

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/08/2018

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.

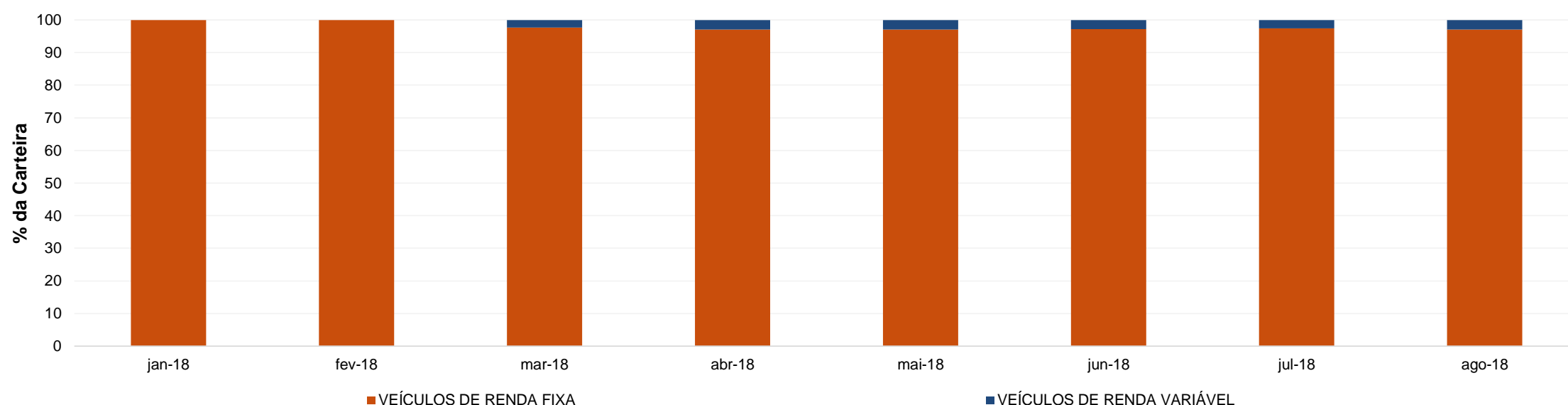
VEÍCULO DE INVESTIMENTO	ALOCAÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	97.596.630,33	97,12%				0,55%	1,89%	3,24%	3,53%	5,54%	17,70%	35,64%	
Benchmark:	CDI					0,57%	1,64%	3,24%	4,32%	6,84%	19,74%	36,66%	
Multimercados	92.523.180,95	92,07%				0,26%							
GAP OABPREVGO TO FI MULT	23.620.577,37	23,51%	GAP	100%	0,11%	0,48%	1,60%	3,02%	3,94%	6,44%	19,11%	35,83%	
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	26.571.108,32	26,44%	MONGERAL AEGON	100%	0,57%	0,38%	1,84%	3,47%	4,99%	8,00%	21,08%	39,61%	
TC OABPREVGO TO FI MULT	35.378.821,04	35,21%	TC	100%	0,39%	0,93%	2,35%	4,92%	6,58%	10,07%	27,00%	48,94%	
MERITO MULT I FICFI	6.952.674,22	6,92%	TC	25,17%	0,87%	1,27%	2,96%	7,27%	9,89%	15,05%	32,63%	53,27%	
Benchmark:	INPC + 5% a.a.					0,45%	2,99%	5,00%	6,25%	8,78%	16,18%	33,72%	
Renda Fixa	5.073.449,38	5,05%				1,10%							
BB PREV RF IRF M FI	2.002.051,82	1,99%	BB	0,04%	1,81%	-0,96%	0,53%	0,37%	2,79%	5,71%	24,46%	47,48%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	726.708,14	0,72%	ITAU	0,01%	0,00%	0,55%	1,60%	3,16%	4,21%	6,69%	19,46%	36,11%	
NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	1.056.460,62	1,05%	NOVERO	1,45%	2,22%	-3,40%	-1,87%	-28,48%	-39,18%	-38,37%	-33,48%	-21,07%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	1.288.228,80	1,28%	NOVERO	5,36%	0,03%	-0,07%	-0,19%	-0,56%	-32,74%	-33,17%	-33,33%	-	
Benchmark:	CDI					0,57%	1,64%	3,24%	4,32%	6,84%	19,74%	36,66%	
Renda Variável	2.890.150,68	2,88%				-7,90%	-5,31%	-13,10%					
Benchmark:	IBOVESPA					-3,21%	-0,10%	-10,16%	0,36%	8,25%	32,43%	64,46%	
Renda Variável	2.890.150,68	2,88%											
MOAT CAPITAL FIC FIA	1.909.847,33	1,90%	MOAT CAPITAL	0,35%	13,15%	-6,55%	-3,30%	-7,52%	3,58%	18,45%	66,79%	138,38%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	980.303,35	0,98%	SANTANDER	0,43%	10,18%	-4,58%	-1,70%	-11,91%	-2,15%	5,51%	28,72%	54,30%	
Benchmark:	IBOVESPA					-3,21%	-0,10%	-10,16%	0,36%	8,25%	32,43%	64,46%	
Total	100.486.781,01	100%				0,56%	0,33%	1,65%	2,82%	3,23%	6,17%	19,40%	37,70%
Benchmark:	INPC + 5% a.a.					0,45%	2,99%	5,00%	6,25%	8,78%	16,18%	33,72%	

* 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.

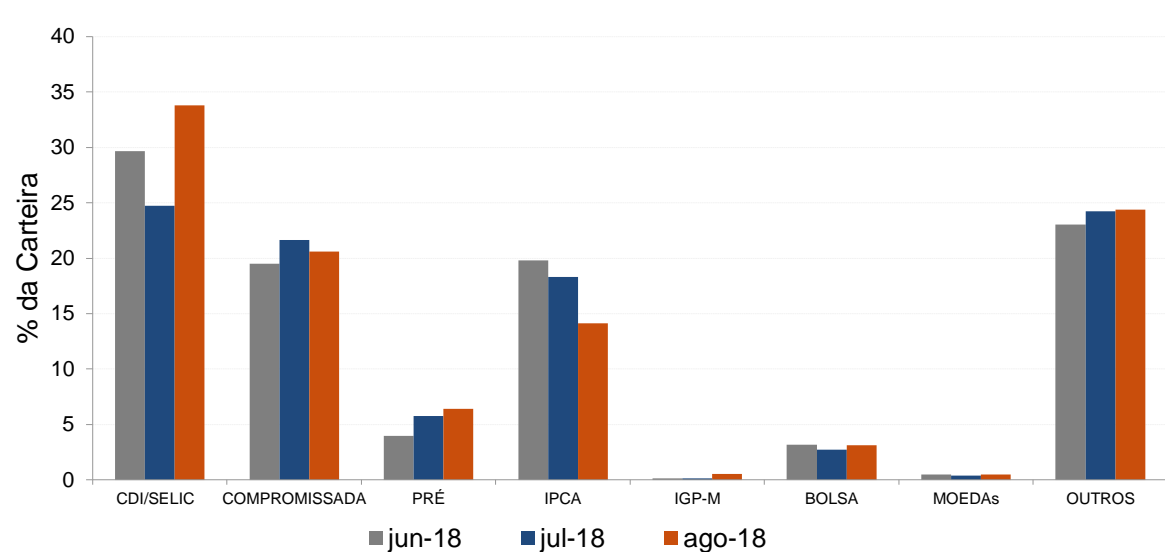
Distribuição da Carteira

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.

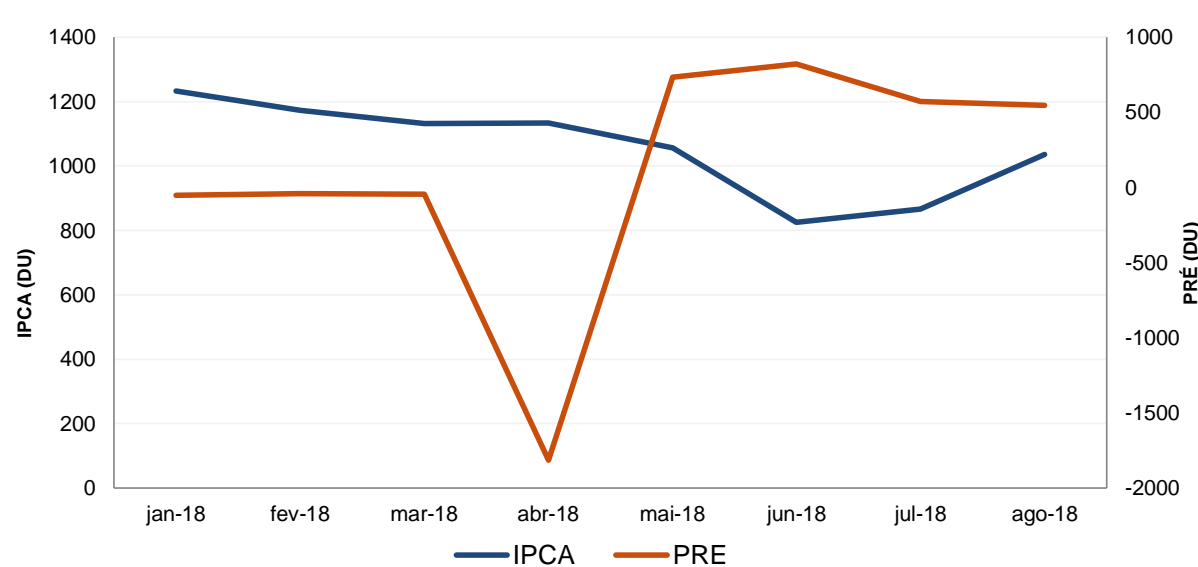
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	378,07	8,69	285,65	8,92
BBDC4	Intermediários Financeiros	330,34	7,59	222,65	6,95
VALE3	Mineração	321,76	7,39	210,51	6,57
ITUB4	Intermediários Financeiros	286,17	6,58	193,34	6,04
BBAS3	Intermediários Financeiros	264,66	6,08	204,91	6,40
CMIG4	Energia Elétrica	191,88	4,41	127,65	3,98
GGBR4	Siderurgia e Metalurgia	170,40	3,92	113,06	3,53
ECOR3	Transporte	151,79	3,49	121,21	3,78
JBSS3	Alimentos Processados	138,09	3,17	68,34	2,13
VVAR11	Comércio	122,38	2,81	153,99	4,81

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

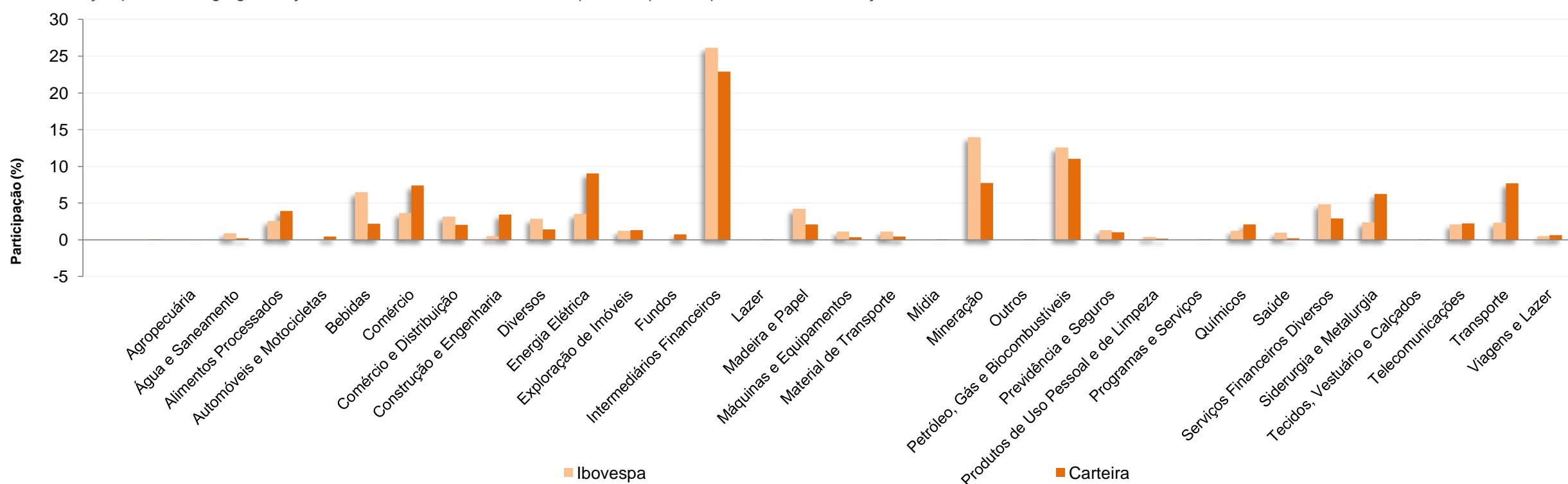
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PETR4	378,07	8,69	0,00	1
BBDC4	330,34	7,59	0,00	1
VALE3	321,76	7,39	0,00	1
ITUB4	286,17	6,58	0,00	1
BBAS3	264,66	6,08	0,00	1
CMIG4	191,88	4,41	0,00	1
GGBR4	170,40	3,92	0,00	1
ECOR3	151,79	3,49	0,01	1
JBSS3	138,09	3,17	0,00	1
VVAR11	122,38	2,81	0,01	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

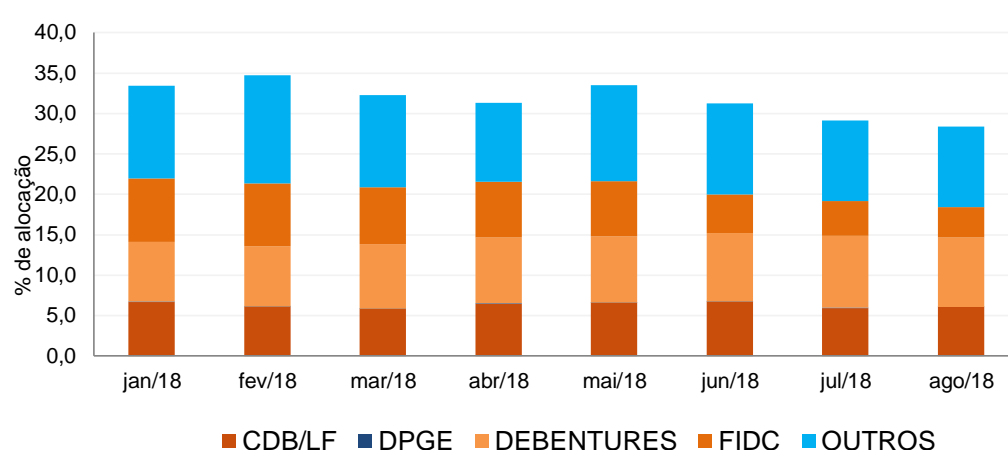
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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.	8.158,33	7,97			
HABITASEC SECURITIZADORA SA	1.325,44	1,29			
BCO BRADESCO SA	1.047,58	1,02	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL IN\	873,07	0,85	AA (bra)	Aa1.br	
BANCO RCI BRASIL SA	731,09	0,71		Aaa.br	
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM	726,13	0,71	AAA (bra)	Aa2.br	brAAA
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES SA	626,05	0,61	AA- (bra)		brAAA
LOCALIZA RENT A CAR SA	593,33	0,58	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
IOCHPE MAXION SA	517,39	0,51			brAAA
NATURA COSMETICOS SA	498,85	0,49	AA (bra)		brAAA

* 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
CEMA18	0,00	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,00%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
CEMA18	0,08	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,00%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
CEMA18	0,06	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,00%	SAFRA FI RF REF DI CRED PRIV
CEMA18	1,72	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,00%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
CEMA18	0,02	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,00%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
CEMA18	0,01	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,00%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
CEMA18	0,02	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,00%	SAFRA FI RF REF DI CRED PRIV
CEMA18	0,92	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,00%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
CEMA18	0,00	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,00%	SAFRA FI RF REF DI CRED PRIV
CEMA18	0,13	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,00%	ICATU VANGUARDA GOLD FI RF LP
CEMA18	0,00	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	15-set-22	CDI	107,00%	SAFRA FI RF REF DI CRED PRIV
ENMA24	0,00	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	21-jun-20	IPCA	5,01%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
ENMA24	0,02	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	21-jun-20	IPCA	5,01%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
ENMA24	0,35	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	21-jun-20	IPCA	5,01%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
ENMA24	0,00	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	21-jun-20	IPCA	5,01%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
ENMA24	0,00	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	21-jun-20	IPCA	5,01%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
ENMA24	0,18	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	21-jun-20	IPCA	5,01%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
ENMA24	44,24	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	21-jun-20	IPCA	5,01%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
ENMA24	0,03	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	21-jun-20	IPCA	5,01%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF I
NP CDI	0,00	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER CREDITO FI RF CRED F
NP CDI	0,19	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER CREDITO FI RF CRED F
NP CDI	2,47	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER CREDITO FI RF CRED F
NP CDI	0,08	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER DI FI RF REF
NP CDI	1,32	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER CREDITO FI RF CRED F
NP CDI	0,02	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	SAFRA FI RF REF DI CRED PRIV
NP CDI	0,00	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	SAFRA FI RF REF DI CRED PRIV
NP CDI	0,00	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER DI FI RF REF
NP CDI	0,14	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER DI FI RF REF
NP CDI	0,96	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER DI FI RF REF
NP CDI	0,02	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER CREDITO FI RF CRED F
NP CDI	0,00	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	SAFRA FI RF REF DI CRED PRIV
NP CDI	1,80	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER DI FI RF REF
NP CDI	0,02	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER CREDITO FI RF CRED F
NP CDI	0,02	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER DI FI RF REF
NP CDI	0,11	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER CREDITO FI RF CRED F
NP CDI	0,05	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	SAFRA FI RF REF DI CRED PRIV
NP CDI	0,01	CIA ENERGETICA MARANHAO CEMAR	AA+ (bra)	AA- (bra)	Fitch	29-jan-21	CDI	106,00%	BNPP MASTER DI FI RF REF

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/08/2018

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
MRVEB2	05-jul-25	426.584	0,42%	CDI	MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES SA	02-ago-18	1,78%	AA- (bra)	Fitch	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
SSED11	15-ago-21	122.788	0,12%	CDI	SABER SERVICOS EDUCACIONAIS SA	15-ago-18	0,75%	AA+ (bra)	Fitch	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2021-03-01	01-mar-21	19.154	0,02%	Selic		16-ago-18	0,01%	0,01%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2019-10-01	01-out-19	21.778	0,02%	PRE		08-ago-18	7,70%	7,70%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2019-10-01	01-out-19	9.074	0,01%	PRE		09-ago-18	7,79%	7,79%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2020-01-01	01-jan-20	8.855	0,01%	PRE		08-ago-18	7,98%	7,98%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2020-01-01	01-jan-20	8.855	0,01%	PRE		09-ago-18	8,08%	8,08%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2020-10-01	01-out-20	9.823	0,01%	PRE		06-ago-18	8,64%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2022-01-01	01-jan-22	42.296	0,04%	PRE		09-ago-18	9,76%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI

