

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/09/2021

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	111,695,477.70	86.35%				0.41%	0.72%	2.17%	2.58%	4.52%	7.84%	15.88%	
Benchmark:	CDI					0.44%	1.22%	2.01%	2.51%	2.99%	6.65%	13.35%	
Multimercados Institucionais	94,059,413.70	72.71%				0.42%							
MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT	44,717,446.47	34.57%	MONGERAL AEGON	100%	0.30%	0.63%	1.40%	3.52%	3.39%	5.88%	8.50%	16.97%	
VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED PRIV	49,341,967.23	38.14%	VINCI	100%	0.58%	0.38%	0.36%	1.45%	2.33%	4.31%	9.99%	19.47%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					0.60%	1.74%	3.04%	4.03%	5.04%	10.95%	20.27%	
Renda Fixa	17,636,064.00	13.63%				1.16%							
ITAU SOBERANO RF SIMPLES FC	10,924,885.46	8.45%	ITAU	0.05%	0.02%	0.45%	1.25%	2.00%	2.43%	2.89%	6.23%	12.74%	
ITAU RF IMA-B ATIVO FC	6,275,276.88	4.85%	ITAU	0.86%	3.26%	0.26%	-0.98%	1.61%	-1.84%	5.15%	8.50%	44.27%	
TREK FI RF CRED PRIV IMOBILIARIO	375,254.07	0.29%	NOVERO	1.44%		-0.12%	-0.35%	2.38%	2.04%	1.69%	3.66%	-24.84%	
DELTA CRED PRIV FC FIRF	60,647.59	0.05%	NOVERO	5.36%	0.00%	-55.82%	-55.95%	-56.16%	-56.52%	-62.24%	-93.26%	-95.29%	
Benchmark:	CDI					0.44%	1.22%	2.01%	2.51%	2.99%	6.65%	13.35%	
Renda Variável	17,569,358.08	13.58%				-5.28%	-12.66%	-5.86%	-7.89%	10.93%	5.36%	57.95%	
Benchmark:	IBOVESPA					-6.57%	-12.48%	-4.85%	-6.75%	17.31%	5.95%	39.87%	
Renda Variável	17,569,358.08	13.58%				1.85%							
BRASIL CAPITAL 30 INSTITUCIONAL FC FIA	5,067,824.95	3.92%	BC GESTAO	0.95%	5.82%	-6.49%	-10.61%	-5.33%	-6.57%	13.20%	6.99%	73.27%	
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	5,163,253.63	3.99%	CONSTANCIA	0.47%	5.29%	-4.73%	-11.59%	-3.13%	-1.21%	17.15%	9.79%	72.16%	
MOAT CAPITAL FIC FIA	4,850,677.25	3.75%	MOAT CAPITAL	0.23%	7.02%	-4.00%	-15.84%	-9.44%	-15.19%	3.40%	3.81%	65.41%	
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT ACOES	2,487,602.24	1.92%	SANTANDER	0.48%	6.04%	-6.41%	-12.49%	-5.18%	-8.03%	10.14%	-2.98%	28.56%	
Benchmark:	IBOVESPA					-6.57%	-12.48%	-4.85%	-6.75%	17.31%	5.95%	39.87%	
Imobiliário	89,224.35	0.07%				-73.13%	-73.31%	-73.40%	-73.48%	-73.55%			
Benchmark:	INPC					1.20%	3.13%	5.14%	7.21%	10.78%	15.09%	18.45%	
FII	89,224.35	0.07%											
SAO FRANCISCO 34 FII-SUBORDINA	89,224.35	0.07%	CULTINVEST	0.96%		-73.13%	-73.31%	-73.40%	-77.68%	-77.77%	-77.89%	-	
Benchmark:	IFIX					-1.24%	-1.42%	-4.61%	-5.38%	-2.83%	1.17%	27.21%	
Total	129,354,060.14	100%				1.13%	-0.60%	-1.55%	0.79%	0.80%	5.09%	7.27%	16.89%
Benchmark:	INPC + 4.09% a.a.					1.54%	4.20%	7.29%	10.46%	15.30%	24.68%	33.55%	

* 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.

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

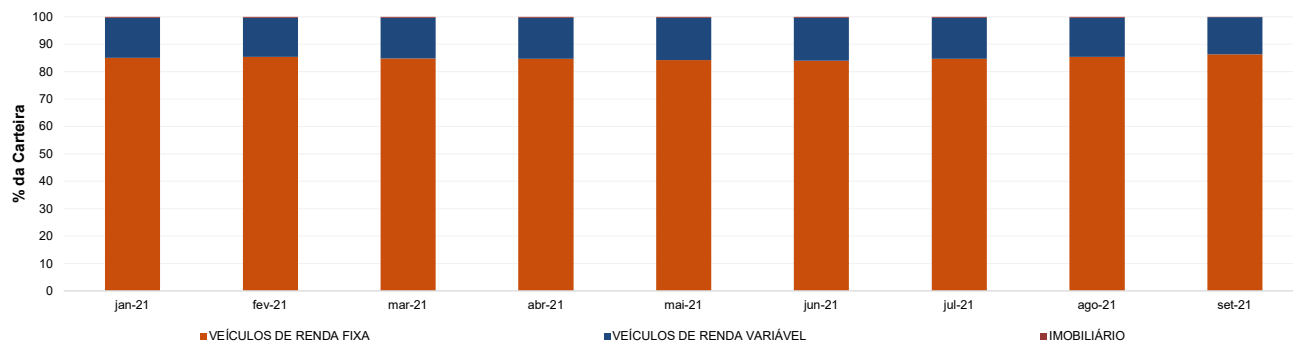
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

Distribuição da Carteira

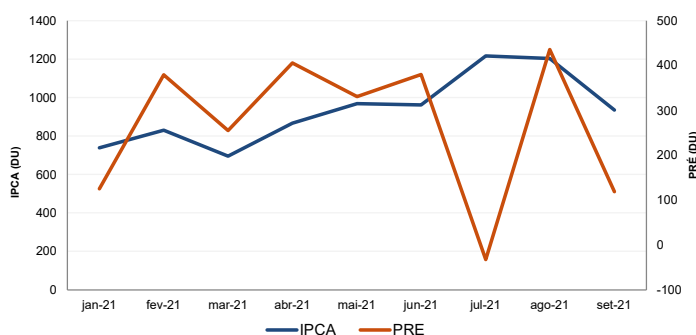
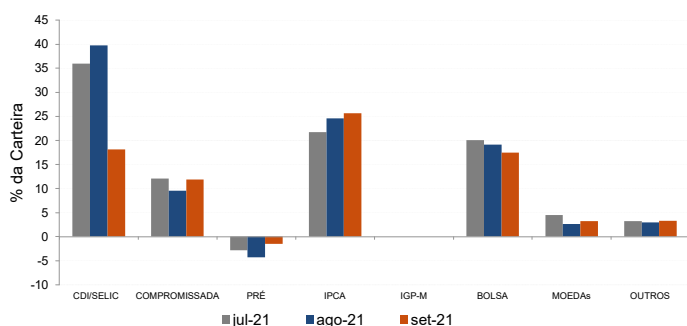
O gráfico abaixo apresenta a evolução da carteira de acordo com os segmentos previstos na legislação vigente. A seguir, a exposição por fatores de risco mostra a carteira aberta e os principais fatores de risco que contribuem para a sua exposição ao mercado. A evolução da duration apresenta os principais 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	890.26	4.01	619.77	2.63
VALE3	Mineração	745.51	3.36	946.59	4.02
BRFS3	Alimentos Processados	744.96	3.36	618.14	2.63
ITSA4	Intermediários Financeiros	636.27	2.87	287.75	1.22
ITUB4	Intermediários Financeiros	582.82	2.63	1,048.00	4.45
PETR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	572.84	2.58	880.58	3.74
SUZB3	Madeira e Papel	554.06	2.50	579.10	2.46
CSAN3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	497.34	2.24	560.82	2.38
HYPE3	Comércio e Distribuição	465.19	2.10	534.39	2.27
BBAS3	Intermediários Financeiros	428.26	1.93	466.82	1.98

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

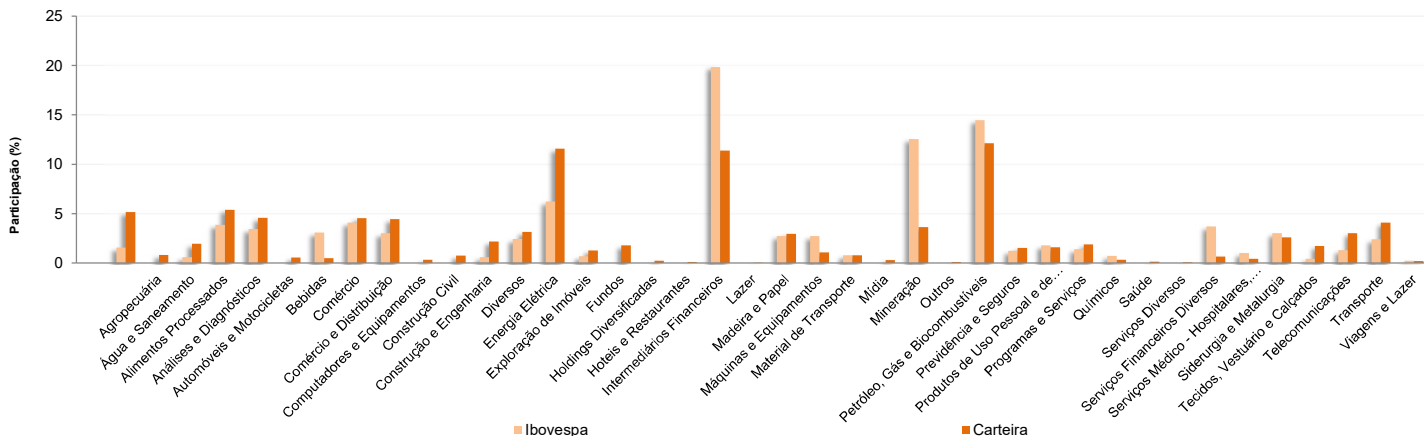
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
GEP44	18.28	0.08	0.02	8
CRIV4	7.01	0.03	0.01	4
MTSA4	36.88	0.17	0.03	2
PETR4	890.26	4.01	0.00	1
VALE3	745.51	3.36	0.00	1
BRFS3	744.96	3.36	0.00	1
ITSA4	636.27	2.87	0.00	1
ITUB4	582.82	2.63	0.00	1
PETR3	572.84	2.58	0.00	1
SUZB3	554.06	2.50	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.



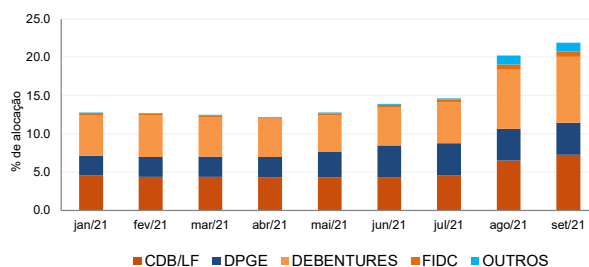
Análises de Contrapartes

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
BCO SAFRA SA	2,294.86	1.77	Faixa 1
BANCO AGIBANK S.A.	2,212.46	1.71	Faixa 4
BANCO C6 S.A.	2,191.85	1.69	Sem Faixa
BANCO RCI BRASIL SA	1,872.53	1.44	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	1,625.59	1.25	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1,621.02	1.25	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	1,573.22	1.21	Faixa 1
LOJAS AMERICANAS SA	1,444.30	1.11	Faixa 1
ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS SA	1,104.59	0.85	Faixa 1
COGNA EDUCAÇÃO S.A.	1,065.26	0.82	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	Veiculo
JSMLA5	4.00	SIMPAR S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-jan-31	CDI	3.50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
JSMLA5	1.08	SIMPAR S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-jan-31	CDI	3.50%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
JSMLA5	12.44	SIMPAR S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-jan-31	CDI	3.50%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
JSMLA5	39.93	SIMPAR S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-jan-31	CDI	3.50%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
JSMLB5	0.76	SIMPAR S.A.	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-31	IPCA	7.97%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
MOVI17	0.85	MOVIDA PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-26	CDI	2.70%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
MOVI27	0.63	MOVIDA PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-29	CDI	2.90%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
MOVI27	18.62	MOVIDA PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-29	CDI	2.90%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
MOVI37	0.75	MOVIDA PARTICIPACOES	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-31	IPCA	7.64%	LEGACY CAPITAL MASTER FI MULT
USIM17	0.91	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-23	CDI	1.64%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
USIM17	6.87	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-23	CDI	1.70%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
USIM17	13.06	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-23	CDI	1.79%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
USIM17	4.88	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-23	CDI	1.42%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
USIM17	4.08	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-23	CDI	1.45%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
USIM17	5.82	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-23	CDI	1.49%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
USIM17	0.20	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-23	CDI	1.43%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
USIM17	2.50	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-23	CDI	1.64%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
USIM17	9.99	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-23	CDI	1.60%	ICATU VANGUARDA CRED PRIV FI RF LP
USIM27	6.81	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2.45%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	1.97	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2.42%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	1.00	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2.42%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	0.36	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2.42%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	0.07	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2.42%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	38.99	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	2.17%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
USIM27	8.37	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	1.80%	JGP CORPORATE MASTER FI RF CRED PR
USIM27	13.26	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	1.84%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	3.36	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	1.83%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	6.86	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	1.83%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	3.36	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	1.79%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	13.11	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	1.79%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	6.96	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	3.18%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	1.88	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	3.18%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
USIM27	15.72	USINAS SIDERURGICAS MINAS GERAIS SA USIMIN	Faixa 2	Faixa 1	30-set-25	CDI	3.09%	SPX SEAHAWK MASTER FI RF CRED PRIV
VVAR27	692.89	VIA SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-set-26	CDI	1.79%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI MULT

OABPREV - GO - OABPREV GO PLANO CD

Data-base: 30/09/2021

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
ERDVA0	13-jul-23	1,042,727	0.80%	CDI	ECORODOVIAS CONCESSOES SERVICOS	24-set-21	2.10%	Faixa 2	VINCI OABPREVGO/TO FI MULT CRED P
LF CDI	11-set-23	753,164	0.58%	CDI	BANCO INDUSTRIAL BRASIL SA	09-set-21	1.75%	Faixa 3	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
VVAR27	15-set-26	692,894	0.53%	CDI	VIA SA	29-set-21	1.79%	Faixa 2	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	8,798,225	6.79%	Selic		16-set-21	0.17%	0.16%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	21,427	0.02%	IPCA		21-set-21	4.94%	4.92%	MONGERAL AEGON OABPREV GO FI ML

