

ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	188.250.718,46	46,75%				-0,52%	-0,34%	0,37%	-0,57%	2,18%	9,73%	17,13%	
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	110.637.942,85	27,47%											
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	110.637.942,85	27,47%		100%	5,07%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%	
RF REFERENCIADO DI	77.612.775,61	19,27%											
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	48.866.707,43	12,14%	ALFA	4,37%	0,02%	0,45%	1,19%	1,85%	2,14%	2,78%	6,63%	13,32%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	7.248.850,76	1,80%	BRADESCO	4,52%	0,00%	0,42%	1,07%	1,72%	2,00%	2,62%	6,52%	13,13%	
URCA FI MULT CRED PRIV	21.497.217,42	5,34%	SANTANDER	4,31%	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%	
Renda Variável	139.004.272,22	34,52%				-3,20%	-6,46%	7,31%	1,45%	18,66%	19,40%	66,03%	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					-3,09%	-6,05%	9,06%	2,41%	23,29%	24,34%	71,00%	
RV ATIVO	70.385.159,52	17,48%											
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	44.341.618,32	11,01%	SHARP	10,03%	7,11%	-2,22%	-5,07%	7,82%	1,37%	21,96%	26,06%	79,44%	
FIA SAO CONRADO	3.903.816,93	0,97%	EQUITAS	10,03%	6,91%	-2,27%	-4,51%	7,88%	3,20%	17,34%	9,09%	51,28%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	16.638.679,10	4,13%	CONSTANCIA	10,03%	5,91%	-2,85%	-7,29%	11,62%	4,59%	17,92%	18,53%	-	
FIA PIPA	2.639.618,41	0,66%	XP	10,03%	6,89%	-7,96%	-9,74%	2,08%	-3,17%	2,75%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	2.861.426,76	0,71%	CONSTELLATION	10,03%	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%	
CARTEIRA PRÓPRIA RV	29.988.788,45	7,45%											
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	29.988.788,45	7,45%		100%	7,85%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-3,25%	-6,53%	7,96%	1,07%	20,88%	19,52%	61,19%	
RV VALOR	20.808.408,39	5,17%											
VINCI JOATINGA FIA	17.306.178,59	4,30%	VINCI	10,03%	7,18%	-2,03%	-6,68%	5,77%	-0,51%	17,55%	23,61%	-	
FIA ITACOATIARA	3.502.229,80	0,87%	INDIE CAPITAL	10,03%	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%	
RV SMALL CAP	16.573.643,01	4,12%											
GRUMARI FIA	16.573.643,01	4,12%	AZ QUEST	10,03%	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%	
RV PASSIVO	1.248.272,84	0,31%											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	1.248.272,84	0,31%	BLACKROCK	0,01%	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%	
Estruturado	25.867.065,79	6,42%											
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					1,72%	5,07%	10,03%	12,84%	21,42%	37,49%	56,03%	
MM MACRO	20.941.500,82	5,20%											
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	7.765.175,42	1,93%	QUANTITAS	3,07%		0,18%	1,58%	2,90%	4,06%	7,08%	14,14%	24,18%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.823.979,06	0,70%	OCCAM	0,17%	0,86%	0,79%	1,07%	1,49%	2,69%	2,00%	13,75%	34,81%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	4.864.985,16	1,21%	OCCAM	0,19%	0,86%	0,79%	1,07%	1,50%	2,70%	1,98%	-	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.697.927,45	0,67%	PACIFICO	0,65%	2,19%	-0,17%	-1,49%	1,06%	-1,31%	0,67%	5,91%	16,14%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	2.789.433,73	0,69%	ZEITGEIST	0,17%	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%	
MM LONG-SHORT	4.925.564,97	1,22%											
NAVILS ESTRUTR FC DE FI MULT	4.925.564,97	1,22%	KONDOR	1,13%	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%	
Exterior	16.069.299,94	3,99%											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					2,78%	3,77%	7,14%	15,58%	20,26%	82,56%	79,59%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16.069.299,94	3,99%											
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	16.069.299,94	3,99%	BLACKROCK	0,30%	5,39%	1,46%	6,72%	9,96%	20,93%	22,62%	96,33%	100,23%	
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					2,78%	3,77%	7,14%	15,58%	20,26%	82,56%	79,59%	
Operações com Participantes	11.905.346,66	2,96%											
Benchmark:	INPC + 5,97% a.a.					1,39%	4,07%	7,95%	10,09%	16,99%	27,62%	39,58%	
Imobiliário	21.595.030,41	5,36%											
Benchmark:	INPC					0,88%	2,52%	4,79%	5,94%	10,42%	13,67%	17,40%	
Total	402.691.733,48	100%				3,48%	-1,44%	-2,12%	3,43%	1,39%	9,30%	23,24%	38,56%
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.

