

ELETROS - ELETROS PLANO BD

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	1.160.013.702,24		53,96%			-0,76%	-3,09%	1,75%	5,49%	11,49%	43,34%	56,30%	
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	851.707.471,86		39,62%										
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	851.707.471,86	39,62%		100%	2,68%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%	
RF REFERENCIADO DI	308.306.230,38		14,34%										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	189.965.600,09	8,84%	ALFA	17,91%	0,01%	0,48%	1,33%	2,17%	2,62%	3,29%	6,64%	13,33%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	29.841.267,76	1,39%	BRADESCO	18,53%	0,00%	0,43%	1,20%	1,97%	2,44%	2,90%	6,48%	13,09%	
URCA FI MULT CRED PRIV	88.499.362,54	4,12%	SANTANDER	17,67%	0,22%	0,43%	1,17%	2,06%	2,31%	3,11%	6,53%	13,98%	
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%	
Renda Variável	581.955.899,82		27,07%			-6,24%	-13,02%	-4,20%	-4,89%	16,24%	8,96%	50,62%	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					-6,84%	-13,17%	-4,36%	-4,59%	20,17%	12,05%	54,09%	
RV ATIVO	286.933.804,11		13,35%										
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	180.087.564,82	8,38%	SHARP	43,56%	6,34%	-6,51%	-12,01%	-3,82%	-5,23%	18,40%	13,68%	62,34%	
FIA SAO CONRADO	15.457.479,01	0,72%	EQUITAS	43,56%	6,51%	-8,85%	-16,42%	-2,15%	-5,93%	12,19%	-1,04%	35,12%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	68.926.032,75	3,21%	CONSTANCIA	43,56%	5,36%	-4,64%	-11,05%	-2,81%	-0,26%	17,51%	11,65%	-	
FIA PIPA	10.934.618,33	0,51%	XP	43,56%	3,99%	-4,64%	-16,34%	-4,33%	-7,66%	4,60%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	11.528.109,20	0,54%	CONSTELLATION	43,56%	6,70%	-7,26%	-11,19%	-3,69%	-7,04%	-	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA					-6,57%	-12,48%	-4,85%	-6,75%	17,31%	5,95%	39,87%	
CARTEIRA PRÓPRIA RV	118.614.682,07		5,52%										
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	118.614.682,07	5,52%		100%	6,68%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-6,99%	-13,61%	-5,31%	-5,99%	17,82%	7,71%	45,23%	
RV VALOR	84.403.747,39		3,93%										
VINCI JOATINGA FIA	70.005.303,11	3,26%	VINCI	43,56%	5,46%	-6,88%	-12,52%	-5,87%	-7,35%	12,65%	13,07%	-	
FIA ITACOATIARA	14.398.444,29	0,67%	INDIE CAPITAL	43,56%	8,19%	-5,36%	-14,64%	-5,87%	-7,79%	11,45%	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA					-6,57%	-12,48%	-4,85%	-6,75%	17,31%	5,95%	39,87%	
RV SMALL CAP	69.017.034,38		3,21%										
GRUMARI FIA	69.017.034,38	3,21%	AZ QUEST	43,56%	3,78%	-4,14%	-13,03%	-0,90%	-1,19%	15,61%	13,93%	66,23%	
Benchmark:	SMLL					-6,43%	-15,22%	-4,70%	-5,54%	15,75%	13,69%	78,82%	
RV PASSIVO	22.986.631,87		1,07%										
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	22.986.631,87	1,07%	BLACKROCK	0,15%	6,06%	-6,65%	-12,58%	-4,94%	-7,12%	16,96%	5,57%	39,12%	
Benchmark:	IBOVESPA					-6,57%	-12,48%	-4,85%	-6,75%	17,31%	5,95%	39,87%	
Estruturado	71.172.295,38		3,31%										
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					2,01%	5,70%	10,32%	15,11%	21,82%	39,21%	57,54%	
MM MACRO	44.998.943,10		2,09%										
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	16.759.238,87	0,78%	QUANTITAS	6,60%	0,37%	0,37%	1,44%	2,30%	4,44%	8,31%	13,88%	23,96%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	6.066.670,93	0,28%	OCCAM	0,33%	0,79%	-0,09%	0,77%	1,40%	2,59%	3,85%	12,91%	32,32%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	10.452.155,40	0,49%	OCCAM	0,41%	0,79%	-0,09%	0,78%	1,41%	2,62%	3,85%	-	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	5.711.393,30	0,27%	PACIFICO	1,60%	1,62%	-1,55%	-2,79%	-0,57%	-2,84%	0,65%	2,90%	14,39%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	6.009.484,60	0,28%	ZEITGEIST	0,36%	2,84%	0,19%	1,71%	4,78%	3,20%	6,75%	14,96%	30,81%	
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%	
FIP	15.527.963,49		0,72%										
SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES	15.527.963,49	0,72%	SIGNAL CAPITAL	12,37%		-0,35%	-31,15%	-29,29%	-30,74%	-39,04%	-25,34%	-12,94%	
Benchmark:	IPCA					1,16%	3,02%	4,75%	6,90%	10,25%	13,70%	16,99%	
MM LONG-SHORT	10.645.388,79		0,50%										
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	10.645.388,79	0,50%	KONDOR	2,37%	1,26%	0,51%	2,29%	6,14%	5,65%	8,51%	10,68%	-	
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%	
Exterior	58.569.754,21		2,72%										
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					1,22%	8,36%	2,09%	16,99%	22,47%	80,14%	87,02%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	58.569.754,21		2,72%										
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	58.569.754,21	2,72%	BLACKROCK	1,04%	4,45%	0,39%	9,68%	4,85%	21,41%	25,01%	92,46%	106,81%	
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					1,22%	8,36%	2,09%	16,99%	22,47%	80,14%	87,02%	
Operações com Participantes	78.230.382,61		3,64%										
Benchmark:	INPC + 5,97% a.a.					1,69%	4,69%	8,26%	11,95%	17,37%	29,21%	40,90%	
Imobiliário	199.961.918,35		9,30%										
Benchmark:	INPC					1,20%	3,13%	5,14%	7,21%	10,78%	15,09%	18,45%	
Total	2.149.903.952,61		100%			2,38%	-2,03%	-4,75%	1,04%	3,33%	14,39%	33,97%	51,02%
Benchmark:	INPC + 4,5% a.a.					1,57%	4,31%	7,50%	10,79%	15,75%	25,66%	35,13%	

* 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.

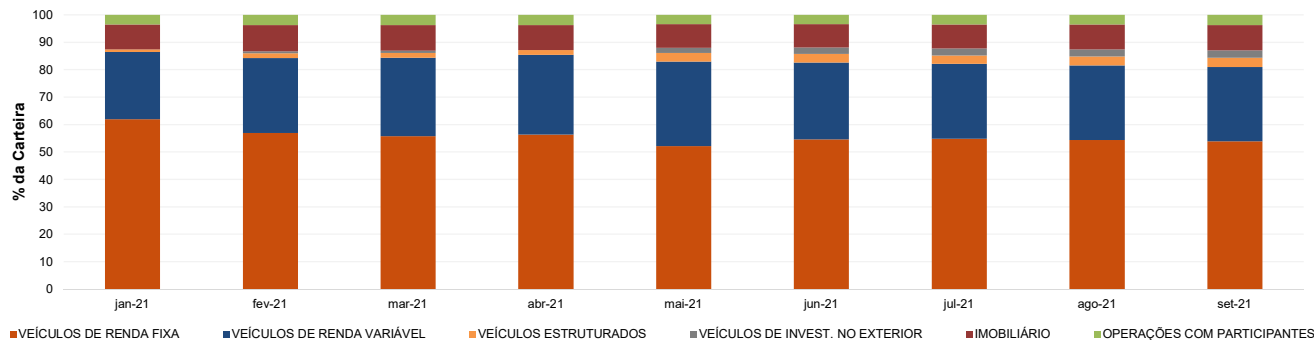
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

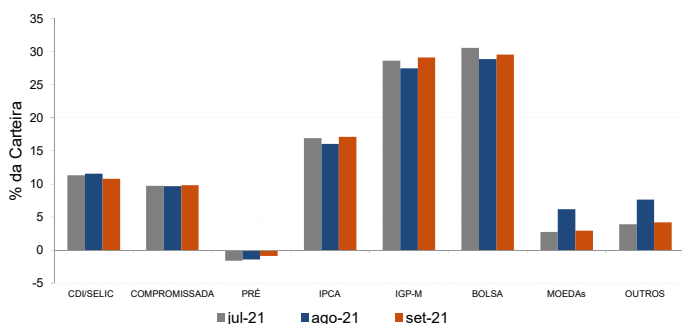
Distribuição da Carteira

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.

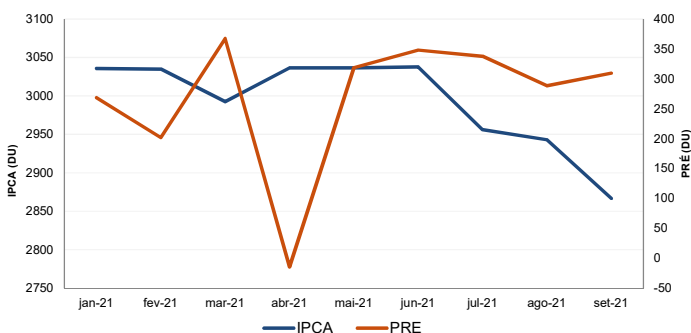
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
VALE3	Mineração	50.579,64	9,14	70.286,35	12,09
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	37.106,54	6,70	37.065,27	6,37
ITSA4	Intermediários Financeiros	23.779,95	4,30	24.810,35	4,27
ITUB4	Intermediários Financeiros	20.269,99	3,66	20.526,92	3,53
EQTL3	Energia Elétrica	18.382,51	3,32	13.257,55	2,28
GNDI3	Análises e Diagnósticos	18.236,87	3,29	18.143,92	3,12
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	15.277,83	2,76	17.088,37	2,94
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	11.728,41	2,12	12.235,30	2,10
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	11.054,56	2,00	11.962,51	2,06
ASAI3	Comércio e Distribuição	10.639,89	1,92	8.394,86	1,44

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

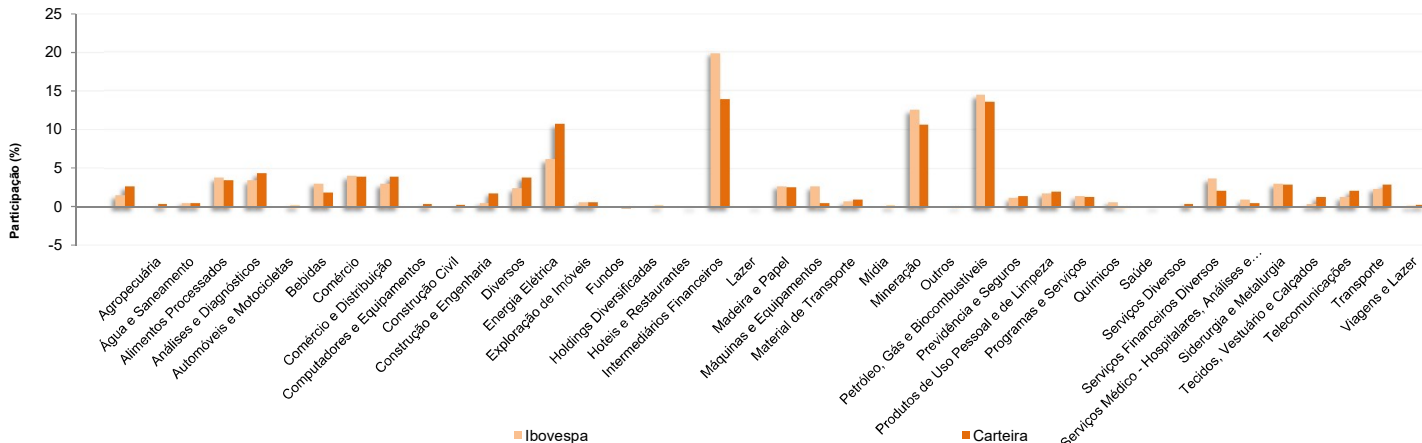
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	106,57	0,02	0,10	48
HBRE3	1.144,09	0,21	0,34	18
MTSA4	492,05	0,09	0,37	15
SCAR3	299,24	0,05	0,03	5
EMAE4	160,76	0,03	0,01	5
LAND3	805,70	0,15	0,15	4
COCE5	724,90	0,13	0,07	4
CLSC4	106,31	0,02	0,01	3
BEES3	50,28	0,01	0,08	3
JALL3	1.311,35	0,24	0,14	2

* 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

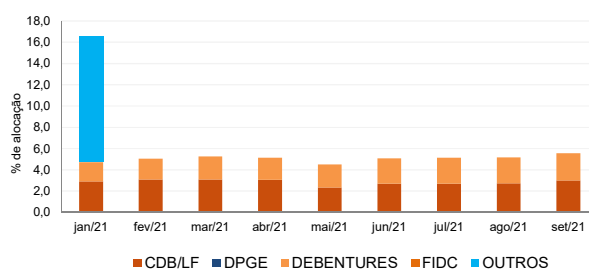
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
VALE SA	80.277,34	4,28	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	43.684,40	2,33	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	43.167,97	2,30	Faixa 2
ITAUSA SA	24.931,70	1,33	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	20.269,99	1,08	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	18.382,51	0,98	Faixa 1
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	18.236,87	0,97	Sem Faixa
VIBRA ENERGIA SA	15.277,83	0,82	Faixa 1
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	12.571,30	0,67	Sem Faixa
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBI	12.345,64	0,66	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

ELETROS - ELETROS PLANO BD

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
DASAA4	20-out-25	261.713	0,01%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	28-set-21	1,65%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LF CDI	02-out-23	1.599.766	0,09%	CDI	BCO SAFFRA SA	29-set-21	1,05%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	1.330.011	0,07%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	257.136	0,01%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	53.200	0,00%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	28-set-23	1.741.674	0,09%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	28-set-21	1,10%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
RDORB7	20-dez-26	343.263	0,02%	CDI	REDE D OR SAO LUIZ SA	03-set-21	1,42%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
SBSPC7	15-dez-27	135.140	0,01%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	20-set-21	1,76%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2022-03-01	01-mar-22	517.369	0,03%	Selic	15-set-21	4,00%	0,03%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.536.341	0,08%	Selic	09-set-21	0,08%	0,08%	GRUMARI FIA
LFT 2023-09-01	01-set-23	443.092	0,02%	Selic	20-set-21	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	196.930	0,01%	Selic	20-set-21	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	13.785	0,00%	Selic	15-set-21	0,15%	0,15%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.038.417	0,06%	Selic	15-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	205.724	0,01%	Selic	23-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	195.928	0,01%	Selic	23-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.330.126	0,07%	IPCA	14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.330.126	0,07%	IPCA	14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	704.064	0,04%	IPCA	14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	443.375	0,02%	IPCA	14-set-21	3,69%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	443.375	0,02%	IPCA	14-set-21	3,71%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	439.954	0,02%	IPCA	23-set-21	3,54%	3,54%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	439.954	0,02%	IPCA	23-set-21	3,52%	3,54%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	49.948	0,00%	IPCA	14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	49.948	0,00%	IPCA	14-set-21	3,69%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	14.369	0,00%	IPCA	14-set-21	3,71%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV