

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/11/2018

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	100.393.808,42	96,51%				0,34%	2,07%	4,00%	5,68%	6,25%	16,57%	33,42%	
Benchmark:	CDI					0,49%	1,51%	3,17%	5,90%	6,47%	17,75%	34,28%	
Multimercados	93.471.991,59	89,86%				0,94%							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	32.121.258,00	30,88%	MONGERAL AEGON	100%	1,12%	0,46%	2,07%	3,95%	7,17%	8,18%	20,41%	37,62%	
TC OABPREVGO TO FI MULT	26.286.625,21	25,27%	TC	100%	0,60%	0,85%	2,57%	5,00%	9,33%	10,23%	25,57%	47,44%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT	35.064.108,38	33,71%	VINCI	100%	1,09%	0,12%	1,86%	3,49%	5,88%	6,49%	17,69%	34,08%	
Benchmark:	INPC + 5% a.a.					0,14%	1,64%	4,68%	7,99%	8,69%	16,33%	31,14%	
Renda Fixa	6.921.816,83	6,65%				1,17%							
BB PREV RF IRF M FI	2.111.762,27	2,03%	BB	0,04%	1,91%	0,98%	5,94%	6,50%	8,89%	10,22%	27,38%	55,00%	
ITAU SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI	2.647.736,50	2,55%	ITAU	0,02%	0,00%	0,48%	1,48%	3,10%	5,75%	6,31%	17,49%	33,75%	
NOVERO FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	877.208,55	0,84%	NOVERO	1,44%	5,00%	-15,67%	-15,82%	-17,39%	-48,80%	-48,62%	-45,17%	-36,15%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	1.285.109,51	1,24%	NOVERO	5,36%	0,00%	-0,08%	-0,24%	-0,43%	-32,90%	-32,94%	-33,73%	-	
Benchmark:	CDI					0,49%	1,51%	3,17%	5,90%	6,47%	17,75%	34,28%	
Renda Variável	3.631.218,62	3,49%				2,73%	24,33%	17,72%					
Benchmark:	IBOVESPA					2,38%	16,73%	16,61%	17,15%	24,36%	44,58%	98,37%	
Renda Variável	3.631.218,62	3,49%				2,39%							
MOAT CAPITAL FIC FIA	2.449.421,30	2,35%	MOAT CAPITAL	0,27%	10,80%	2,97%	28,25%	24,02%	32,84%	45,34%	92,78%	217,40%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	1.181.797,32	1,14%	SANTANDER	0,40%	10,19%	2,23%	16,68%	14,70%	14,17%	20,58%	41,45%	86,79%	
Benchmark:	IBOVESPA					2,38%	16,73%	16,61%	17,15%	24,36%	44,58%	98,37%	
Total	104.025.027,04	100%				1,26%	0,37%	2,54%	4,24%	5,86%	6,69%	18,82%	36,59%
Benchmark:	INPC + 5% a.a.					0,14%	1,64%	4,68%	7,99%	8,69%	16,33%	31,14%	

* 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.

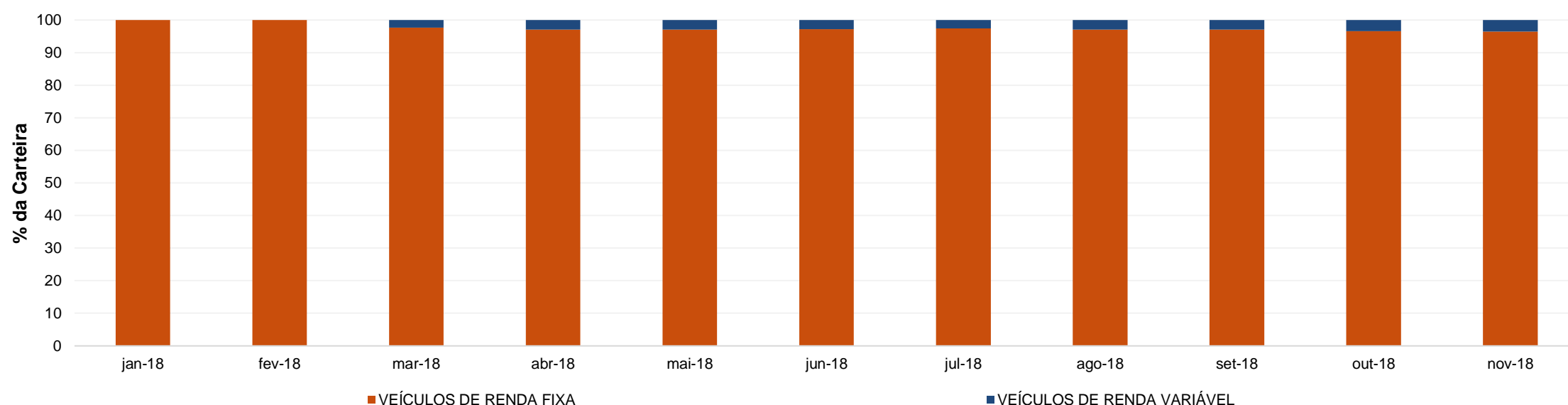
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