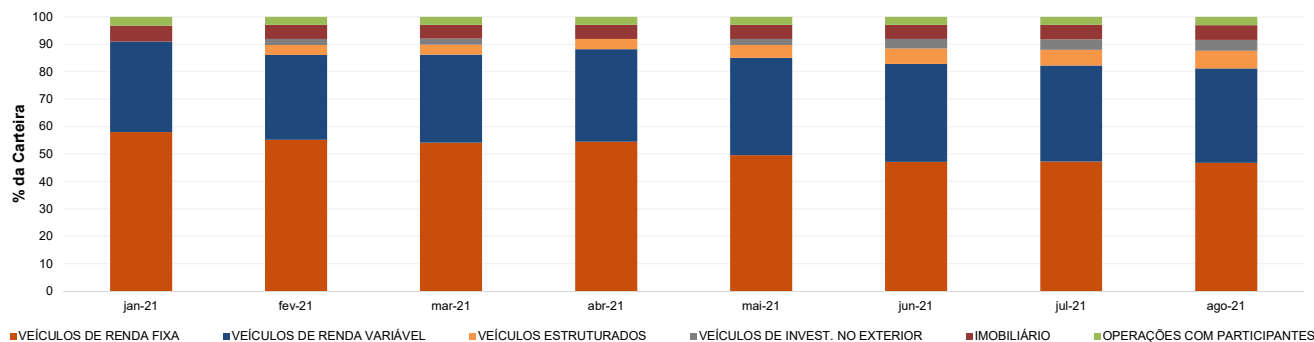
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

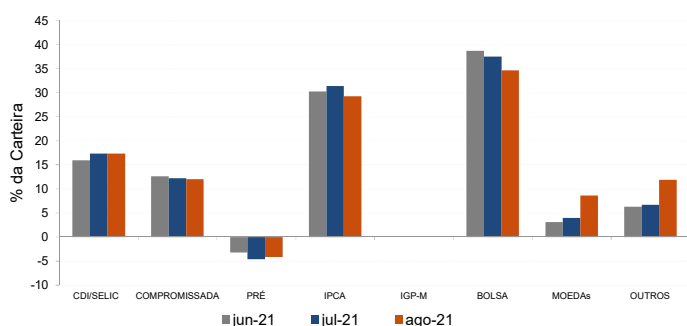
Distribuição da Carteira

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.

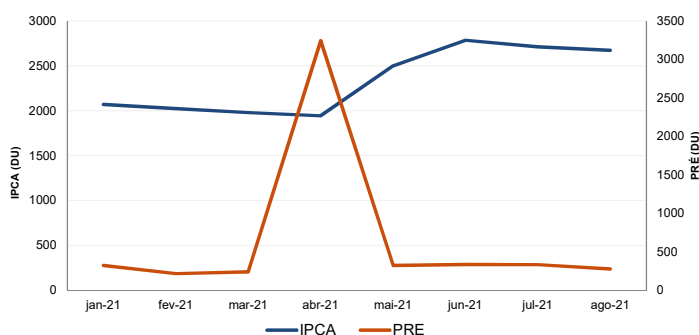
Evolução do Patrimônio Líquido



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	16.372,23	12,09	18.253,82	12,80
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	8.780,49	6,48	8.311,96	5,83
ITSA4	Intermediários Financeiros	5.745,31	4,24	5.437,63	3,81
ITUB4	Intermediários Financeiros	4.749,87	3,51	4.656,76	3,26
GNDI3	Análises e Diagnósticos	4.297,98	3,17	4.113,50	2,88
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	4.112,45	3,04	4.423,38	3,10
EQTL3	Energia Elétrica	3.214,39	2,37	2.915,76	2,04
SUZB3	Madeira e Papel	3.188,47	2,35	2.254,07	1,58
BPAC11	Intermediários Financeiros	3.009,24	2,22	4.212,22	2,95
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	2.823,44	2,08	3.144,11	2,20

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

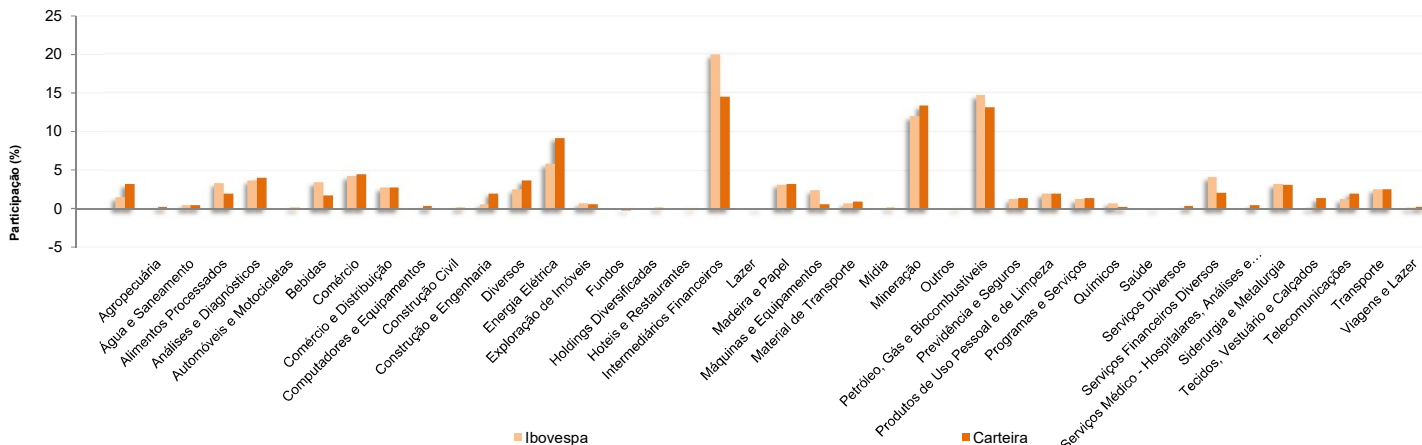
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	24,56	0,02	0,02	6
MTSA4	123,57	0,09	0,09	5
HBRE3	234,86	0,17	0,08	2
SCAR3	74,77	0,06	0,01	2
EMAE4	42,92	0,03	0,00	2
VALE3	16.372,23	12,09	0,00	1
PETR4	8.780,49	6,48	0,01	1
ITSA4	5.745,31	4,24	0,01	1
ITUB4	4.749,87	3,51	0,00	1
GNDI3	4.297,98	3,17	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.



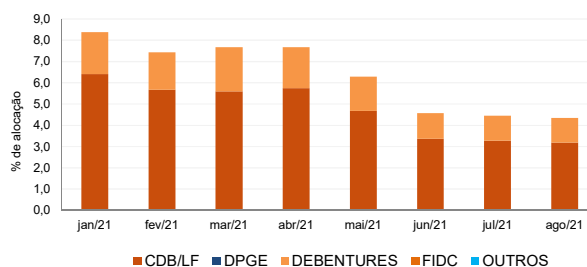
Análises de Contrapartes

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
VALE SA	16.372,23	4,21	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	10.464,62	2,69	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	10.138,52	2,60	Faixa 2
ITAUSA SA	6.025,47	1,55	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4.749,87	1,22	Faixa 1
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	4.297,98	1,10	Sem Faixa
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	4.112,45	1,06	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	3.342,60	0,86	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	3.214,39	0,83	Faixa 1
SUZANO S.A.	3.188,47	0,82	Faixa 1

* 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	41,09	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRIC/	Sem Faixa	Faixa 2	15-ago-26	CDI	1,45%	URCA FI MULT CRED PRIV
ITSA14	280,16	ITAUSA SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-jun-27	CDI	1,40%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

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	41.085	0,01%	CDI	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA I	25-ago-21	1,45%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI	20-ago-24	1.751.988	0,45%	CDI	BCO SAFRA SA	20-ago-21	1,20%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LF CDI Mensal	19-ago-24	1.752.585	0,45%	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	1.752.173	0,45%	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	73.773	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,61%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	61.560	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,56%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	49.182	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,60%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	49.182	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,57%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	36.969	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,55%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	36.969	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	36.969	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,65%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	36.969	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,66%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	36.969	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,67%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	36.804	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	36.804	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,52%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	28.222	0,01%	IPCA		24-ago-21	3,72%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	24.591	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,50%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	24.591	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	24.591	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	24.591	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,67%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	24.591	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,69%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	24.591	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,71%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	24.426	0,01%	IPCA		24-ago-21	3,73%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	14.028	0,00%	IPCA		24-ago-21	3,72%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.378	0,00%	IPCA		18-ago-21	3,54%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.378	0,00%	IPCA		18-ago-21	3,51%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.378	0,00%	IPCA		18-ago-21	3,57%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.378	0,00%	IPCA		18-ago-21	3,53%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.378	0,00%	IPCA		18-ago-21	3,46%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.378	0,00%	IPCA		19-ago-21	3,53%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.378	0,00%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.378	0,00%	IPCA		20-ago-21	3,73%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.213	0,00%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.213	0,00%	IPCA		18-ago-21	3,50%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.213	0,00%	IPCA		19-ago-21	3,57%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.213	0,00%	IPCA		20-ago-21	3,64%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.213	0,00%	IPCA		20-ago-21	3,66%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.213	0,00%	IPCA		20-ago-21	3,68%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.213	0,00%	IPCA		20-ago-21	3,72%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	9.242	0,00%	IPCA		18-ago-21	3,60%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV