

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	509.930.843,36	68,75%				-0,16%	-0,61%	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	347.648.128,51	46,87%											
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	214.206.457,23	28,88%	ALFA	20,19%	0,01%	0,48%	1,33%	2,17%	2,62%	3,29%	6,64%	13,33%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	33.649.209,34	4,54%	BRADESCO	20,90%	0,00%	0,43%	1,20%	1,97%	2,44%	2,90%	6,48%	13,09%	
URCA FI MULT CRED PRIV	99.792.461,94	13,45%	SANTANDER	19,93%	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	162.282.714,85	21,88%											
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RF	162.282.714,85	21,88%		100%	3,55%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%	
Renda Variável	191.723.115,93	25,85%				-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	94.529.229,80	12,75%											
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	59.329.150,33	8,00%	SHARP	14,35%	6,34%	-6,51%	-12,01%	-3,82%	-5,23%	18,40%	13,68%	62,34%	
FIA SAO CONRADO	5.092.406,56	0,69%	EQUITAS	14,35%	6,51%	-8,85%	-16,42%	-2,15%	-5,93%	12,19%	-1,04%	35,12%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	22.707.414,38	3,06%	CONSTANCIA	14,35%	5,36%	-4,64%	-11,05%	-2,81%	-0,26%	17,51%	11,65%	-	
FIA PIPA	3.802.367,63	0,49%	XP	14,35%	3,99%	-4,64%	-16,34%	-4,33%	-7,66%	4,60%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	3.797.890,90	0,51%	CONSTELLATION	14,35%	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	39.077.147,34	5,27%											
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RV	39.077.147,34	5,27%		100%	6,68%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-6,99%	-13,61%	-5,31%	-5,99%	17,82%	7,71%	45,23%	
RV VALOR	27.806.487,49	3,75%											
VINCI JOATINGA FIA	23.062.975,82	3,11%	VINCI	14,35%	5,46%	-6,88%	-12,52%	-5,87%	-7,35%	12,65%	13,07%	-	
FIA ITACOATIARA	4.743.511,67	0,64%	INDIE CAPITAL	14,35%	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	22.737.394,51	3,07%											
GRUMARI FIA	22.737.394,51	3,07%	AZ QUEST	14,35%	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	7.572.856,79	1,02%											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	7.572.856,79	1,02%	BLACKROCK	0,05%	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	11.626.046,98	1,57%											
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					2,01%	5,70%	10,32%	15,11%	21,82%	39,21%	57,54%	
MM MACRO	9.401.852,96	1,27%											
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	3.501.591,12	0,47%	QUANTITAS	1,38%		0,37%	1,44%	2,30%	4,44%	8,31%	13,88%	23,96%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	1.267.539,73	0,17%	OCCAM	0,07%	0,79%	-0,09%	0,77%	1,40%	2,59%	3,85%	12,91%	32,32%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	2.183.820,81	0,29%	OCCAM	0,09%	0,79%	-0,09%	0,78%	1,41%	2,62%	3,85%	-	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	1.193.309,81	0,16%	PACIFICO	0,33%	1,62%	-1,55%	-2,79%	-0,57%	-2,84%	0,65%	2,90%	14,39%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	1.255.591,50	0,17%	ZEITGEIST	0,07%	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	2.224.194,02	0,30%											
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	2.224.194,02	0,30%	KONDOR	0,49%	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	15.374.886,42	2,07%											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					1,22%	8,36%	2,09%	16,99%	22,47%	80,14%	87,02%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15.374.886,42	2,07%											
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	15.374.886,42	2,07%	BLACKROCK	0,27%	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	13.026.344,86	1,76%											
Benchmark:	INPC + 5,97% a.a.					1,69%	4,69%	8,26%	11,95%	17,37%	29,21%	40,90%	
Total	741.681.237,55	100%				2,09%	-1,72%	-3,67%	-0,11%	-1,07%	6,95%	9,28%	23,24%
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.

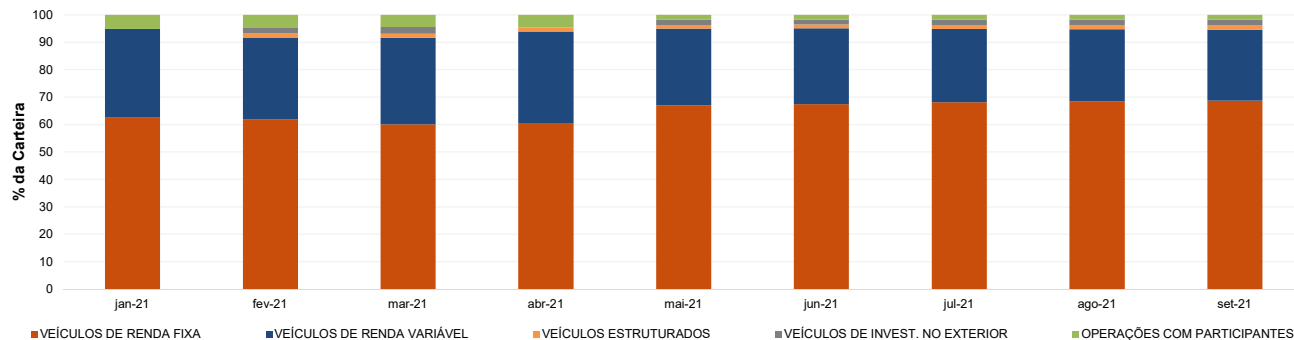
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

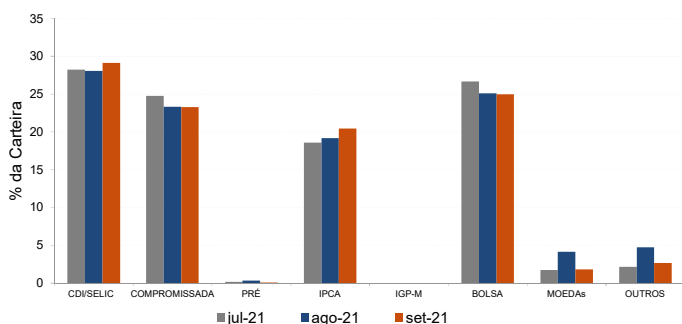
Distribuição da Carteira

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.

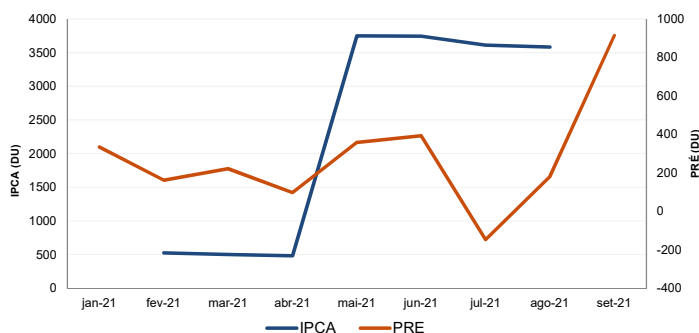
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	16.659,25	9,16	23.148,80	12,09
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	12.118,53	6,66	12.131,37	6,33
ITSA4	Intermediários Financeiros	7.831,50	4,31	8.188,88	4,28
ITUB4	Intermediários Financeiros	6.660,05	3,66	6.776,93	3,54
EQTL3	Energia Elétrica	5.974,05	3,28	4.300,89	2,25
GNDI3	Análises e Diagnósticos	5.949,48	3,27	5.938,55	3,10
BRDT3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	4.974,93	2,74	5.559,60	2,90
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	3.865,48	2,13	4.043,50	2,11
NTCO3	Produtos de Uso Pessoal e de Limpeza	3.637,87	2,00	3.933,32	2,05
ASAI3	Comércio e Distribuição	3.503,90	1,93	2.773,23	1,45

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

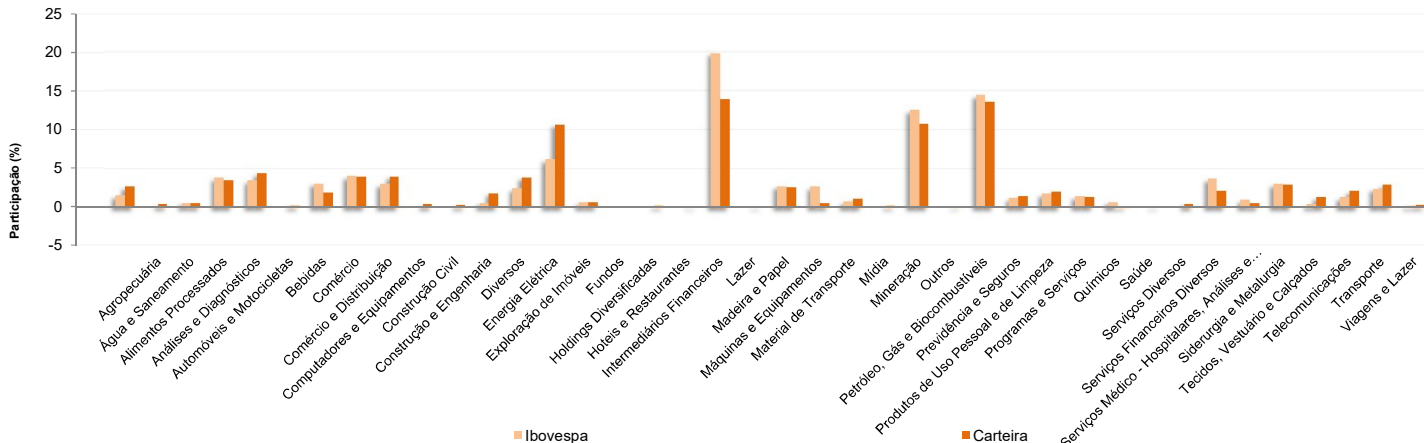
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	35,11	0,02	0,03	16
HBRE3	376,91	0,21	0,11	6
MTSA4	162,10	0,09	0,12	5
LAND3	265,44	0,15	0,05	2
COCE5	238,82	0,13	0,02	2
SCAR3	98,58	0,05	0,01	2
EMAE4	52,96	0,03	0,00	2
VALE3	16.659,25	9,16	0,00	1
PETRA4	12.118,53	6,66	0,01	1
ITSA4	7.831,50	4,31	0,02	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

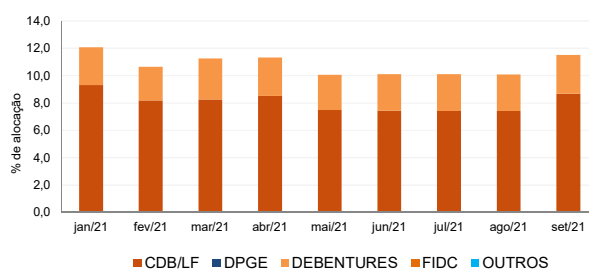
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	41.038,09	5,63	Faixa 1
VALE SA	16.659,25	2,28	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15.502,08	2,13	Faixa 2
BCO SAFRA SA	11.173,98	1,53	Faixa 1
ITAUSA SA	9.130,23	1,25	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	8.094,74	1,11	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	6.660,05	0,91	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	5.974,05	0,82	Faixa 1
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	5.949,48	0,82	Sem Faixa
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBI	5.820,13	0,80	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	295.109	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	1.803.907	0,25%	CDI	BCO SAFRA SA	29-set-21	1,05%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	1.499.730	0,21%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	289.948	0,04%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	59.989	0,01%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	28-set-23	1.963.923	0,27%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	28-set-21	1,10%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
RDORB7	20-dez-26	387.066	0,05%	CDI	REDE D OR SAO LUIZ SA	03-set-21	1,42%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
SBSPC7	15-dez-27	152.384	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	583.389	0,08%	Selic		15-set-21	4,00%	0,03%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-03-01	01-mar-23	506.142	0,07%	Selic		09-set-21	0,08%	0,08%	GRUMARI FIA
LFT 2023-09-01	01-set-23	499.633	0,07%	Selic		20-set-21	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	222.059	0,03%	Selic		20-set-21	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	15.544	0,00%	Selic		15-set-21	0,15%	0,15%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.170.926	0,16%	Selic		15-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	231.976	0,03%	Selic		23-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	220.929	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	1.499.859	0,21%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.499.859	0,21%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	793.907	0,11%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	499.953	0,07%	IPCA		14-set-21	3,69%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	499.953	0,07%	IPCA		14-set-21	3,71%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	496.095	0,07%	IPCA		23-set-21	3,54%	3,54%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	496.095	0,07%	IPCA		23-set-21	3,52%	3,54%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	56.322	0,01%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	56.322	0,01%	IPCA		14-set-21	3,69%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	16.202	0,00%	IPCA		14-set-21	3,71%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV