

ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

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	185.883.476,20	47,50%				-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%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	109.620.645,09	28,01%											
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	109.620.645,09	28,01%		100%	3,14%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%	
RF REFERENCIADO DI	76.262.831,11	19,49%											
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	46.990.015,28	12,01%	ALFA	4,43%	0,01%	0,48%	1,33%	2,17%	2,62%	3,29%	6,64%	13,33%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	7.381.555,54	1,89%	BRADESCO	4,58%	0,00%	0,43%	1,20%	1,97%	2,44%	2,90%	6,48%	13,09%	
URCA FI MULT CRED PRIV	21.891.260,29	5,59%	SANTANDER	4,37%	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	129.804.270,51	33,17%				-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	64.000.095,43	16,36%											
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	40.168.224,06	10,27%	SHARP	9,72%	6,34%	-6,51%	-12,01%	-3,82%	-5,23%	18,40%	13,68%	62,34%	
FIA SAO CONRADO	3.447.764,32	0,88%	EQUITAS	9,72%	6,51%	-8,85%	-16,42%	-2,15%	-5,93%	12,19%	-1,04%	35,12%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	15.373.834,00	3,93%	CONSTANCIA	9,72%	5,36%	-4,64%	-11,05%	-2,81%	-0,26%	17,51%	11,65%	-	
FIA PIPA	2.438.947,96	0,62%	XP	9,72%	3,99%	-4,64%	-16,34%	-4,33%	-7,66%	4,60%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	2.571.325,09	0,66%	CONSTELLATION	9,72%	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	26.456.802,45	6,76%											
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	26.456.802,45	6,76%		100%	6,68%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-6,99%	-13,61%	-5,31%	-5,99%	17,82%	7,71%	45,23%	
RV VALOR	18.826.111,84	4,81%											
VINCI JOATINGA FIA	15.614.563,41	3,99%	VINCI	9,72%	5,46%	-6,88%	-12,52%	-5,87%	-7,35%	12,65%	13,07%	-	
FIA ITACOATIARA	3.211.548,43	0,82%	INDIE CAPITAL	9,72%	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	15.394.131,76	3,93%											
GRUMARI FIA	15.394.131,76	3,93%	AZ QUEST	9,72%	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	5.127.129,02	1,31%											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	5.127.129,02	1,31%	BLACKROCK	0,03%	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	25.877.485,79	6,61%											
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					2,01%	5,70%	10,32%	15,11%	21,82%	39,21%	57,54%	
MM MACRO	20.926.830,66	5,35%											
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	7.793.910,92	1,99%	QUANTITAS	3,07%		0,37%	1,44%	2,30%	4,44%	8,31%	13,88%	23,96%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.821.315,04	0,72%	OCCAM	0,15%	0,79%	-0,09%	0,77%	1,40%	2,59%	3,85%	12,91%	32,32%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	4.860.791,63	1,24%	OCCAM	0,19%	0,79%	-0,09%	0,78%	1,41%	2,62%	3,85%	-	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.656.092,62	0,68%	PACIFICO	0,74%	1,62%	-1,55%	-2,79%	-0,57%	-2,84%	0,65%	2,90%	14,39%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	2.794.720,45	0,71%	ZEITGEIST	0,17%	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	4.950.655,13	1,27%											
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	4.950.655,13	1,27%	KONDOR	1,10%	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	16.132.564,90	4,12%											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					1,22%	8,36%	2,09%	16,99%	22,47%	80,14%	87,02%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16.132.564,90	4,12%											
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	16.132.564,90	4,12%	BLACKROCK	0,29%	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	11.981.884,32	3,06%											
Benchmark:	INPC + 5,97% a.a.					1,69%	4,69%	8,26%	11,95%	17,37%	29,21%	40,90%	
Imobiliário	21.618.970,84	5,52%											
Benchmark:	INPC					1,20%	3,13%	5,14%	7,21%	10,78%	15,09%	18,45%	
Total	391.298.652,56	100%				2,75%	-2,20%	-4,79%	-0,64%	-0,84%	8,65%	19,39%	34,35%
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.

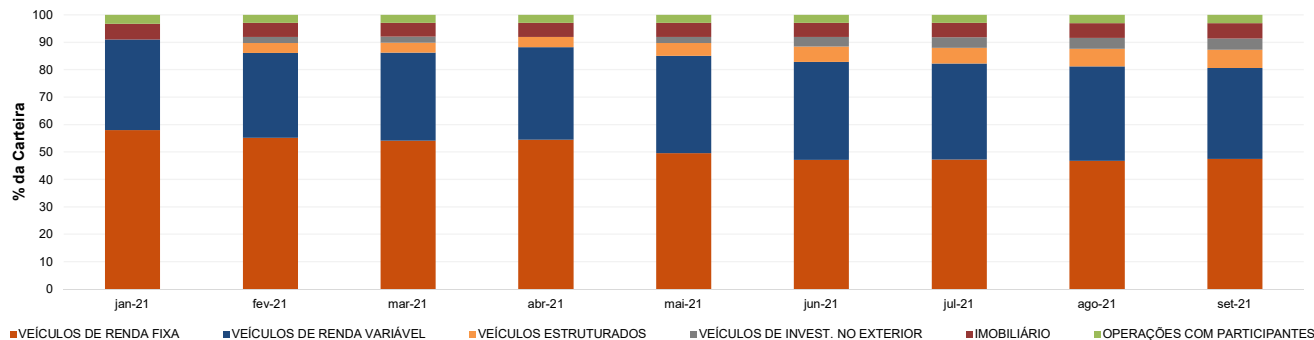
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

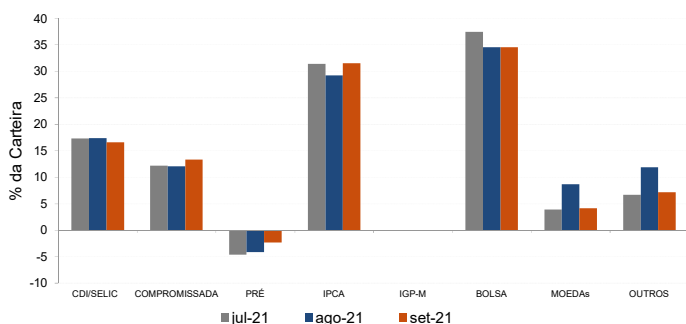
Distribuição da Carteira

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.

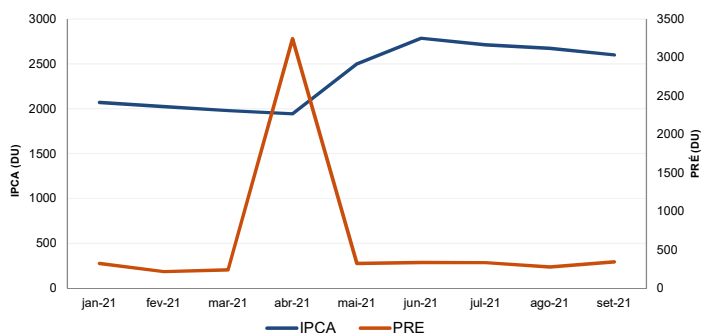
Evolução do Patrimônio Líquido



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	11.289,77	9,07	16.372,23	12,09
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	8.489,57	6,82	8.780,49	6,48
ITSA4	Intermediários Financeiros	5.309,51	4,27	5.745,31	4,24
ITUB4	Intermediários Financeiros	4.556,98	3,66	4.749,87	3,51
EQTL3	Energia Elétrica	4.264,85	3,43	3.214,39	2,37
GNDI3	Análises e Diagnósticos	4.185,35	3,36	4.297,98	3,17
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	3.524,76	2,83	4.112,45	3,04
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	2.612,78	2,10	2.823,44	2,08
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	2.473,77	1,99	2.799,09	2,07
ABEV3	Bebidas	2.387,61	1,92	2.445,17	1,81

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

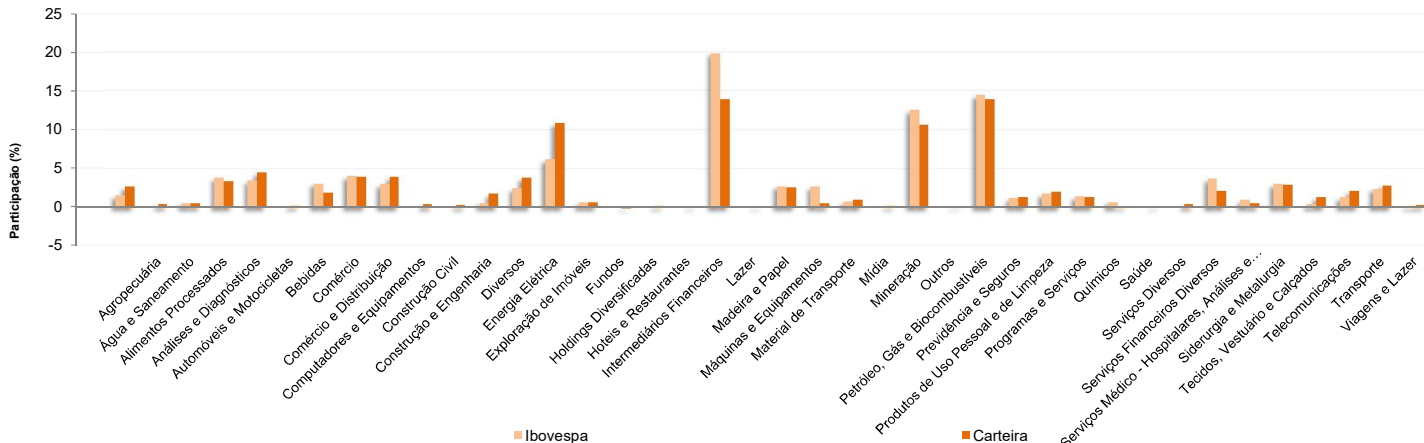
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	23,77	0,02	0,02	11
HBRE3	255,19	0,21	0,07	4
MTSA4	109,75	0,09	0,08	4
SCAR3	66,75	0,05	0,01	2
VALE3	11.289,77	9,07	0,00	1
PETR4	8.489,57	6,82	0,01	1
ITSA4	5.309,51	4,27	0,01	1
ITUB4	4.556,98	3,66	0,00	1
EQTL3	4.264,85	3,43	0,02	1
GNDI3	4.185,35	3,36	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.



ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

Data-base: 30/09/2021

Análises de Contrapartes

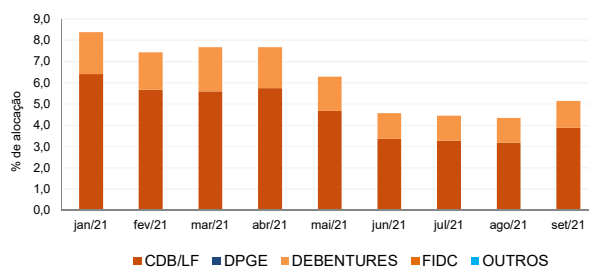
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
VALE SA	11.289,77	3,15	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	10.584,95	2,96	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	10.024,15	2,80	Faixa 2
ITAUSA SA	5.594,41	1,56	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4.556,98	1,27	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	4.264,85	1,19	Faixa 1
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	4.185,35	1,17	Sem Faixa
VIBRA ENERGIA SA	3.524,76	0,98	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	2.958,24	0,83	Faixa 2
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	2.821,28	0,79	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 SALDADO

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	64.737	0,02%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	28-set-21	1,65%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LF CDI	02-out-23	395.719	0,11%	CDI	BCO SAFFRA SA	29-set-21	1,05%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	328.992	0,09%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	63.605	0,02%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	13.160	0,00%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	28-set-23	430.822	0,12%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	28-set-21	1,10%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
RDORB7	20-dez-26	84.910	0,02%	CDI	REDE D OR SÃO LUIZ SA	03-set-21	1,42%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
SBSPC7	15-dez-27	33.428	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	127.977	0,04%	Selic		15-set-21	4,00%	0,03%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-03-01	01-mar-23	342.678	0,10%	Selic		09-set-21	0,08%	0,08%	GRUMARI FIA
LFT 2023-09-01	01-set-23	109.604	0,03%	Selic		20-set-21	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	48.713	0,01%	Selic		20-set-21	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	3.410	0,00%	Selic		15-set-21	0,15%	0,15%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	256.864	0,07%	Selic		15-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	50.888	0,01%	Selic		23-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	48.465	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	329.021	0,09%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	329.021	0,09%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	174.158	0,05%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	109.674	0,03%	IPCA		14-set-21	3,69%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	109.674	0,03%	IPCA		14-set-21	3,71%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	108.827	0,03%	IPCA		23-set-21	3,54%	3,54%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	108.827	0,03%	IPCA		23-set-21	3,52%	3,54%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.355	0,00%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.355	0,00%	IPCA		14-set-21	3,69%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	3.554	0,00%	IPCA		14-set-21	3,71%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV

