPC + 5% a.a.					1,84%	3,33%	5,06%	5,06%	8,64%	16,97%	34,47%	

* 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.

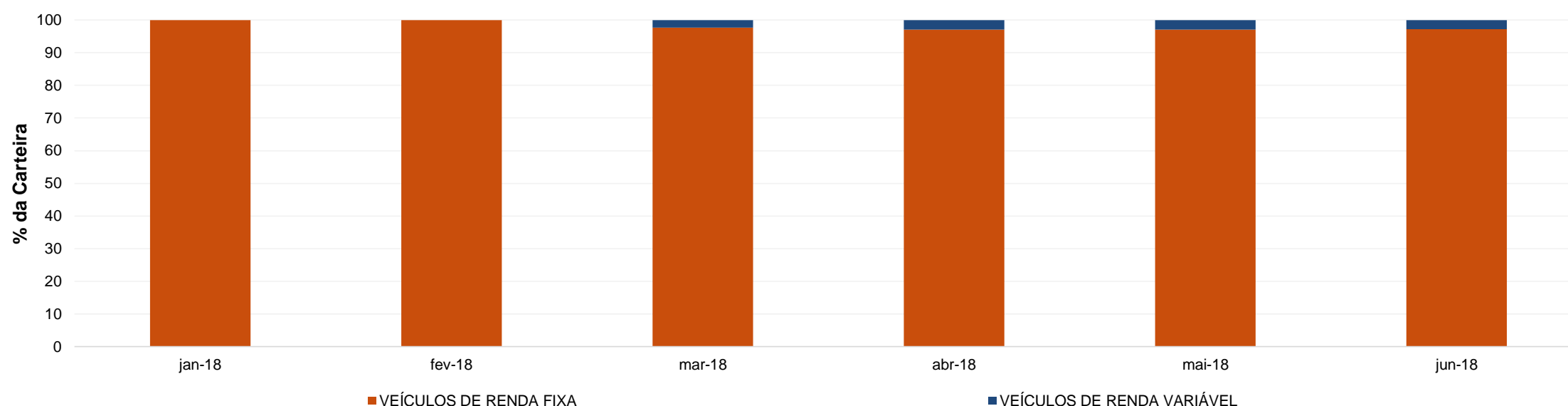
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

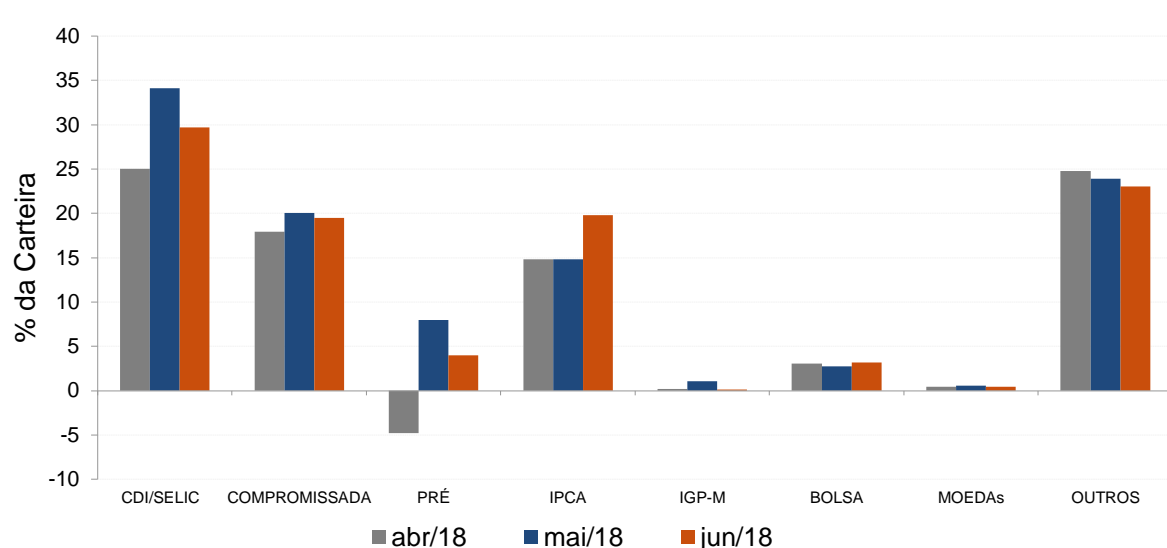
Distribuição da Carteira

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.

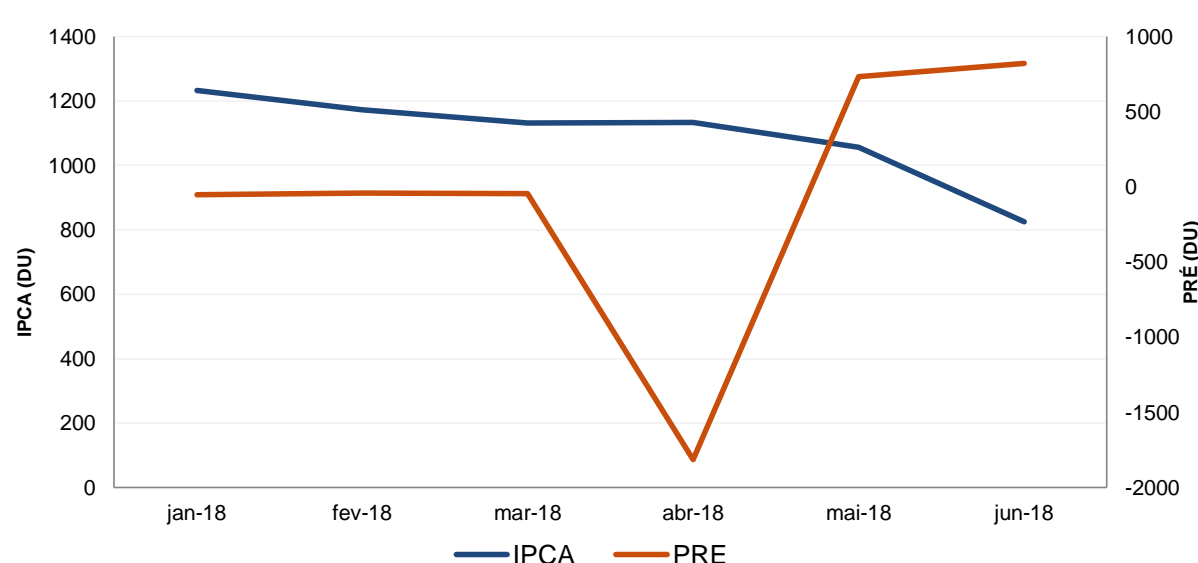
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
BBAS3	Intermediários Financeiros	202,14	6,51	174,13	5,49
GFS3	Construção e Engenharia	165,51	5,33	0,00	
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	159,53	5,14	93,28	2,94
VALE3	Mineração	157,51	5,07	168,08	5,30
ITUB4	Intermediários Financeiros	149,75	4,83	166,13	5,24
VVAR11	Comércio	135,92	4,38	69,42	2,19
BRKM5	Químicos	122,24	3,94	118,31	3,73
ECOR3	Transporte	118,90	3,83	109,61	3,46
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	118,84	3,83	101,58	3,20
CMIG4	Energia Elétrica	97,56	3,14	81,77	2,58

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

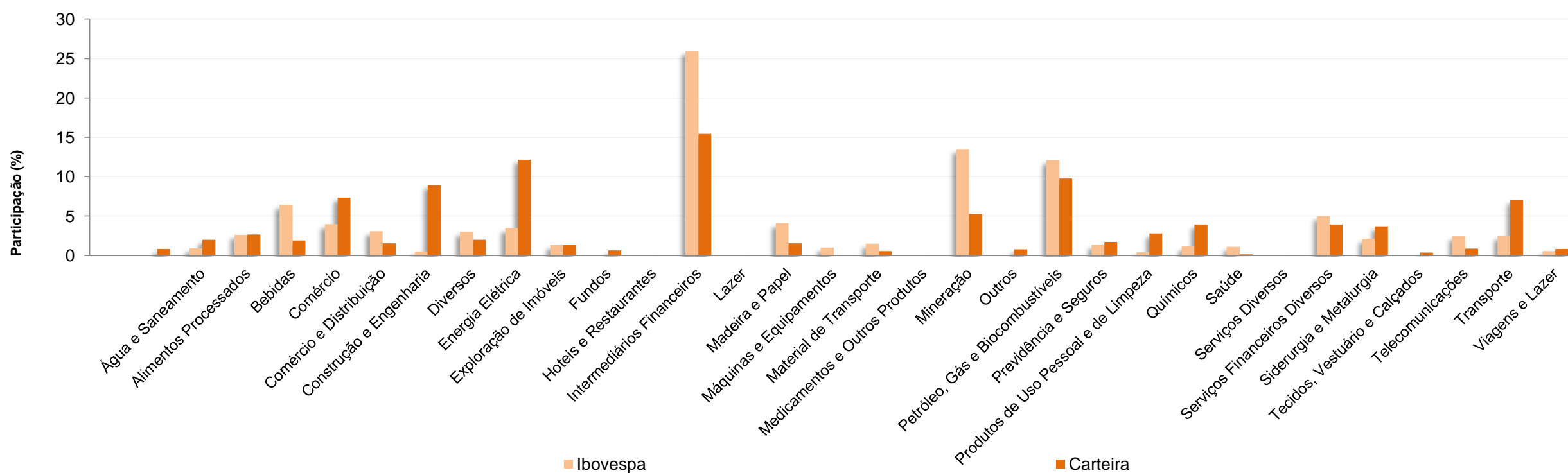
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BBAS3	202,14	6,51	0,00	1
GFS3	165,51	5,33	0,04	1
PETR4	159,53	5,14	0,00	1
VALE3	157,51	5,07	0,00	1
ITUB4	149,75	4,83	0,00	1
VVAR11	135,92	4,38	0,01	1
BRKM5	122,24	3,94	0,00	1
ECOR3	118,90	3,83	0,01	1
B3SA3	118,84	3,83	0,00	1
CMIG4	97,56	3,14	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

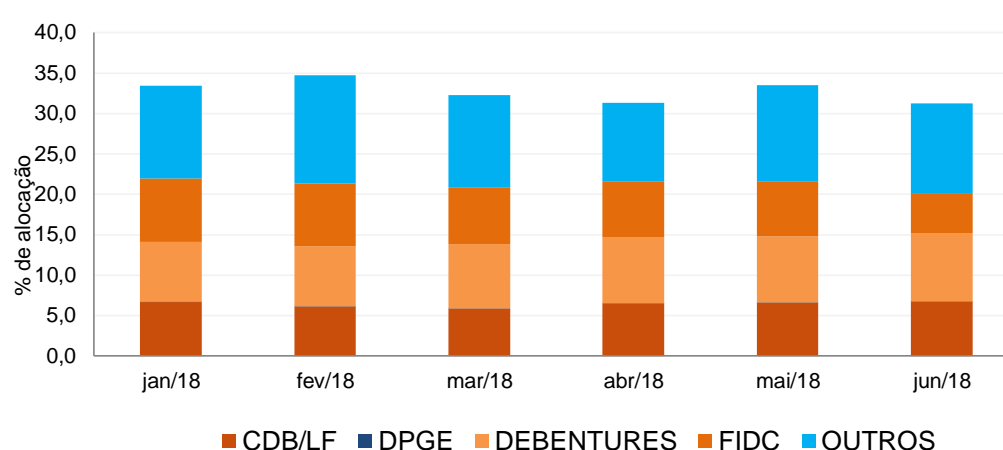
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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.	9.234,09	9,07			
HABITASEC SECURITIZADORA SA	1.311,83	1,29			
BCO DAYCOVAL SA	955,79	0,94	AA (bra)	Aa2.br	brA+
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL IN\	848,36	0,83	AA (bra)	Aa1.br	
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM	806,40	0,79	AAA (bra)	Aa2.br	brAA-
BANCO RCI BRASIL SA	700,89	0,69		Aaa.br	
COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SA	682,15	0,67	AA (bra)	Aa2.br	
SPE SAO FRANCISCO EMPREENDIMEN	666,28	0,65			
LOCALIZA RENT A CAR SA	589,85	0,58	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
PARANA BCO SA	564,41	0,55	AA- (bra)		brA+

* 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
ENGI10	20,14	ENERGISA SA	Novo	AA+ (bra)	Fitch	20-jun-21	CDI	1,16%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CREI
LIQP15	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP15	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP15	0,24	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP15	0,01	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP15	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP15	0,13	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP15	0,04	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP15	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP15	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP15	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP15	0,02	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP15	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP15	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP15	0,02	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP15	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-dez-27	CDI	2,15%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP25	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP25	0,02	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP25	1,58	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP25	0,08	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP25	0,01	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP25	0,84	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP25	0,23	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP25	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP25	0,01	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP25	0,01	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP25	0,12	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP25	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP25	27,66	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
LIQP25	0,11	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
LIQP25	0,00	LIQ PARTICIPACOES S.A	C(bra)	CCC(bra)	Fitch	15-ago-30	CDI	2,50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
USIM16	0,34	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIM	brBB	brBBB	S&P	15-set-26	CDI	3,04%	SANTANDER FI PROFIT REF DI
USIM16	0,02	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIM	brBB	brBBB	S&P	15-set-26	CDI	3,04%	SANTANDER FI PROFIT REF DI
USIM16	0,00	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIM	brBB	brBBB	S&P	15-set-26	CDI	3,04%	SANTANDER FI PROFIT REF DI
USIM16	0,00	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIM	brBB	brBBB	S&P	15-set-26	CDI	3,04%	SANTANDER FI PROFIT REF DI

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 29/06/2018

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
CPGEB1	18-mai-23	341.649	0,34%	CDI	CPFL GERACAO ENERGIA SA	19-jun-18	107,50%	Aaa.br	Moody's	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
SAPR28	21-jun-23	341.483	0,34%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO PARANA SAN	21-jun-18	108,00%	Aa2.br	Moody's	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2018-08-15	15-ago-18	2.207.995	2,17%	IPCA		27-jun-18	2,00%	-1,81%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2020-08-15	15-ago-20	174.207	0,17%	IPCA		18-jun-18	4,31%	4,16%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2020-08-15	15-ago-20	92.034	0,09%	IPCA		21-jun-18	4,04%	4,07%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	171.410	0,17%	IPCA		18-jun-18	5,03%	4,87%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2021-05-15	15-mai-21	29.107	0,03%	IPCA		21-jun-18	4,72%	4,80%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	435.059	0,43%	IPCA		01-jun-18	5,23%	4,99%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	324.671	0,32%	IPCA		29-jun-18	5,36%	5,34%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	64.934	0,06%	IPCA		29-jun-18	5,37%	5,34%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML

