

## OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 26/02/2021

O Relatório de Análise de Investimentos (RAI) apresenta os principais pontos de acompanhamento da carteira de investimentos, sob os aspectos de alocação, concentração e retorno. Apresenta, também, algumas evoluções relevantes para o entendimento do comportamento da carteira ao longo do tempo. As informações apresentadas foram extraídas dos relatórios de risco de mercado 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
<b>Renda Fixa</b>	<b>106,252,762.47</b>	<b>85.40%</b>				<b>-0.16%</b>	<b>0.96%</b>	<b>1.71%</b>	<b>0.08%</b>	<b>3.12%</b>	<b>9.32%</b>	<b>17.41%</b>
Benchmark:	CDI					0.13%	0.45%	0.92%	0.28%	2.37%	8.09%	15.02%
<b>Multimercados Institucionais</b>	<b>91,520,778.72</b>	<b>73.56%</b>			<b>0.86%</b>							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	43,263,125.32	34.77%	MONGERAL AEGON	100%	0.85%	-0.10%	1.13%	2.04%	0.03%	3.32%	9.34%	17.75%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	48,257,653.40	38.79%	VINCI	100%	0.95%	-0.29%	1.01%	1.82%	0.08%	4.90%	12.77%	20.89%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0.28%	0.92%	1.89%	0.58%	4.39%	12.42%	22.02%
<b>Renda Fixa</b>	<b>14,731,983.75</b>	<b>11.84%</b>			<b>0.05%</b>							
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	14,226,245.20	11.43%	ITAU	0.07%	0.06%	0.09%	0.48%	0.72%	0.26%	2.09%	7.62%	14.35%
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	366,976.01	0.29%	NOVERO	1.44%		-0.10%	-0.33%	-0.66%	-0.21%	4.05%	-1.11%	-47.43%
DELTA CRED PRIV FC FIRF	138,762.54	0.11%	NOVERO	5.36%	0.00%	-0.24%	-11.23%	-13.82%	-0.51%	-84.33%	-89.16%	-89.29%
Benchmark:	CDI					0.13%	0.45%	0.92%	0.28%	2.37%	8.09%	15.02%
<b>Renda Variável</b>	<b>17,767,022.75</b>	<b>14.28%</b>				<b>-3.65%</b>	<b>-0.24%</b>	<b>6.09%</b>	<b>-6.86%</b>	<b>-1.17%</b>	<b>21.32%</b>	<b>40.68%</b>
Benchmark:	IBOVESPA					-4.37%	1.05%	10.73%	-7.55%	5.63%	15.12%	28.92%
<b>Renda Variável</b>	<b>17,767,022.75</b>	<b>14.28%</b>			<b>3.21%</b>							
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	5,346,488.27	4.30%	BC GESTAO	0.95%	11.65%	-1.83%	6.27%	13.83%	-1.44%	4.16%	35.66%	63.04%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	4,891,155.53	3.93%	CONSTANCIA	0.44%	9.60%	-2.57%	-0.53%	5.98%	-6.41%	-8.76%	20.18%	49.29%
MOAT CAPITAL FIC FIA	5,042,255.57	4.05%	MOAT CAPITAL	0.21%	13.26%	-5.96%	-5.65%	-0.77%	-11.85%	5.14%	25.86%	59.30%
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2,487,123.38	2.00%	SANTANDER	0.41%	13.86%	-4.75%	-1.21%	5.43%	-8.05%	-3.78%	6.65%	17.35%
Benchmark:	IBOVESPA					-4.37%	1.05%	10.73%	-7.55%	5.63%	15.12%	28.92%
<b>Imobiliário</b>	<b>398,847.33</b>	<b>0.32%</b>				<b>-0.09%</b>	<b>-0.30%</b>	<b>-0.58%</b>	<b>-0.21%</b>			
Benchmark:	INPC					0.82%	2.57%	5.37%	1.09%	6.22%	10.38%	14.73%
<b>FII</b>	<b>398,847.33</b>	<b>0.32%</b>										
SAO FRANCISCO 34 FII-UNICA	398,847.33	0.32%	TREK INVESTIMENTOS LTD	0.96%		-0.09%	-0.30%	-0.58%	-0.21%	-	-	-
Benchmark:	IFIX					0.25%	2.78%	3.75%	0.57%	-2.61%	18.56%	24.88%
<b>Total</b>	<b>124,418,632.55</b>	<b>100%</b>			<b>2.27%</b>	<b>-0.67%</b>	<b>0.76%</b>	<b>2.26%</b>	<b>-0.97%</b>	<b>2.54%</b>	<b>10.28%</b>	<b>19.07%</b>
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					1.11%	3.55%	7.44%	1.71%	10.51%	19.52%	29.31%

\* 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.

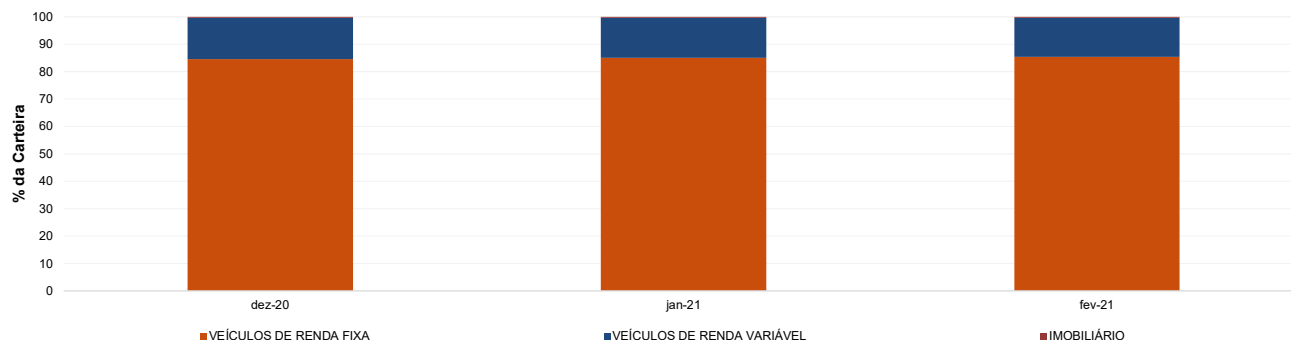
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

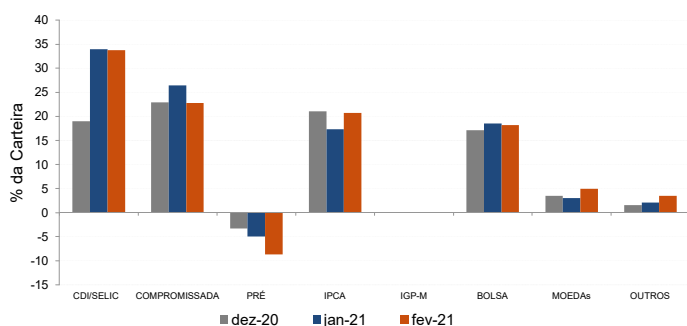
## Distribuição da Carteira

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.

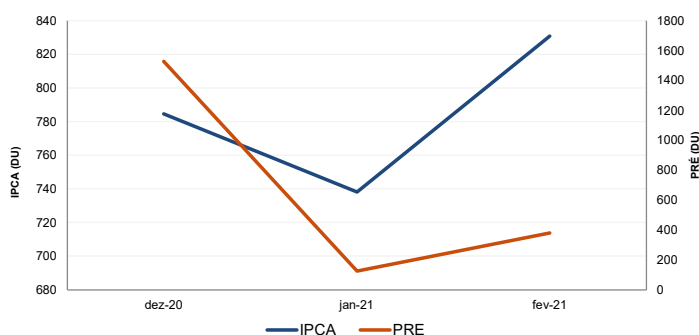
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	1,229.88	5.49	1,086.22	4.79
SUZB3	Madeira e Papel	889.49	3.97	764.54	3.37
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	775.57	3.46	747.63	3.30
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	725.71	3.24	927.28	4.09
JBSS3	Alimentos Processados	627.87	2.80	526.48	2.32
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	562.55	2.51	597.92	2.64
BRFS3	Alimentos Processados	533.47	2.38	452.53	2.00
MGLU3	Comércio	487.52	2.18	432.89	1.91
LCAM3	Diversos	451.63	2.02	414.82	1.83
OIBR3	Telecomunicações	448.40	2.00	498.25	2.20

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

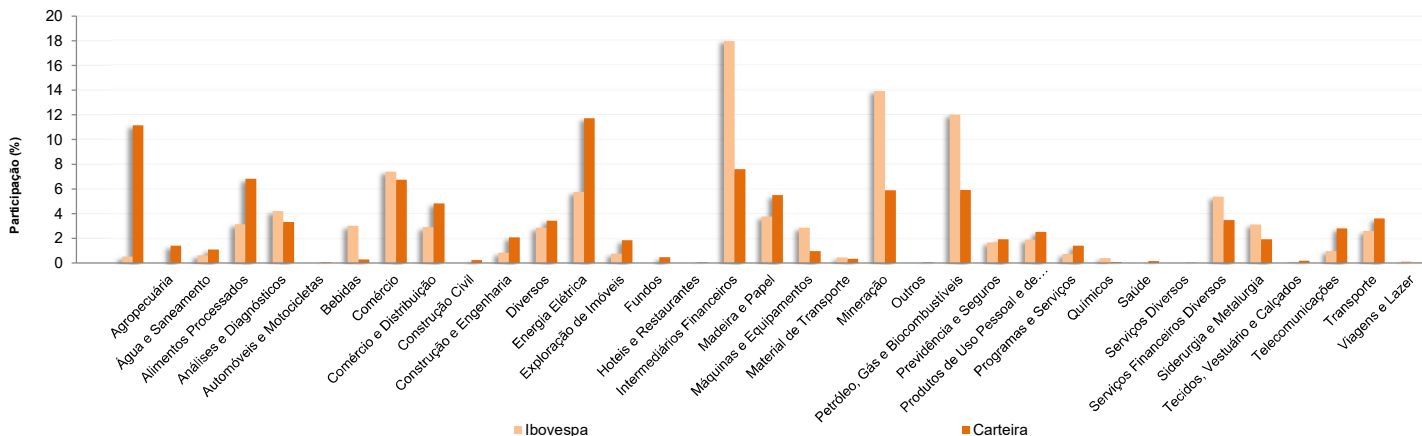
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BPAC13	8.63	0.04	0.00	Sem Liquidez
VIVT4	0.95	0.00	0.00	Sem Liquidez
VALE3	1,229.88	5.49	0.00	1
SUZB3	889.49	3.97	0.00	1
B3SA3	775.57	3.46	0.00	1
PETR4	725.71	3.24	0.00	1
JBSS3	627.87	2.80	0.00	1
NTCO3	562.55	2.51	0.00	1
BRFS3	533.47	2.38	0.00	1
MGLU3	487.52	2.18	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

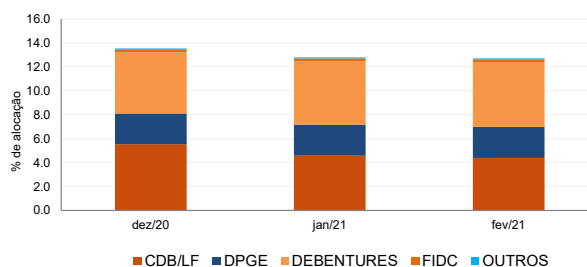
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do último ano.

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BANCO C6 S.A.	2.128.88	1.70	Sem Faixa
BANCO RCI BRASIL SA	1.829.79	1.46	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	1.453.53	1.16	Faixa 2
VALE SA	1.230.53	0.98	Faixa 1
BCO SAFRA SA	1.210.39	0.97	Faixa 2
BANCO AGIBANK S.A.	1.135.71	0.91	Faixa 4
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	1.112.33	0.89	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1.091.24	0.87	Faixa 2
NATURA COSMETICOS SA	919.37	0.73	Faixa 2
SUZANO S.A.	889.49	0.71	Faixa 1

\* em mil R\$

### Alocação Por Tipo de Crédito



## Mudanças de Faixa de Risco de Crédito no Mês

A tabela seguinte apresenta os títulos de crédito privado que tiveram sua classificação alterada ao longo do último mês. As alterações são checadas primeiro verificando a faixa correspondente da emissão e, em seguida, do emissor.

Títulos Privados	Valor (mil R\$)	Contraparte	Faixa Anterior	Faixa Atual	Venc.	Index.	Taxa	Veículo
BRPRA6	25.39	BR PROPERTIES SA	Sem Faixa	Faixa 1	25-jan-26	CDI	2.30%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CMGD17	53.38	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-jun-24	CDI	0.82%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CMGD17	26.01	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-jun-24	CDI	1.83%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CMGD17	12.35	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-jun-24	CDI	1.69%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CMGD17	2.40	CEMIG DISTRIBUICAO SA	Faixa 3	Faixa 2	15-jun-24	CDI	1.69%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
MTRJ19	42.58	CONCESSAO METROVIARIA RIO JANEIRO SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-dez-31	IPCA	7.09%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
SULM18	22.08	SUL AMERICA SA	Sem Faixa	Faixa 3	01-fev-24	CDI	1.50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 26/02/2021

## 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 com alocação direta.

É apresentada a faixa de risco de crédito da emissão e, em caso de inexistência, apresenta-se a faixa do emissor.

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1,600,562	1.28%	IPCA	04-fev-21	2.01%	2.12%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1,947,982	1.56%	IPCA	08-fev-21	2.49%	2.57%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	170,120	0.14%	IPCA	24-fev-21	4.23%	4.23%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML