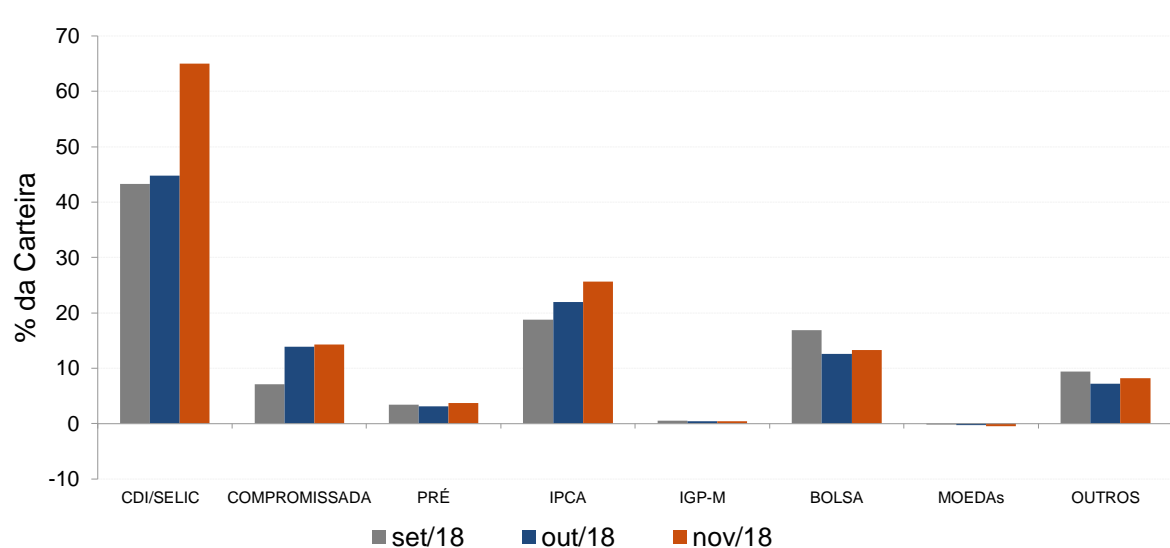
Distribuição da Carteira

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.

