

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

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	1.167.465.110,02	68,13%				-0,16%	-0,81%	0,47%	-0,73%	2,64%	9,02%	16,44%	
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%	
RF REFERENCIADO DI	808.042.029,46	47,16%											
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	497.882.215,46	29,06%	ALFA	46,93%	0,01%	0,48%	1,33%	2,17%	2,62%	3,29%	6,64%	13,33%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	78.211.194,53	4,56%	BRADESCO	48,57%	0,00%	0,43%	1,20%	1,97%	2,44%	2,90%	6,48%	13,09%	
URCA FI MULT CRED PRIV	231.948.619,47	13,54%	SANTANDER	46,32%	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%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	359.423.080,56	20,98%											
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	359.423.080,56	20,98%		100%	3,87%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%	
Renda Variável	400.509.256,40	23,37%				-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	197.471.396,98	11,52%											
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	123.938.492,07	7,23%	SHARP	29,98%	6,34%	-6,51%	-12,01%	-3,82%	-5,23%	18,40%	13,68%	62,34%	
FIA SAO CONRADO	10.638.028,46	0,62%	EQUITAS	29,98%	6,51%	-8,85%	-16,42%	-2,15%	-5,93%	12,19%	-1,04%	35,12%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	47.435.749,22	2,77%	CONSTANCIA	29,98%	5,36%	-4,64%	-11,05%	-2,81%	-0,26%	17,51%	11,65%	-	
FIA PIPA	7.525.339,74	0,44%	XP	29,98%	3,99%	-4,64%	-16,34%	-4,33%	-7,66%	4,60%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	7.933.787,50	0,46%	CONSTELLATION	29,98%	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	81.632.092,96	4,76%											
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RV	81.632.092,96	4,76%		100%	6,68%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-6,99%	-13,61%	-5,31%	-5,99%	17,82%	7,71%	45,23%	
RV VALOR	58.087.704,10	3,39%											
VINCI JOATINGA FIA	48.178.516,45	2,81%	VINCI	29,98%	5,46%	-6,88%	-12,52%	-5,87%	-7,35%	12,65%	13,07%	-	
FIA ITACOATIARA	9.909.187,65	0,58%	INDIE CAPITAL	29,98%	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	47.498.377,68	2,77%											
GRUMARI FIA	47.498.377,68	2,77%	AZ QUEST	29,98%	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	15.819.684,69	0,92%											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	15.819.684,69	0,92%	BLACKROCK	0,10%	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	20.091.614,74	1,17%											
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					2,01%	5,70%	10,32%	15,11%	21,82%	39,21%	57,54%	
MM MACRO	16.247.862,05	0,95%											
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	6.051.293,26	0,35%	QUANTITAS	2,38%	0,37%	1,44%	2,30%	4,44%	8,31%	13,88%	23,96%		
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.190.505,50	0,13%	OCCAM	0,12%	0,79%	-0,09%	0,77%	1,40%	2,59%	3,85%	12,91%	32,32%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	3.773.981,51	0,22%	OCCAM	0,15%	0,79%	-0,09%	0,78%	1,41%	2,62%	3,85%	-	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.062.224,67	0,12%	PACIFICO	0,58%	1,62%	-1,55%	-2,79%	-0,57%	-2,84%	0,65%	2,90%	14,39%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	2.169.857,11	0,13%	ZEITGEIST	0,13%	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%	
MM LONG-SHORT	3.843.752,69	0,22%											
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	3.843.752,69	0,22%	KONDOR	0,86%	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	35.738.593,14	2,09%											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					1,22%	8,36%	2,09%	16,99%	22,47%	80,14%	87,02%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	35.738.593,14	2,09%											
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	35.738.593,14	2,09%	BLACKROCK	0,63%	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	35.658.248,81	2,08%											
Benchmark:	INPC + 5,97% a.a.					1,69%	4,69%	8,26%	11,95%	17,37%	29,21%	40,90%	
Imobiliário	54.075.221,13	3,16%											
Benchmark:	INPC					1,20%	3,13%	5,14%	7,21%	10,78%	15,09%	18,45%	
Total	1.713.538.044,24	100%				2,06%	-1,55%	-3,32%	0,07%	-1,05%	6,83%	9,72%	22,57%
Benchmark:	INPC + 4,5% a.a.					1,57%	4,31%	7,50%	10,79%	15,75%	25,66%	35,13%	

* 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.

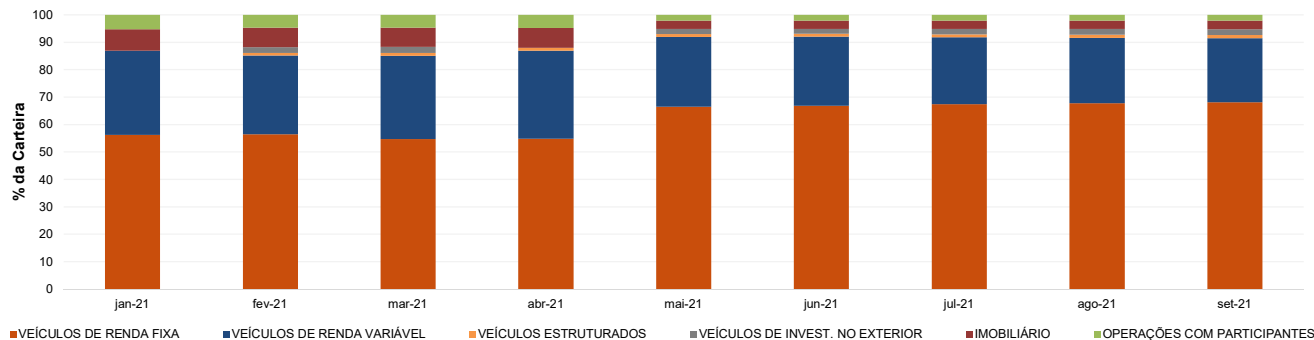
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

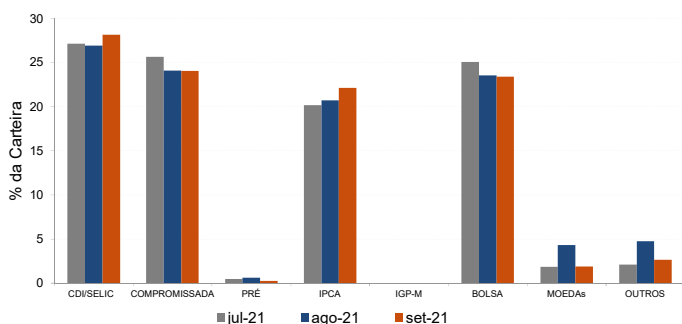
Distribuição da Carteira

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.

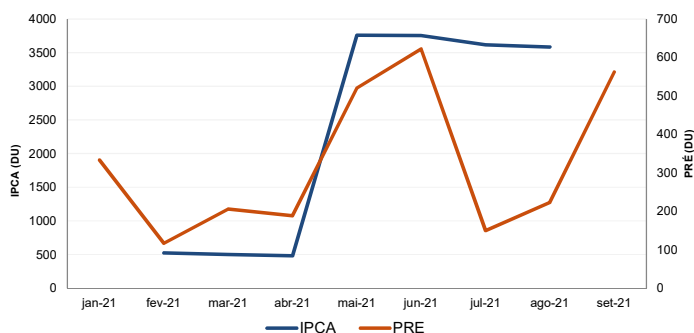
Evolução do Patrimônio Líquido



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	34.798,62	9,17	48.387,12	12,09
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	25.249,22	6,65	25.309,96	6,32
ITSA4	Intermediários Financeiros	16.358,30	4,31	17.127,99	4,28
ITUB4	Intermediários Financeiros	13.901,67	3,66	14.175,87	3,54
EQTL3	Energia Elétrica	12.428,48	3,27	8.948,86	2,24
GNDI3	Análises e Diagnósticos	12.391,80	3,26	12.389,81	3,09
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	10.356,14	2,73	11.578,03	2,89
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	8.075,99	2,13	8.460,65	2,11
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	7.596,98	2,00	8.217,57	2,05
SUZB3	Madeira e Papel	7.319,18	1,93	9.564,51	2,39

