

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	517.527.876,02	68,44%				-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%	
RF REFERENCIADO DI	353.069.758,64	46,69%											
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	222.300.471,31	29,40%	ALFA	19,89%	0,02%	0,45%	1,19%	1,85%	2,14%	2,78%	6,63%	13,32%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	32.975.885,32	4,36%	BRADESCO	20,57%	0,00%	0,42%	1,07%	1,72%	2,00%	2,62%	6,52%	13,13%	
URCA FI MULT CRED PRIV	97.793.402,01	12,93%	SANTANDER	19,59%	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%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	164.458.117,38	21,75%											
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RF	164.458.117,38	21,75%		100%	5,91%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%	
Renda Variável	198.437.549,08	26,24%				-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	100.479.347,32	13,29%											
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	63.300.515,31	8,37%	SHARP	14,32%	7,11%	-2,22%	-5,07%	7,82%	1,37%	21,96%	26,06%	79,44%	
FIA SAO CONRADO	5.572.950,03	0,74%	EQUITAS	14,32%	6,91%	-2,27%	-4,51%	7,88%	3,20%	17,34%	9,09%	51,28%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	23.752.785,78	3,14%	CONSTANCIA	14,32%	5,91%	-2,85%	-7,29%	11,62%	4,59%	17,92%	18,53%	-	
FIA PIPA	3.768.225,24	0,50%	XP	14,32%	6,89%	-7,96%	-9,74%	2,08%	-3,17%	2,75%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	4.084.870,95	0,54%	CONSTELLATION	14,32%	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	42.810.926,49	5,66%											
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RV	42.810.926,49	5,66%		100%	7,85%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-3,25%	-6,53%	7,96%	1,07%	20,88%	19,52%	61,19%	
RV VALOR	29.705.342,83	3,93%											
VINCI JOATINGA FIA	24.705.684,28	3,27%	VINCI	14,32%	7,18%	-2,03%	-6,68%	5,77%	-0,51%	17,55%	23,61%	-	
FIA ITACOATIARA	4.999.658,55	0,66%	INDIE CAPITAL	14,32%	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	23.659.942,58	3,13%											
GRUMARI FIA	23.659.942,58	3,13%	AZ QUEST	14,32%	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	1.781.989,86	0,24%											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	1.781.989,86	0,24%	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	11.621.365,63	1,54%											
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					1,72%	5,07%	10,03%	12,84%	21,42%	37,49%	56,03%	
MM MACRO	9.408.443,92	1,24%											
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	3.488.681,07	0,46%	QUANTITAS	1,38%	0,18%	1,58%	2,90%	4,06%	7,08%	14,14%	24,18%		
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	1.268.736,60	0,17%	OCCAM	0,08%	0,86%	0,79%	1,07%	1,49%	2,69%	2,00%	13,75%	34,81%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	2.185.704,85	0,29%	OCCAM	0,08%	0,86%	0,79%	1,07%	1,50%	2,70%	1,98%	-	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	1.212.105,06	0,16%	PACIFICO	0,29%	2,19%	-0,17%	-1,49%	1,06%	-1,31%	0,67%	5,91%	16,14%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	1.253.216,33	0,17%	ZEITGEIST	0,07%	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	2.212.921,71	0,29%											
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	2.212.921,71	0,29%	KONDOR	0,51%	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	15.314.592,72	2,03%											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					2,78%	3,77%	7,14%	15,58%	20,26%	82,56%	79,59%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15.314.592,72	2,03%											
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	15.314.592,72	2,03%	BLACKROCK	0,29%	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%	
Operações com Participantes	13.263.548,29	1,75%											
Benchmark:	INPC + 5,97% a.a.					1,39%	4,07%	7,95%	10,09%	16,99%	27,62%	39,58%	
Total	756.164.931,74	100%				2,79%	-1,09%	-1,40%	2,87%	0,66%	7,19%	12,33%	26,54%
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.

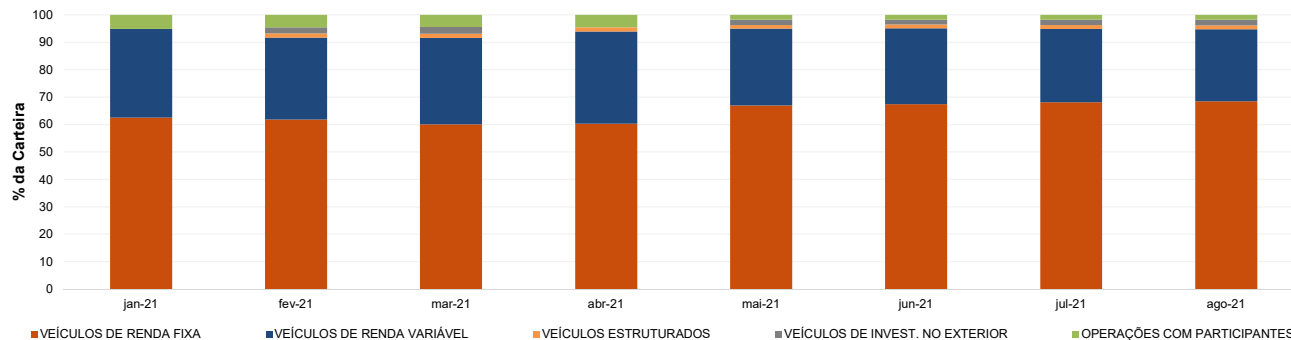
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

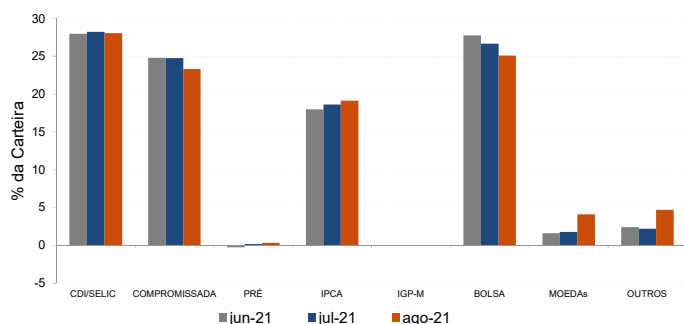
Distribuição da Carteira

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.

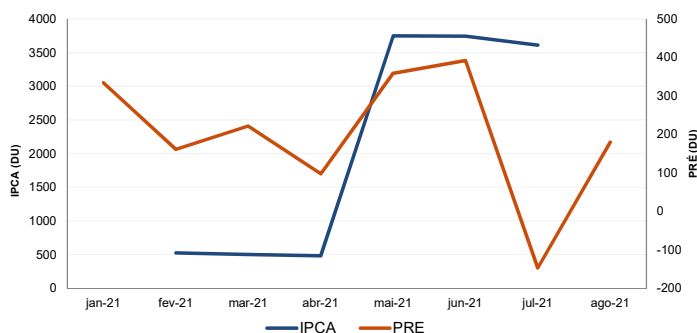
Evolução do Patrimônio Líquido



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	23.148,80	12,09	25.738,21	12,81
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	12.131,37	6,33	11.632,60	5,79
ITSA4	Intermediários Financeiros	8.188,88	4,28	7.741,66	3,85
ITUB4	Intermediários Financeiros	6.776,93	3,54	6.589,66	3,28
GNDI3	Análises e Diagnósticos	5.938,55	3,10	5.678,54	2,83
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	5.559,60	2,90	6.012,79	2,99
SUZB3	Madeira e Papel	4.570,70	2,39	3.211,18	1,60
EQTL3	Energia Elétrica	4.300,89	2,25	3.994,61	1,99
BPAC11	Intermediários Financeiros	4.210,45	2,20	5.884,93	2,93
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	4.043,50	2,11	4.442,07	2,21

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

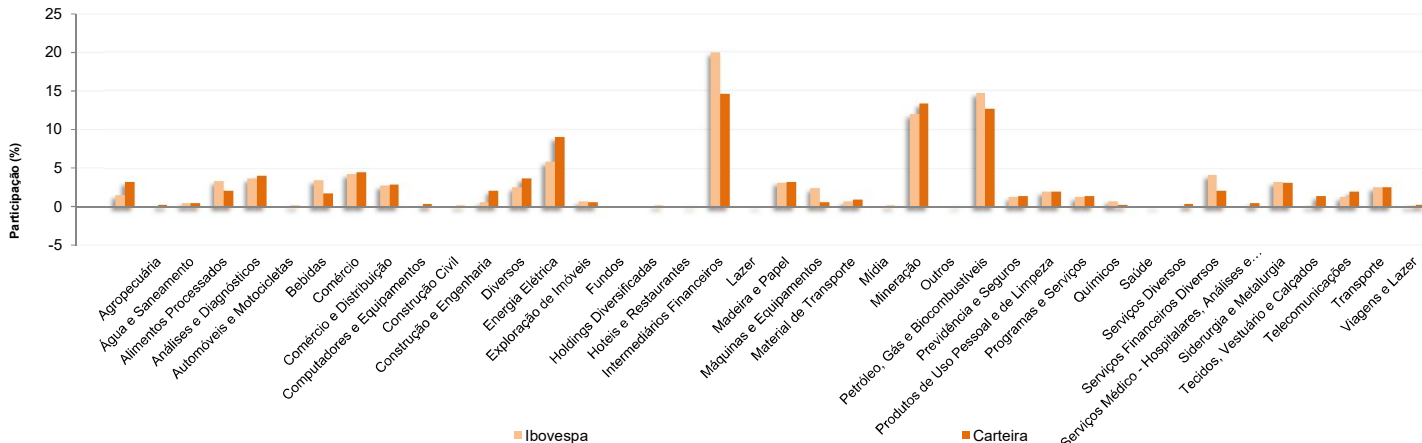
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	35,06	0,02	0,03	8
MTSA4	176,40	0,09	0,13	7
HBRE3	335,28	0,18	0,11	2
LAND3	246,45	0,13	0,05	2
SCAR3	106,74	0,06	0,01	2
EMAE4	61,27	0,03	0,00	2
VALE3	23.148,80	12,09	0,00	1
PETR4	12.131,37	6,33	0,01	1
ITSA4	8.188,88	4,28	0,02	1
ITUB4	6.776,93	3,54	0,00	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.



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.

Análises de Contrapartes

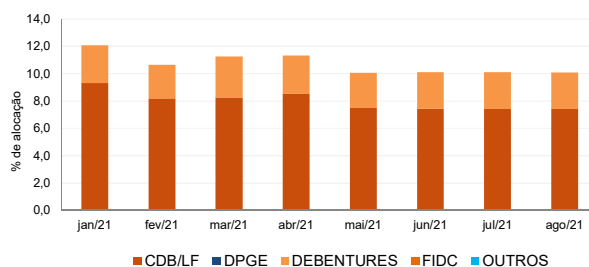
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	40.297,52	5,28	Faixa 1
VALE SA	23.148,80	3,04	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15.202,06	1,99	Faixa 2
ITAUSA SA	9.463,38	1,24	Faixa 2
BCO SAFRA SA	9.227,00	1,21	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	7.972,72	1,05	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	6.776,93	0,89	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	6.596,28	0,86	Faixa 2
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	5.938,55	0,78	Sem Faixa
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	5.559,60	0,73	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	186,90	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRIC/	Sem Faixa	Faixa 2	15-ago-26	CDI	1,45%	URCA FI MULT CRED PRIV
ITSA14	1.274,50	ITAUSA SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-jun-27	CDI	1,40%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	186.902	0,02%	CDI	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA I	25-ago-21	1,45%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI	20-ago-24	7.970.004	1,04%	CDI	BCO SAFRA SA	20-ago-21	1,20%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LF CDI Mensal	19-ago-24	7.972.719	1,05%	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	7.970.842	1,05%	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	335.603	0,04%	IPCA		19-ago-21	3,61%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	280.045	0,04%	IPCA		19-ago-21	3,56%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	223.735	0,03%	IPCA		19-ago-21	3,57%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	223.735	0,03%	IPCA		19-ago-21	3,60%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	168.177	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,67%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	168.177	0,02%	IPCA		18-ago-21	3,55%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	168.177	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	168.177	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,65%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	168.177	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,66%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	167.426	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,52%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	167.426	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	128.385	0,02%	IPCA		24-ago-21	3,72%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	111.868	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,67%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	111.868	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,69%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	111.868	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,71%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	111.868	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,50%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	111.868	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	111.868	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	111.117	0,01%	IPCA		24-ago-21	3,73%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	63.817	0,01%	IPCA		24-ago-21	3,72%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	56.309	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,57%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	56.309	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,53%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	56.309	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,46%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	56.309	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,53%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	56.309	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	56.309	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,73%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	56.309	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,54%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	56.309	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,51%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	55.558	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,72%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	55.558	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	55.558	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,50%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	55.558	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,57%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	55.558	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,64%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	55.558	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,66%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	55.558	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,68%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	42.044	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,60%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	12.103.774	1,59%	IPCA		19-ago-21	4,99%	4,93%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F