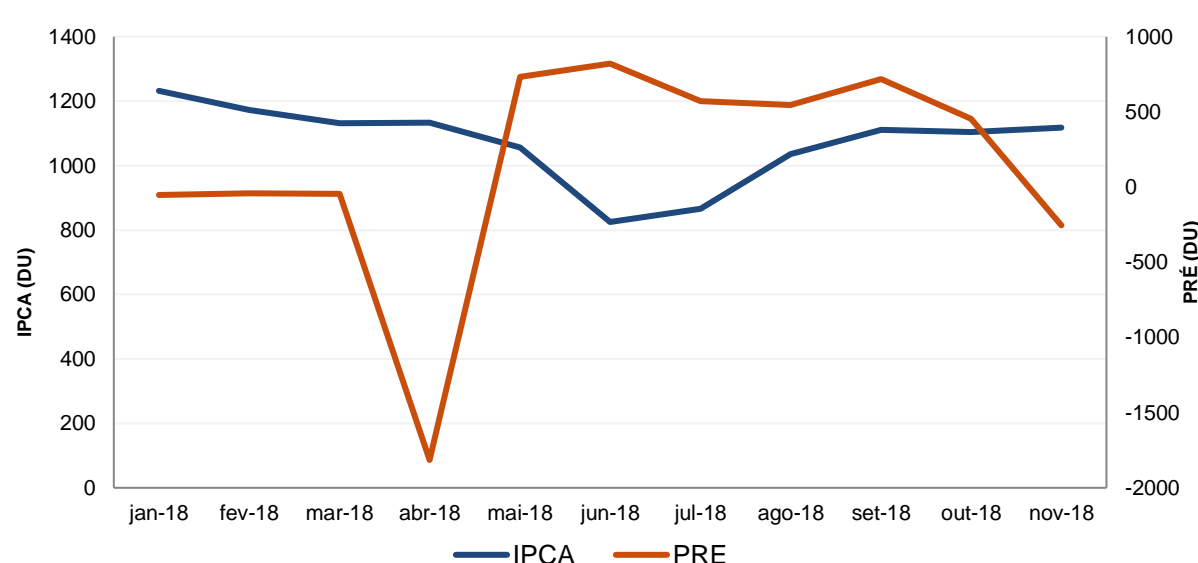
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	549,73	7,97	575,24	9,42
BBAS3	Intermediários Financeiros	418,15	6,06	288,03	4,72
ITUB4	Intermediários Financeiros	357,26	5,18	320,01	5,24
VALE3	Mineração	354,56	5,14	345,52	5,66
BBDC4	Intermediários Financeiros	313,94	4,55	440,08	7,20
PCAR4	Comércio e Distribuição	252,85	3,66	281,75	4,61
VVAR3	Comércio	225,28	3,26	0,00	
USIM5	Siderurgia e Metalurgia	219,71	3,18	181,30	2,97
BOVA11	Fundos	191,03	2,77	336,41	5,51
FIBR3	Madeira e Papel	187,39	2,72	143,23	2,35

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

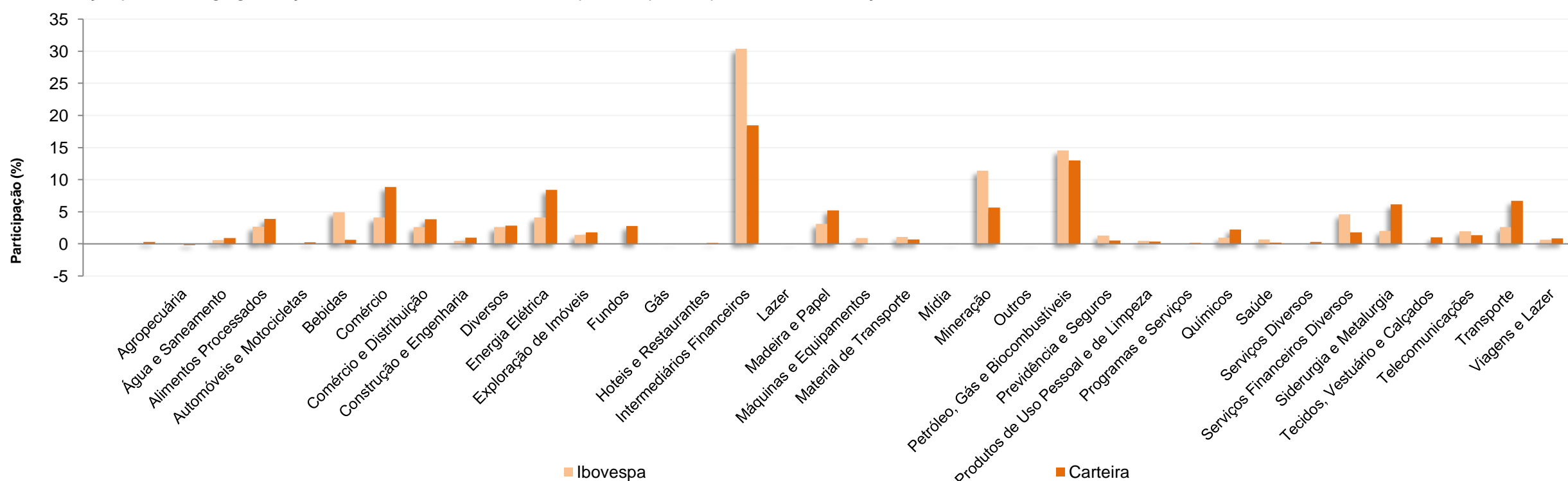
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PETR4	549,73	7,97	0,00	1
BBAS3	418,15	6,06	0,00	1
ITUB4	357,26	5,18	0,00	1
VALE3	354,56	5,14	0,00	1
BBDC4	313,94	4,55	0,00	1
PCAR4	252,85	3,66	0,00	1
VVAR3	225,28	3,26	0,01	1
USIM5	219,71	3,18	0,00	1
BOVA11	191,03	2,77	0,00	1
FIBR3	187,39	2,72	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

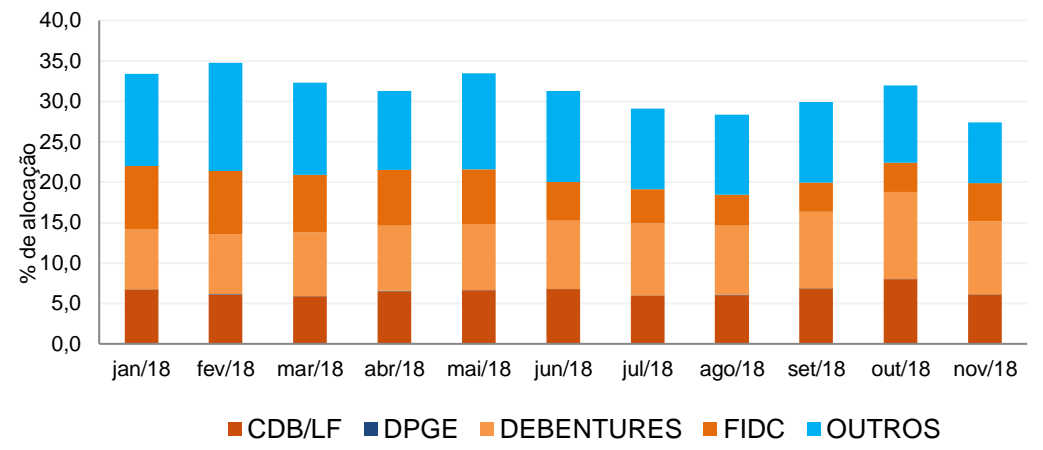
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e os respectivos ratings das principais agências classificadoras de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição 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.	5.976,53	5,66			
BCO BRADESCO SA	1.577,07	1,49	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
HABITASEC SECURITIZADORA SA	1.375,13	1,30			
BCO SAFRA SA	907,75	0,86		Aa1.br	brAAA
BANCO RCI BRASIL SA	806,41	0,76		Aaa.br	
LOCALIZA RENT A CAR SA	794,86	0,75	AAA (bra)	Aa1.br	brAAA
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL IN\	750,65	0,71	AA (bra)	Aa1.br	
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRA	695,88	0,66	AA (bra)	Aaa.br	brAAA
BCO ABC BRASIL SA (EX BCO ABC ROM	607,27	0,57	AAA (bra)	Aa2.br	brAAA
MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES SA	600,98	0,57	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
Nenhuma mudança de rating encontrada.									



OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/11/2018

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
LF CDI	10-fev-21	350.000	0,33%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	30-nov-18	105,40%	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
LFT 2020-03-01	01-mar-20	5.033.818	4,77%	Selic	30-nov-18	0,00%	0,00%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT
LTN 2019-10-01	01-out-19	19.259	0,02%	PRE	22-nov-18	6,72%	6,77%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2019-10-01	01-out-19	19.259	0,02%	PRE	26-nov-18	6,74%	6,76%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2020-04-01	01-abr-20	18.535	0,02%	PRE	26-nov-18	7,13%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2020-04-01	01-abr-20	9.268	0,01%	PRE	16-nov-18	7,26%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2020-04-01	01-abr-20	9.268	0,01%	PRE	16-nov-18	7,24%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2020-04-01	01-abr-20	9.268	0,01%	PRE	22-nov-18	7,16%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2020-04-01	01-abr-20	9.268	0,01%	PRE	22-nov-18	7,16%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2020-10-01	01-out-20	19.521	0,02%	PRE	06-nov-18	7,90%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2021-07-01	01-jul-21	16.556	0,02%	PRE	23-nov-18	8,32%	8,26%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2021-07-01	01-jul-21	16.556	0,02%	PRE	26-nov-18	8,26%	8,41%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2022-01-01	01-jan-22	15.757	0,01%	PRE	23-nov-18	8,56%	0,00%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2022-07-01	01-jul-22	7.500	0,01%	PRE	26-nov-18	8,82%	9,04%	BB PREV RF IRF M FI
LTN 2022-07-01	01-jul-22	7.500	0,01%	PRE	26-nov-18	8,82%	9,04%	BB PREV RF IRF M FI

