

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/06/2021

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	
Renda Fixa	107,713,219.29	84.04%				0.32%	1.44%	1.85%	1.85%	4.73%	8.84%	17.20%	
Benchmark:	CDI					0.30%	0.78%	1.27%	1.27%	2.27%	6.99%	13.75%	
Multimercados Institucionais	93,264,653.20	72.77%				0.55%							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	44,098,471.73	34.41%	MONGERAL AEGON	100%	0.56%	0.62%	2.08%	1.96%	1.96%	5.59%	8.72%	17.34%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	49,166,181.47	38.36%	VINCI	100%	0.65%	0.04%	1.09%	1.96%	1.96%	5.03%	11.61%	20.78%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0.47%	1.27%	2.25%	2.25%	4.31%	11.32%	20.69%	
Renda Fixa	14,448,566.09	11.27%				0.06%							
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	13,934,301.91	10.87%	ITAU	0.06%	0.07%	0.31%	0.74%	1.16%	1.16%	1.97%	6.50%	13.07%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	376,583.50	0.29%	NOVERO	1.44%		2.97%	2.86%	2.52%	2.52%	1.66%	2.13%	-26.48%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	137,680.68	0.11%	NOVERO	5.36%	0.00%	-0.16%	-0.48%	-1.29%	-1.29%	-14.97%	-84.74%	-89.33%	
Benchmark:	CDI					0.30%	0.78%	1.27%	1.27%	2.27%	6.99%	13.75%	
Renda Variável	20,115,952.33	15.70%				1.10%	7.78%	5.46%	5.46%	27.12%	28.79%	82.91%	
Benchmark:	IBOVESPA					0.46%	8.72%	6.54%	6.54%	33.40%	25.59%	74.27%	
Renda Variável	20,115,952.33	15.70%				1.97%							
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	5,669,098.25	4.42%	BC GESTAO	0.92%	5.78%	2.38%	5.90%	4.51%	4.51%	30.35%	32.10%	96.34%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	5,840,393.60	4.56%	CONSTANCIA	0.46%	6.65%	-0.26%	9.57%	11.75%	11.75%	28.69%	33.70%	100.34%	
MOAT CAPITAL FIC FIA	5,763,727.16	4.50%	MOAT CAPITAL	0.21%	9.06%	1.52%	7.60%	0.77%	0.77%	22.99%	34.39%	100.95%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2,842,733.32	2.22%	SANTANDER	0.45%	6.00%	0.58%	8.36%	5.10%	5.10%	27.13%	15.08%	57.78%	
Benchmark:	IBOVESPA					0.46%	8.72%	6.54%	6.54%	33.40%	25.59%	74.27%	
Imobiliário	334,340.35	0.26%				-0.12%	-0.33%	-0.62%	-0.62%	-1.16%			
Benchmark:	INPC					0.60%	1.95%	3.95%	3.95%	9.22%	11.78%	15.49%	
FI	334,340.35	0.26%											
SAO FRANCISCO 34 FI-SUBORDINA	334,340.35	0.26%	CULTINVEST	0.96%		-0.12%	-0.33%	-16.35%	-16.35%	-16.85%	-	-	
Benchmark:	IFIX					-2.19%	-3.23%	-4.02%	-4.02%	-1.83%	4.90%	29.63%	
Total	128,163,511.97	100%				1.33%	0.44%	2.38%	2.40%	2.40%	7.59%	11.34%	21.11%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					0.94%	2.96%	6.01%	6.01%	13.67%	21.12%	30.19%	

* 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.

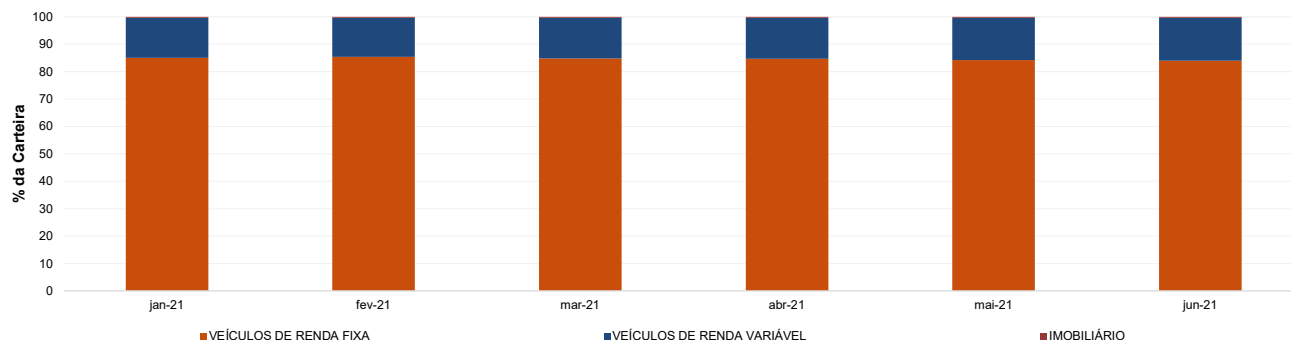
Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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

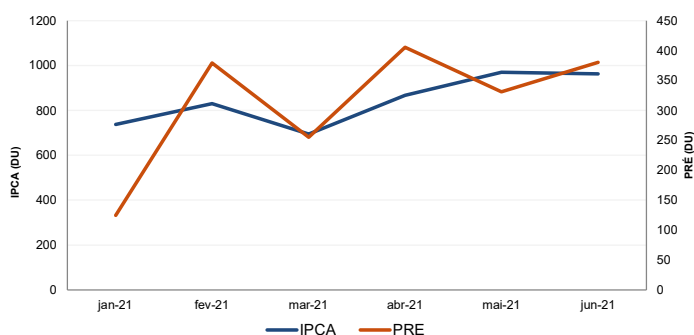
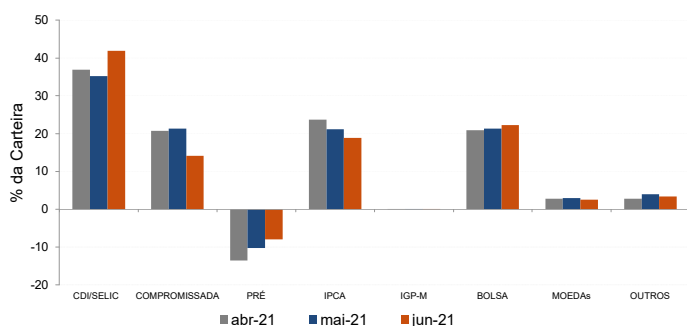
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais 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*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	886.94	3.58	677.19	2.76
VALE3	Mineração	809.57	3.27	900.56	3.68
BPAC11	Intermediários Financeiros	787.60	3.18	640.02	2.61
ITUB4	Intermediários Financeiros	764.22	3.09	666.37	2.72
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	747.52	3.02	784.55	3.20
BRFS3	Alimentos Processados	666.25	2.69	633.39	2.59
LAME4	Comércio	539.57	2.18	434.87	1.78
SUZB3	Madeira e Papel	530.84	2.14	528.50	2.16
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	507.73	2.05	583.17	2.38
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	500.71	2.02	492.18	2.01

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

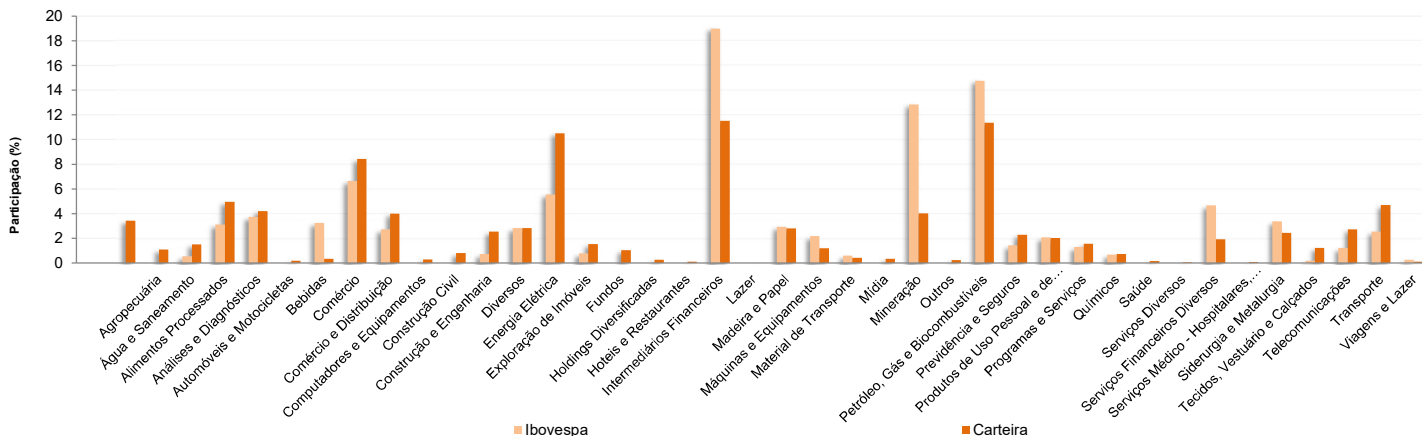
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BID12	3.64	0.01	0.00	Sem Liquidez
SML11	0.49	0.00	0.00	Sem Liquidez
MTSA4	49.77	0.20	0.03	2
PETR4	886.94	3.58	0.00	1
VALE3	809.57	3.27	0.00	1
BPAC11	787.60	3.18	0.00	1
ITUB4	764.22	3.09	0.00	1
PETR3	747.52	3.02	0.00	1
BRFS3	666.25	2.69	0.00	1
LAME4	539.57	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.



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.

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/06/2021

Análises de Contrapartes

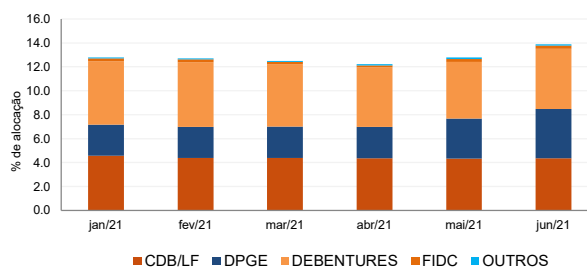
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BANCO AGIBANK S.A.	2,164.78	1.68	Faixa 4
BANCO C6 S.A.	2,156.33	1.67	Sem Faixa
BANCO RCI BRASIL SA	1,848.71	1.43	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1,755.13	1.36	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	1,382.55	1.07	Faixa 2
BCO SAFRA SA	1,209.81	0.94	Faixa 2
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	1,151.71	0.89	Faixa 2
BANCO MODAL SA	1,004.89	0.78	Faixa 4
IOCHPE MAXION SA	830.49	0.64	Faixa 2
NATURA COSMETICOS SA	815.88	0.63	Faixa 2

* 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
CPGT14	8.62	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	Faixa 2	Faixa 1	23-jul-23	CDI	126.00%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CPGT14	0.00	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA	Faixa 2	Faixa 1	23-jul-23	CDI	126.00%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CPLD14	0.67	COPEL DISTRIBUICAO SA	Faixa 2	Faixa 1	27-set-23	CDI	1.83%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
CPLD14	1.89	COPEL DISTRIBUICAO SA	Faixa 2	Faixa 1	27-set-23	CDI	1.88%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
OVSA10	30.73	OURO VERDE LOCACAO SERVICO S.A	Sem Faixa	Faixa 3	20-jun-26	CDI	2.40%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/06/2021

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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
DPGE CDI	23-jun-23	1,000,581	0.78%	CDI	BANCO MODAL SA	25-jun-21	120.00%	Faixa 4	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
PETR36	15-jan-26	107,902	0.08%	CDI	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	16-jun-21	106.25%	Faixa 2	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2021-09-01	01-set-21	5,447,041	4.23%	Selic		24-jun-21	0.12%	0.12%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
LFT 2022-03-01	01-mar-22	2,177,595	1.69%	Selic		22-jun-21	0.11%	0.11%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	951,885	0.74%	IPCA		17-jun-21	1.73%	2.02%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	464,520	0.36%	IPCA		11-jun-21	1.45%	1.61%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P

