

## ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 31/08/2021

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>1.182.576.574,13</b>		<b>67,84%</b>			<b>-0,52%</b>	<b>-0,34%</b>	<b>0,37%</b>	<b>-0,57%</b>	<b>2,18%</b>	<b>9,73%</b>	<b>17,13%</b>	
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%	
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>817.763.870,14</b>		<b>46,91%</b>										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	514.882.085,78	29,54%	ALFA	46,07%	0,02%	0,45%	1,19%	1,85%	2,14%	2,78%	6,63%	13,32%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	76.377.222,75	4,38%	BRADESCO	47,64%	0,00%	0,42%	1,07%	1,72%	2,00%	2,62%	6,52%	13,13%	
URCA FI MULT CRED PRIV	226.504.561,61	12,99%	SANTANDER	45,36%	0,24%	0,41%	1,10%	1,79%	1,87%	2,58%	6,69%	14,02%	
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%	
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>364.812.703,99</b>		<b>20,93%</b>										
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	364.812.703,99	20,93%		100%	6,43%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%	
<b>Renda Variável</b>	<b>415.107.184,27</b>		<b>23,81%</b>			<b>-3,20%</b>	<b>-6,46%</b>	<b>7,31%</b>	<b>1,45%</b>	<b>18,66%</b>	<b>19,40%</b>	<b>66,03%</b>	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					-3,09%	-6,05%	9,06%	2,41%	23,29%	24,34%	71,00%	
<b>RV ATIVO</b>	<b>210.190.556,86</b>		<b>12,06%</b>										
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	132.416.968,45	7,60%	SHARP	29,95%	7,11%	-2,22%	-5,07%	7,82%	1,37%	21,96%	26,06%	79,44%	
FIA SAO CONRADO	11.657.932,71	0,67%	EQUITAS	29,95%	6,91%	-2,27%	-4,51%	7,88%	3,20%	17,34%	9,09%	51,28%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	49.687.934,93	2,85%	CONSTANCIA	29,95%	5,91%	-2,85%	-7,29%	11,62%	4,59%	17,92%	18,53%	-	
FIA PIPA	7.882.668,26	0,45%	XP	29,95%	6,89%	-7,96%	-9,74%	2,08%	-3,17%	2,75%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	8.545.052,52	0,49%	CONSTELLATION	29,95%	7,32%	-1,55%	-2,55%	2,15%	0,23%	-	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA					-2,48%	-5,89%	7,95%	-0,20%	19,54%	17,45%	54,91%	
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RV</b>	<b>89.555.244,13</b>		<b>5,14%</b>										
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RV	89.555.244,13	5,14%		100%	7,85%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-3,25%	-6,53%	7,96%	1,07%	20,88%	19,52%	61,19%	
<b>RV VALOR</b>	<b>62.139.959,29</b>		<b>3,56%</b>										
VINCI JOATINGA FIA	51.681.282,52	2,96%	VINCI	29,95%	7,18%	-2,03%	-6,68%	5,77%	-0,51%	17,55%	23,61%	-	
FIA ITACOATIARA	10.458.676,77	0,60%	INDIE CAPITAL	29,95%	10,65%	-8,00%	-9,10%	2,12%	-2,57%	11,13%	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA					-2,48%	-5,89%	7,95%	-0,20%	19,54%	17,45%	54,91%	
<b>RV SMALL CAP</b>	<b>49.493.718,25</b>		<b>2,84%</b>										
GRUMARI FIA	49.493.718,25	2,84%	AZ QUEST	29,95%	6,50%	-5,06%	-7,77%	4,18%	3,07%	13,52%	20,34%	76,65%	
Benchmark:	SMLL					-3,82%	-8,23%	6,49%	0,95%	16,98%	24,03%	87,36%	
<b>RV PASSIVO</b>	<b>3.727.705,74</b>		<b>0,21%</b>										
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	3.727.705,74	0,21%	BLACKROCK	0,03%	6,90%	-2,59%	-5,91%	8,04%	-0,50%	19,21%	17,10%	54,16%	
Benchmark:	IBOVESPA					-2,48%	-5,89%	7,95%	-0,20%	19,54%	17,45%	54,91%	
<b>Estruturado</b>	<b>20.083.524,55</b>		<b>1,15%</b>										
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					1,72%	5,07%	10,03%	12,84%	21,42%	37,49%	56,03%	
<b>MM MACRO</b>	<b>16.259.252,18</b>		<b>0,93%</b>										
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	6.028.982,66	0,35%	QUANTITAS	2,38%	0,18%	1,58%	2,90%	4,06%	7,08%	14,14%	24,18%		
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.192.573,88	0,13%	OCCAM	0,13%	0,86%	0,79%	1,07%	1,49%	2,69%	2,00%	13,75%	34,81%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	3.777.237,42	0,22%	OCCAM	0,14%	0,86%	0,79%	1,07%	1,50%	2,70%	1,98%	-	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.094.705,78	0,12%	PACIFICO	0,51%	2,19%	-0,17%	-1,49%	1,06%	-1,31%	0,67%	5,91%	16,14%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	2.165.752,44	0,12%	ZEITGEIST	0,13%	4,09%	1,03%	3,19%	7,44%	3,01%	3,66%	17,86%	27,98%	
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%	
<b>MM LONG-SHORT</b>	<b>3.824.272,37</b>		<b>0,22%</b>										
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	3.824.272,37	0,22%	KONDOR	0,87%	1,60%	1,82%	3,90%	5,67%	5,11%	6,12%	10,17%	-	
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%	
<b>Exterior</b>	<b>35.598.441,69</b>		<b>2,04%</b>										
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					2,78%	3,77%	7,14%	15,58%	20,26%	82,56%	79,59%	
<b>RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>35.598.441,69</b>		<b>2,04%</b>										
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	35.598.441,69	2,04%	BLACKROCK	0,67%	5,39%	1,46%	6,72%	9,96%	20,93%	22,62%	96,33%	100,23%	
Benchmark:	MSCIWBRL					2,78%	3,77%	7,14%	15,58%	20,26%	82,56%	79,59%	
<b>Operações com Participantes</b>	<b>35.906.644,41</b>		<b>2,06%</b>										
Benchmark:	INPC + 5,97% a.a.					1,39%	4,07%	7,95%	10,09%	16,99%	27,62%	39,58%	
<b>Imobiliário</b>	<b>54.015.339,24</b>		<b>3,10%</b>										
Benchmark:	INPC					0,88%	2,52%	4,79%	5,94%	10,42%	13,67%	17,40%	
<b>Total</b>	<b>1.743.287.708,29</b>		<b>100%</b>			<b>2,78%</b>	<b>-1,02%</b>	<b>-1,22%</b>	<b>2,77%</b>	<b>0,51%</b>	<b>7,04%</b>	<b>12,51%</b>	<b>25,48%</b>
Benchmark:	INPC + 4,5% a.a.					1,27%	3,69%	7,18%	9,07%	15,37%	24,11%	33,88%	

\* Rentabilidades de Carteiras, Segmentos e Planos foram informados pela (o) ELETROS

\* 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.

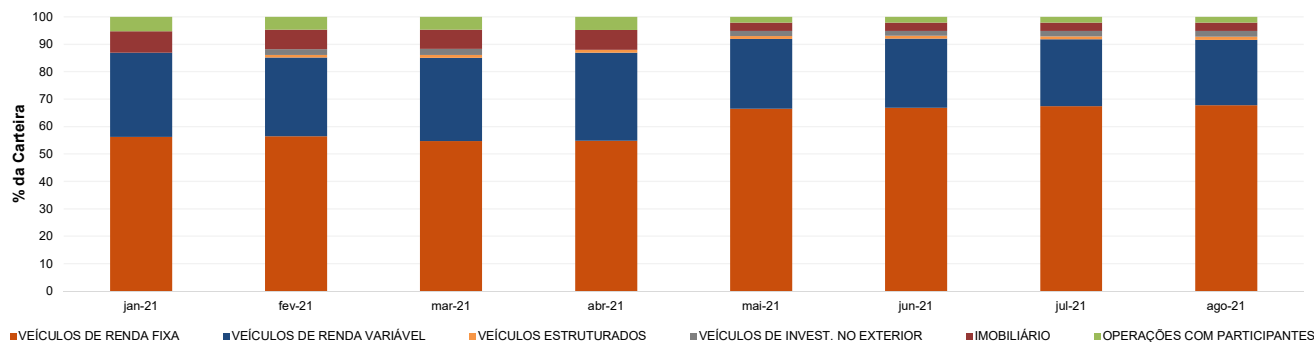
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

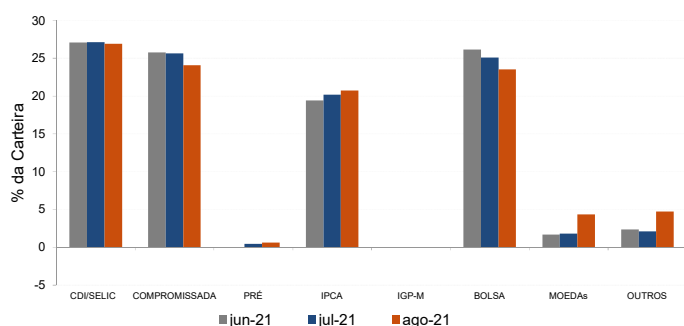
## Distribuição da Carteira

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.

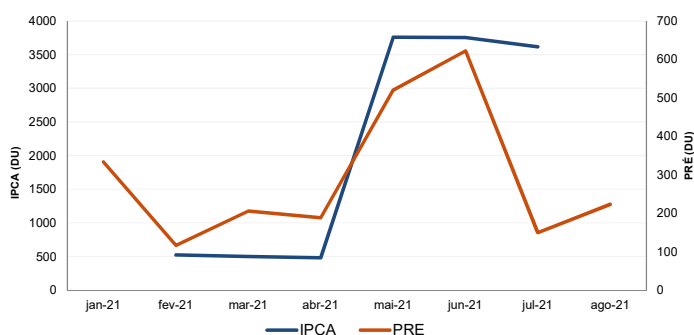
## Evolução do Patrimônio Líquido



## 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	48.387,12	12,09	53.787,69	12,81
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	25.309,96	6,32	24.295,02	5,79
ITSA4	Intermediários Financeiros	17.127,99	4,28	16.191,12	3,86
ITUB4	Intermediários Financeiros	14.175,87	3,54	13.775,06	3,28
GNDI3	Análises e Diagnósticos	12.389,81	3,09	11.846,45	2,82
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	11.578,03	2,89	12.527,60	2,98
SUZB3	Madeira e Papel	9.564,51	2,39	6.716,28	1,60
EQTL3	Energia Elétrica	8.948,86	2,24	8.328,20	1,98
BPAC11	Intermediários Financeiros	8.793,47	2,20	12.289,13	2,93
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	8.460,65	2,11	9.284,52	2,21

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

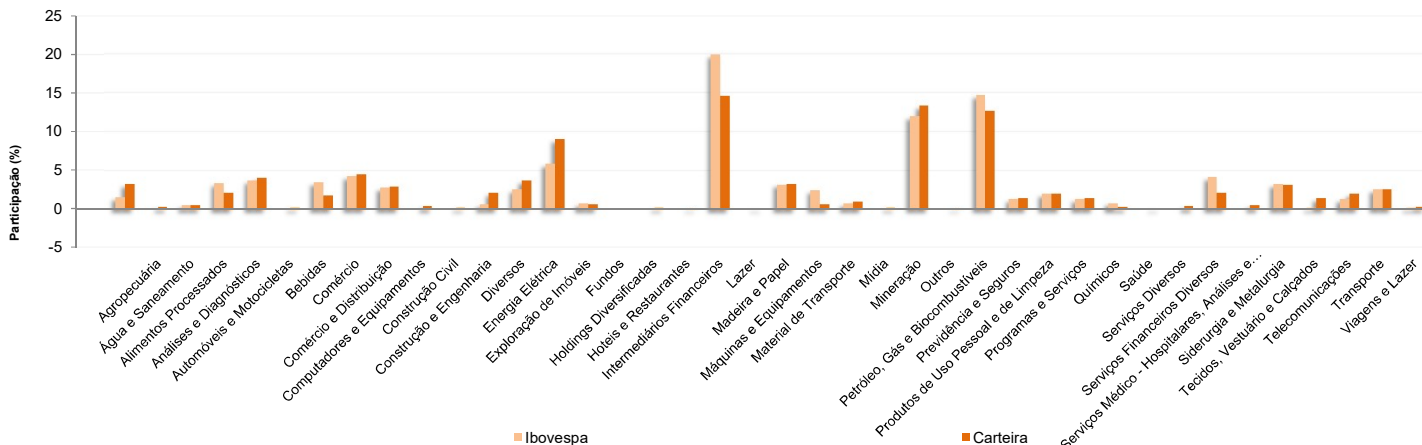
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	73,33	0,02	0,07	16
MTSA4	369,01	0,09	0,27	15
HBRE3	701,37	0,18	0,23	4
SCAR3	223,29	0,06	0,02	4
EMAE4	128,18	0,03	0,01	4
LAND3	515,54	0,13	0,11	3
COCE5	509,14	0,13	0,04	2
KRSA3	403,62	0,10	0,06	2
BEES3	35,40	0,01	0,06	2
VALE3	48.387,12	12,09	0,01	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.



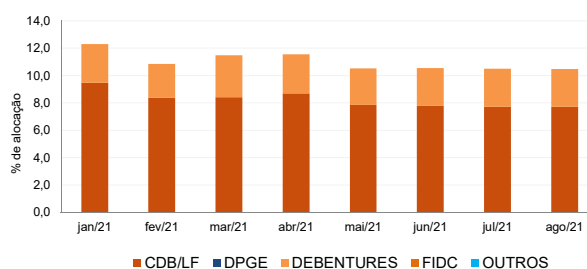
**Análises de Contrapartes**

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 BRADESCO SA	92.585,93	5,45	Faixa 1
VALE SA	48.387,12	2,85	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	32.143,17	1,89	Faixa 2
BCO SAFRA SA	21.371,15	1,26	Faixa 1
ITAUSA SA	20.079,92	1,18	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	18.466,04	1,09	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	14.437,95	0,85	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	14.175,87	0,83	Faixa 1
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	12.389,81	0,73	Sem Faixa
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	11.744,08	0,69	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
CEED11	432,89	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRIC/	Sem Faixa	Faixa 2	15-ago-26	CDI	1,45%	URCA FI MULT CRED PRIV
ITSA14	2.951,93	ITAUSA SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-jun-27	CDI	1,40%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

## ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 31/08/2021

### 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
CEED11	15-ago-26	432.895	0,03%	CDI	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA I	25-ago-21	1,45%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI	20-ago-24	18.459.756	1,09%	CDI	BCO SAFRA SA	20-ago-21	1,20%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LF CDI Mensal	19-ago-24	18.466.044	1,09%	CDI	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVI	18-ago-21	1,50%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LF CDI Mensal	19-ago-24	18.461.697	1,09%	CDI	BCO BRADESCO SA	19-ago-21	0,75%	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
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	777.309	0,05%	IPCA		19-ago-21	3,61%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	648.627	0,04%	IPCA		19-ago-21	3,56%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	518.206	0,03%	IPCA		19-ago-21	3,57%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	518.206	0,03%	IPCA		19-ago-21	3,60%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	389.524	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,67%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	389.524	0,02%	IPCA		18-ago-21	3,55%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	389.524	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	389.524	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,65%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	389.524	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,66%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	387.785	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,52%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	387.785	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	297.360	0,02%	IPCA		24-ago-21	3,72%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	259.103	0,02%	IPCA		18-ago-21	3,50%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	259.103	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	259.103	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	259.103	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,67%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	259.103	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,69%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	259.103	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,71%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	257.364	0,02%	IPCA		24-ago-21	3,73%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	147.810	0,01%	IPCA		24-ago-21	3,72%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	130.421	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,53%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	130.421	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,46%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	130.421	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,53%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	130.421	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	130.421	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,73%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	130.421	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,54%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	130.421	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,51%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	130.421	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,57%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	128.682	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	128.682	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,50%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	128.682	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,57%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	128.682	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,64%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	128.682	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,66%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	128.682	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,68%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	128.682	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,72%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	97.381	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,60%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	29.062.210	1,71%	IPCA		19-ago-21	4,99%	4,93%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA I