

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/05/2021

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	107,666,134.87	84.18%				0.83%	1.44%	2.41%	1.52%	5.16%	8.93%	17.54%
Benchmark:	CDI					0.27%	0.67%	1.13%	0.96%	2.18%	7.17%	14.00%
Multimercados Institucionais	92,972,523.90	72.69%				0.71%						
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	43,826,703.15	34.27%	MONGERAL AEGON	100%	0.74%	1.07%	1.30%	2.44%	1.33%	5.70%	8.71%	17.40%
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	49,145,820.75	38.43%	VINCI	100%	0.86%	0.79%	1.84%	2.87%	1.92%	5.97%	12.89%	21.41%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0.43%	1.18%	2.12%	1.77%	4.21%	11.48%	20.94%
Renda Fixa	14,693,610.97	11.49%				0.07%						
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	14,190,007.97	11.09%	ITAU	0.07%	0.08%	0.29%	0.59%	1.08%	0.85%	1.86%	6.65%	13.29%
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	365,704.10	0.29%	NOVERO	1.44%		-0.11%	-0.22%	-0.56%	-0.78%	-0.75%	-1.07%	-28.12%
DELTA CRED PRIV FC FIRF	137,898.90	0.11%	NOVERO	5.36%	0.00%	-0.16%	-0.62%	-11.78%	-1.13%	-15.06%	-89.18%	-89.32%
Benchmark:	CDI					0.27%	0.67%	1.13%	0.96%	2.18%	7.17%	14.00%
Renda Variável	19,896,814.12	15.56%				4.49%	11.99%	11.72%	4.31%	38.56%	33.57%	71.67%
Benchmark:	IBOVESPA					6.16%	14.70%	15.91%	6.05%	44.41%	30.08%	64.44%
Renda Variável	19,896,814.12	15.56%				1.48%						
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	5,537,529.53	4.33%	BC GESTAO	0.93%	6.13%	1.24%	3.57%	10.07%	2.09%	42.79%	34.79%	84.76%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	5,855,744.72	4.58%	CONSTANCIA	0.47%	7.96%	4.36%	19.72%	19.08%	12.04%	38.06%	40.95%	91.54%
MOAT CAPITAL FIC FIA	5,677,192.62	4.44%	MOAT CAPITAL	0.21%	9.39%	7.24%	12.59%	6.23%	-0.74%	36.55%	39.54%	87.55%
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2,826,347.25	2.21%	SANTANDER	0.46%	7.56%	5.94%	13.64%	12.26%	4.50%	36.14%	18.79%	48.81%
Benchmark:	IBOVESPA					6.16%	14.70%	15.91%	6.05%	44.41%	30.08%	64.44%
Imobiliário	334,752.15	0.26%				-0.10%	-0.29%	-0.59%	-0.50%			
Benchmark:	INPC					0.96%	2.22%	4.84%	3.33%	8.90%	11.13%	16.44%
FII	334,752.15	0.26%										
SAO FRANCISCO 34 FII-SUBORDINA	334,752.15	0.26%	TREK INVESTIMENTOS LTD/	0.96%		-0.10%	-16.07%	-16.32%	-16.25%	-16.87%	-	-
Benchmark:	IFIX					-1.56%	-2.43%	0.28%	-1.87%	5.97%	10.33%	27.21%
Total	127,897,701.14	100%				1.59%	1.38%	2.94%	3.73%	1.95%	9.04%	11.52%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					1.30%	3.26%	6.93%	5.02%	13.33%	20.37%	31.26%

* 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.

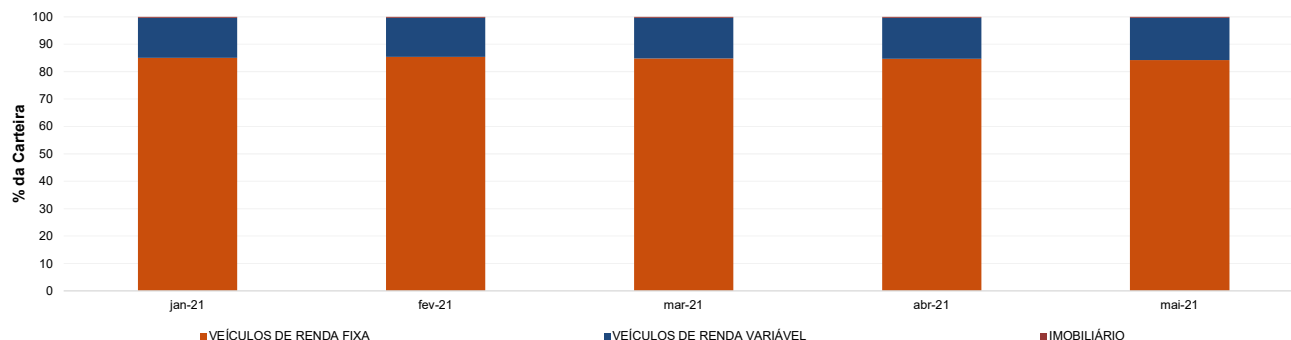
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

Distribuição da Carteira

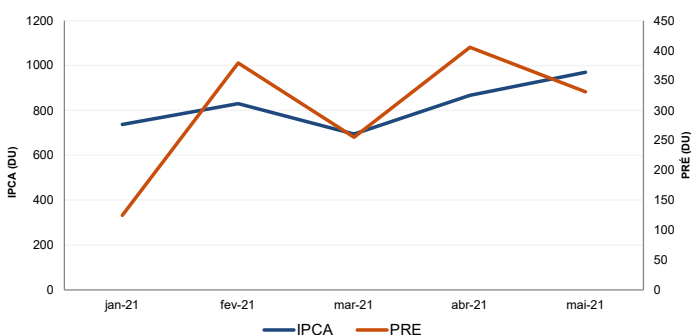
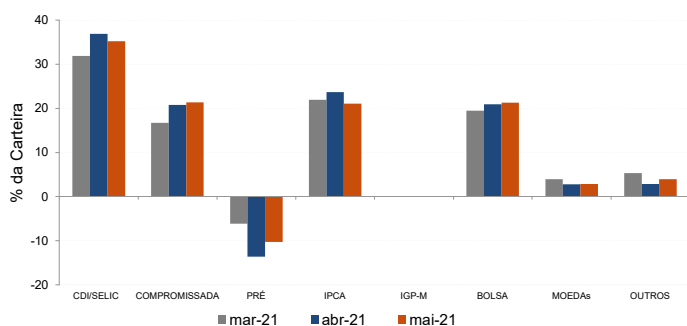
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais 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	900.56	3.68	964.57	4.14
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	784.55	3.20	592.14	2.54
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	677.19	2.76	556.16	2.39
ITUB4	Intermediários Financeiros	666.37	2.72	453.55	1.95
BPAC11	Intermediários Financeiros	640.02	2.61	493.51	2.12
BRFS3	Alimentos Processados	633.39	2.59	492.75	2.12
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	583.17	2.38	498.64	2.14
ALUP11	Energia Elétrica	551.53	2.25	478.61	2.06
SUZB3	Madeira e Papel	528.50	2.16	622.52	2.67
HYPE3	Comércio e Distribuição	493.76	2.02	450.09	1.93

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

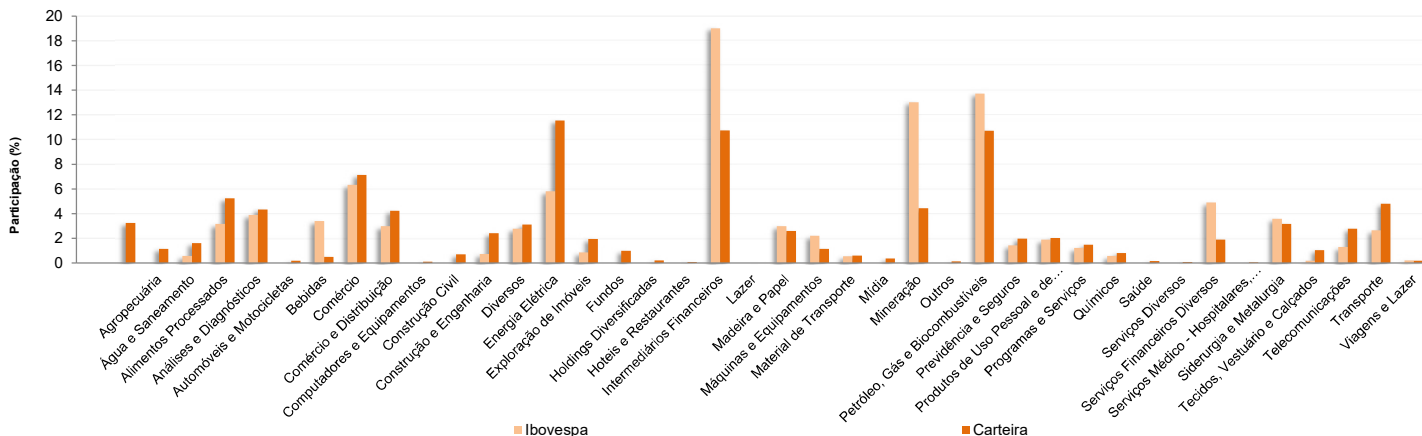
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
SMLE11	74.24	0.30	0.00	Sem Liquidez
VIVT4	1.66	0.01	0.00	Sem Liquidez
CNTO3	0.35	0.00	0.00	Sem Liquidez
CRIV4	7.32	0.03	0.01	3
GEP44	16.45	0.07	0.01	2
VALE3	900.56	3.68	0.00	1
PETR3	784.55	3.20	0.00	1
PETR4	677.19	2.76	0.00	1
ITUB4	666.37	2.72	0.00	1
BPAC11	640.02	2.61	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

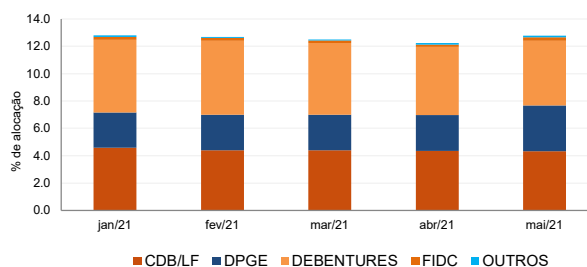
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BANCO C6 S.A.	2,158.87	1.68	Sem Faixa
BANCO AGIBANK S.A.	2,155.97	1.68	Faixa 4
BANCO RCI BRASIL SA	1,842.80	1.43	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1,476.31	1.15	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	1,439.90	1.12	Faixa 2
BCO SAFRA SA	1,237.30	0.96	Faixa 2
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	1,143.52	0.89	Faixa 2
VALE SA	903.42	0.70	Faixa 1
IOCHPE MAXION SA	822.36	0.64	Faixa 2
NATURA COSMETICOS SA	809.02	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
CART12	1.22	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	Faixa 6	Faixa 5	15-dez-24	IPCA	4.37%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CART22	8.54	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	Faixa 6	Faixa 5	15-dez-24	IPCA	4.54%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CART22	4.34	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	Faixa 6	Faixa 5	15-dez-24	IPCA	4.41%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CART22	8.88	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	Faixa 6	Faixa 5	15-dez-24	IPCA	6.36%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CART22	6.19	CONCESSIONARIA AUTO RAPOSO TAVARES SA	Faixa 6	Faixa 5	15-dez-24	IPCA	5.11%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
CEAB11	50.67	C&A MODAS S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	20-mai-25	CDI	2.15%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 31/05/2021

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	12-mai-23	1,002,245	0.78%	CDI	BANCO AGIBANK S.A.	12-mai-21	130.00%	Faixa 4	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2022-08-15	15-ago-22	721,367	0.56%	IPCA		28-mai-21	1.37%	1.28%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	929,726	0.72%	IPCA		19-mai-21	3.43%	3.51%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	1,013,277	0.79%	IPCA		31-mai-21	3.94%	3.99%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	657,596	0.51%	IPCA		27-mai-21	4.03%	4.00%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	657,596	0.51%	IPCA		27-mai-21	4.05%	4.00%	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P

