

ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 29/10/2021

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	1.138.495.329,97	54,45%				-0,57%	-3,58%	0,44%	4,90%	8,94%	41,28%	53,72%	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	842.321.579,20	40,29%											
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	842.321.579,20	40,29%		100%	2,49%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
RF REFERENCIADO DI	296.173.750,77	14,16%											
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	169.910.012,73	8,13%	ALFA	19,88%	0,02%	0,49%	1,41%	2,49%	3,12%	3,62%	6,66%	13,26%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	27.525.676,36	1,32%	BRADESCO	20,65%	0,00%	0,47%	1,33%	2,25%	2,93%	3,24%	6,48%	13,02%	
URCA FI MULT CRED PRIV	98.738.061,68	4,72%	SANTANDER	19,71%	0,38%	0,12%	0,96%	1,99%	2,43%	3,13%	6,07%	13,23%	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
Renda Variável	538.131.924,08	25,74%				-7,50%	-16,06%	-14,68%	-12,02%	8,98%	-1,97%	25,67%	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					-6,67%	-15,73%	-13,33%	-10,95%	12,59%	2,14%	30,02%	
RV ATIVO	260.210.393,85	12,44%											
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	164.558.889,93	7,87%	SHARP	42,80%	6,59%	-7,01%	-14,99%	-13,80%	-11,87%	11,04%	3,43%	35,29%	
FIA SAO CONRADO	12.806.266,52	0,61%	EQUITAS	42,80%	9,39%	-15,69%	-24,90%	-21,85%	-20,69%	-2,89%	-20,34%	1,77%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	63.127.077,76	3,02%	CONSTANCIA	42,80%	5,40%	-6,80%	-13,65%	-13,83%	-7,04%	11,43%	1,64%	-	
FIA PIPA	9.850.547,35	0,47%	XP	42,80%	4,84%	-8,33%	-19,54%	-15,76%	-15,35%	-0,20%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	9.867.612,29	0,47%	CONSTELLATION	42,80%	9,32%	-12,89%	-20,47%	-18,23%	-19,03%	-7,95%	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA					-6,74%	-15,02%	-12,95%	-13,04%	10,16%	-3,47%	18,39%	
CARTEIRA PRÓPRIA RV	118.061.681,79	5,65%											
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	118.061.681,79	5,65%		100%	6,45%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-6,81%	-16,15%	-14,19%	-12,40%	10,40%	-1,79%	22,56%	
RV VALOR	75.036.090,12	3,59%											
VINCI JOATINGA FIA	62.916.419,73	3,01%	VINCI	42,80%	5,80%	-8,54%	-16,56%	-16,56%	-15,27%	4,74%	0,57%	-	
FIA ITACOATIARA	12.119.670,38	0,58%	INDIE CAPITAL	42,80%	9,45%	-14,34%	-25,42%	-21,21%	-21,02%	-4,82%	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA					-6,74%	-15,02%	-12,95%	-13,04%	10,16%	-3,47%	18,39%	
RV SMALL CAP	63.680.047,36	3,05%											
GRUMARI FIA	63.680.047,36	3,05%	AZ QUEST	42,80%	2,72%	-6,11%	-14,55%	-13,03%	-7,23%	10,68%	3,42%	39,75%	
Benchmark:	SMLL					-12,53%	-21,28%	-20,14%	-17,37%	3,62%	-2,77%	38,93%	
RV PASSIVO	21.143.710,98	1,01%											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	21.143.710,98	1,01%	BLACKROCK	0,12%	6,42%	-6,39%	-14,88%	-12,87%	-13,06%	9,95%	-3,44%	18,23%	
Benchmark:	IBOVESPA					-6,74%	-15,02%	-12,95%	-13,04%	10,16%	-3,47%	18,39%	
Estruturado	71.066.281,40	3,40%											
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					1,93%	5,77%	11,18%	17,33%	22,10%	40,61%	58,62%	
MM MACRO	37.076.227,43	1,77%											
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	10.378.757,21	0,50%	QUANTITAS	4,14%		-1,33%	-0,79%	1,20%	3,06%	4,35%	13,80%	20,74%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	3.869.500,95	0,19%	OCCAM	0,21%	1,28%	1,63%	2,33%	2,59%	4,26%	5,23%	13,52%	31,97%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	15.318.398,02	0,73%	OCCAM	0,62%	1,28%	1,63%	2,34%	2,60%	4,29%	5,23%	-	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	3.555.196,32	0,17%	PACIFICO	1,11%	1,85%	-0,82%	-2,52%	-2,57%	-3,64%	0,30%	0,71%	11,41%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	3.954.374,93	0,19%	ZEITGEIST	0,22%	2,99%	4,84%	6,12%	10,43%	8,20%	12,76%	19,11%	32,01%	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
MM LONG-SHORT	18.572.606,20	0,89%											
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	18.572.606,20	0,89%	KONDOR	4,23%	1,79%	-2,20%	0,08%	3,81%	3,32%	7,16%	7,09%	-	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
FIP	15.417.447,77	0,74%											
SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES	15.417.447,77	0,74%	SIGNAL CAPITAL	12,37%		-0,71%	-18,11%	-30,95%	-31,23%	-27,36%	-25,87%	-13,46%	
Benchmark:	IPCA					1,25%	3,32%	5,73%	8,24%	10,67%	15,01%	17,92%	
Exterior	65.000.942,91	3,11%											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					9,54%	13,97%	12,82%	28,15%	35,37%	100,32%	138,32%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	65.000.942,91	3,11%											
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	65.000.942,91	3,11%	BLACKROCK	1,04%	5,72%	10,98%	13,04%	14,57%	34,74%	39,68%	117,49%	165,31%	
Benchmark:	MSCIWBRL					9,54%	13,97%	12,82%	28,15%	35,37%	100,32%	138,32%	
Operações com Participantes **	78.230.382,61	3,74%											
Benchmark:	INPC + 5,97% a.a.					1,63%	4,78%	9,10%	13,77%	17,66%	30,57%	41,90%	
Imobiliário **	199.961.918,35	9,56%											
Benchmark:	INPC					1,16%	3,27%	5,96%	8,45%	11,08%	16,38%	19,35%	
Total	2.090.886.779,32	100%				2,27%	-1,93%	-5,81%	-2,57%	1,33%	11,37%	29,90%	45,00%
Benchmark:	INPC + 4,5% a.a.					1,51%	4,42%	8,34%	12,46%	16,04%	27,00%	36,11%	

- Rentabilidades de Carteiras, Segmentos e Planos foram informados pela (o) ELETROS

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 30/09/2021

* 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.

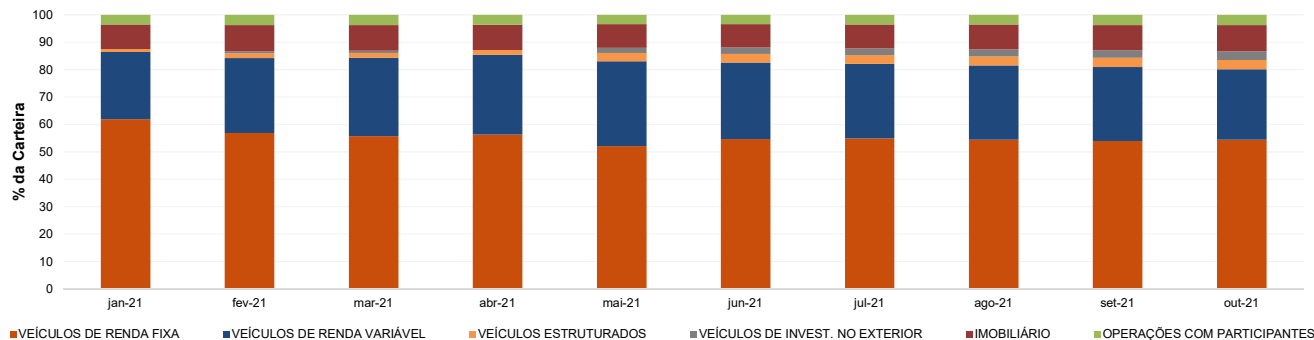
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

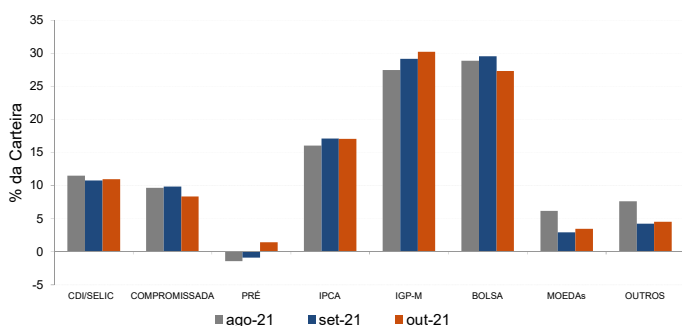
Distribuição da Carteira

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.

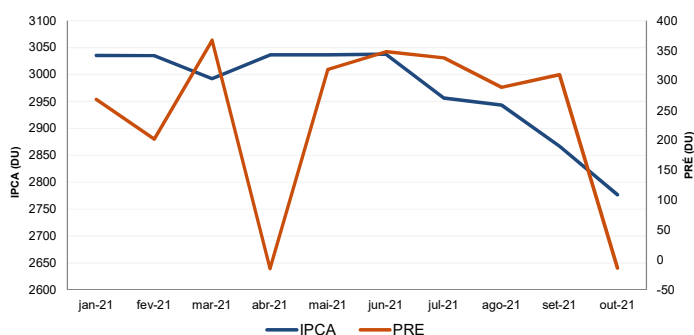
Evolução do Patrimônio Líquido



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	45.983,58	9,01	50.579,64	9,14
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	40.032,40	7,84	37.106,54	6,70
ITSA4	Intermediários Financeiros	21.393,07	4,19	23.779,95	4,30
EQTL3	Energia Elétrica	18.423,22	3,61	18.382,51	3,32
ITUB4	Intermediários Financeiros	17.943,64	3,52	20.269,99	3,66
GNDI3	Análises e Diagnósticos	16.215,88	3,18	18.236,87	3,29
SUZB3	Madeira e Papel	13.084,60	2,56	10.629,53	1,92
ABEV3	Bebidas	12.489,86	2,45	10.456,39	1,89
VBBR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	12.025,36	2,36	0,00	
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	11.042,08	2,16	11.728,41	2,12

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

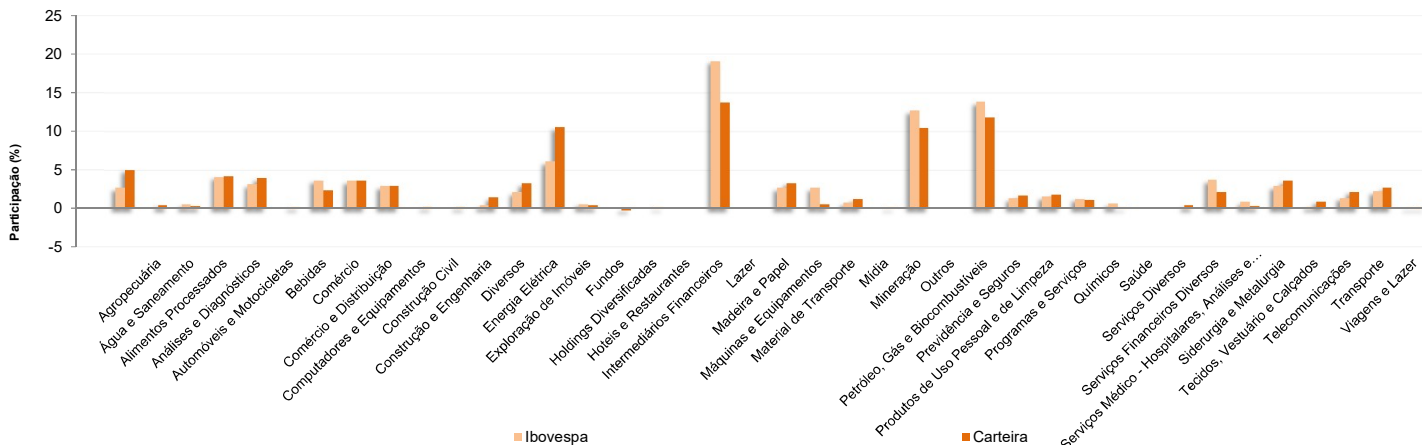
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BIME11	9,08	0,00	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	103,29	0,02	0,09	73
HBRE3	987,24	0,19	0,33	22
MTSA4	472,03	0,09	0,35	15
EMAE4	157,29	0,03	0,01	5
LAND3	987,65	0,19	0,15	4
SCAR3	295,66	0,06	0,03	4
EALT4	100,15	0,02	0,12	4
COCE5	638,29	0,13	0,06	3
CLSC4	101,52	0,02	0,01	3

* 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.



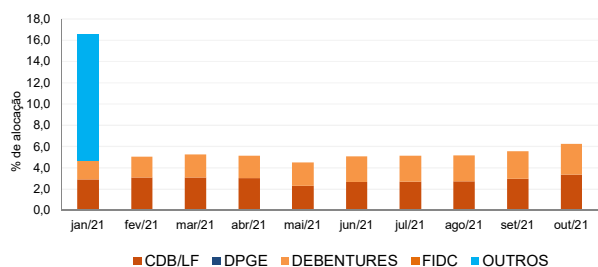
Análises de Contrapartes

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	75.019,45	4,13	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	47.236,51	2,60	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	47.089,11	2,59	Faixa 2
ITAUSA INVESTS ITAU SA	22.953,50	1,26	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	18.423,22	1,01	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	17.944,13	0,99	Faixa 1
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	16.215,88	0,89	Sem Faixa
SUZANO PAPEL CELULOSE SA	13.084,60	0,72	Faixa 1
AMBEV S.A	12.489,86	0,69	Faixa 1
VIBRA ENERGIA SA	12.025,36	0,66	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
MGLUA0	2.249,43	MAGAZINE LUIZA SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-26	CDI	1,25%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	287,55	MAGAZINE LUIZA SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-26	CDI	1,25%	URCA FI MULT CRED PRIV

ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 29/10/2021

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
CSBR11	10-dez-25	67.480	0,00%	CDI	CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÃO	14-out-21	3,00%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
ENGIB5	15-out-26	1.060.139	0,06%	CDI	ENERGISA SA	29-out-21	1,64%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
ITSA14	15-jun-27	277.885	0,02%	CDI	ITAUSA INVESTS ITAU SA	18-out-21	1,25%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	15-out-26	2.249.433	0,12%	CDI	MAGAZINE LUIZA SA	15-out-21	1,25%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	15-out-26	287.546	0,02%	CDI	MAGAZINE LUIZA SA	15-out-21	1,25%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2024-03-01	01-mar-24	2.197.250	0,12%	Selic		29-out-21	0,11%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