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

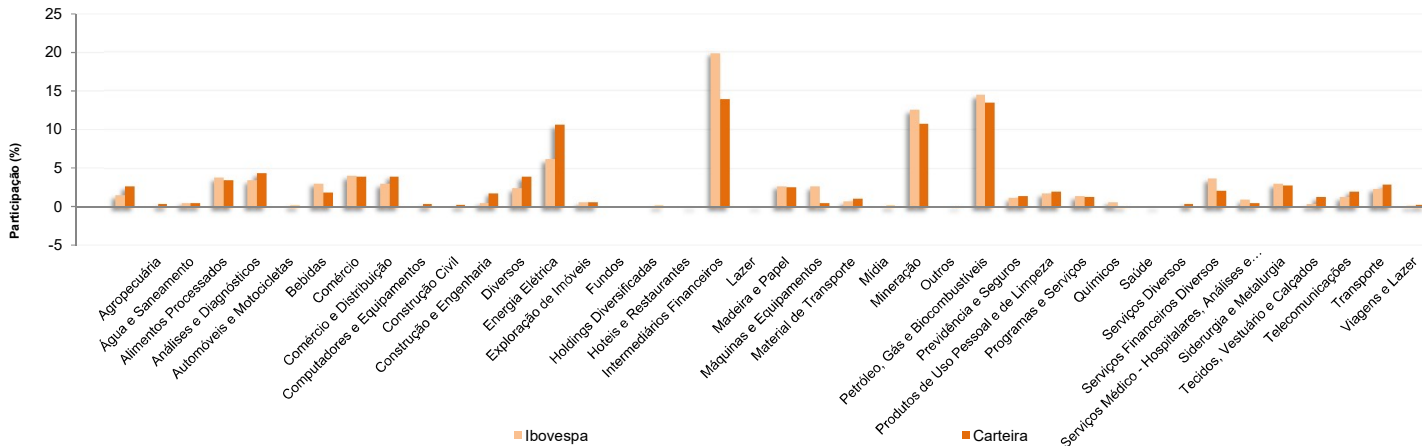
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	73,34	0,02	0,07	33
HBRE3	787,37	0,21	0,23	12
MTSA4	338,64	0,09	0,26	11
SCAR3	205,94	0,05	0,02	4
LAND3	554,50	0,15	0,10	3
COCE5	498,89	0,13	0,04	3
EMAE4	110,63	0,03	0,01	3
ELMD3	773,18	0,20	0,09	2
STOC31	125,91	0,03	0,00	2
CLSC4	73,16	0,02	0,00	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.



ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 30/09/2021

Análises de Contrapartes

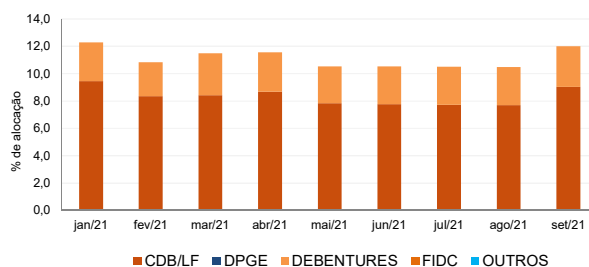
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	94.582,55	5,82	Faixa 1
VALE SA	34.798,62	2,14	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	32.758,23	2,02	Faixa 2
BCO SAFRA SA	25.971,80	1,60	Faixa 1
ITAUSA SA	19.376,95	1,19	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	18.814,69	1,16	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	13.901,67	0,86	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	12.719,24	0,78	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	12.428,48	0,76	Faixa 1
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	12.391,80	0,76	Sem Faixa

* 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 CD PURO

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	685.925	0,04%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	28-set-21	1,65%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LF CDI	02-out-23	4.192.839	0,26%	CDI	BCO SAFRA SA	29-set-21	1,05%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	3.485.836	0,21%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	673.928	0,04%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	139.433	0,01%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	28-set-23	4.564.765	0,28%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	28-set-21	1,10%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
RDORB7	20-dez-26	899.661	0,06%	CDI	REDE D OR SAO LUIZ SA	03-set-21	1,42%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
SBSPC7	15-dez-27	354.188	0,02%	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	1.355.977	0,08%	Selic		15-set-21	4,00%	0,03%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-03-01	01-mar-23	1.057.329	0,07%	Selic		09-set-21	0,08%	0,08%	GRUMARI FIA
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.161.303	0,07%	Selic		20-set-21	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	516.135	0,03%	Selic		20-set-21	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	36.129	0,00%	Selic		15-set-21	0,15%	0,15%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	2.721.596	0,17%	Selic		15-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	539.184	0,03%	Selic		23-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	513.509	0,03%	Selic		23-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	3.486.137	0,21%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	3.486.137	0,21%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.845.285	0,11%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.162.046	0,07%	IPCA		14-set-21	3,69%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.162.046	0,07%	IPCA		14-set-21	3,71%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.153.079	0,07%	IPCA		23-set-21	3,54%	3,54%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.153.079	0,07%	IPCA		23-set-21	3,52%	3,54%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	130.909	0,01%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	130.909	0,01%	IPCA		14-set-21	3,69%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	37.659	0,00%	IPCA		14-set-21	3,71%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV