

## ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

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	
<b>Renda Fixa</b>	<b>1.099.381.192,87</b>	<b>65,68%</b>				<b>-1,18%</b>	<b>-1,85%</b>	<b>-0,88%</b>	<b>-1,90%</b>	<b>1,22%</b>	<b>7,21%</b>	<b>13,92%</b>	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>669.544.168,00</b>	<b>40,00%</b>											
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	384.106.484,15	22,95%	ALFA	44,93%	0,02%	0,49%	1,41%	2,49%	3,12%	3,62%	6,66%	13,26%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	62.225.825,32	3,72%	BRADESCO	46,69%	0,00%	0,47%	1,33%	2,25%	2,93%	3,24%	6,48%	13,02%	
URCA FI MULT CRED PRIV	223.211.858,53	13,34%	SANTANDER	44,56%	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%	
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>429.837.024,87</b>	<b>25,68%</b>											
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	429.837.024,87	25,68%		100%	3,98%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
<b>Renda Variável</b>	<b>384.027.929,36</b>	<b>22,94%</b>				<b>-7,50%</b>	<b>-16,06%</b>	<b>-14,68%</b>	<b>-12,02%</b>	<b>8,98%</b>	<b>-1,97%</b>	<b>25,67%</b>	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					-6,67%	-15,73%	-13,33%	-10,95%	12,59%	2,14%	30,02%	
<b>RV ATIVO</b>	<b>185.694.351,65</b>	<b>11,09%</b>											
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	117.434.418,83	7,02%	SHARP	30,55%	6,59%	-7,01%	-14,99%	-13,80%	-11,87%	11,04%	3,43%	35,29%	
FIA SAO CONRADO	9.138.956,07	0,55%	EQUITAS	30,55%	9,39%	-15,69%	-24,90%	-21,85%	-20,69%	-2,89%	-20,34%	1,77%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	45.049.475,55	2,69%	CONSTANCIA	30,55%	5,40%	-6,80%	-13,65%	-13,83%	-7,04%	11,43%	1,64%	-	
FIA PIPA	7.029.661,56	0,42%	XP	30,55%	4,84%	-8,33%	-19,54%	-15,76%	-15,35%	-0,20%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	7.041.839,64	0,42%	CONSTELLATION	30,55%	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%	
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RV</b>	<b>84.252.543,22</b>	<b>5,03%</b>											
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RV	84.252.543,22	5,03%		100%	6,45%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-6,81%	-16,15%	-14,19%	-12,40%	10,40%	-1,79%	22,56%	
<b>RV VALOR</b>	<b>53.548.122,73</b>	<b>3,20%</b>											
VINCI JOATINGA FIA	44.899.143,34	2,68%	VINCI	30,55%	5,80%	-8,54%	-16,56%	-16,56%	-15,27%	4,74%	0,57%	-	
FIA ITACOATIARA	8.648.979,39	0,52%	INDIE CAPITAL	30,55%	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%	
<b>RV SMALL CAP</b>	<b>45.444.092,11</b>	<b>2,72%</b>											
GRUMARI FIA	45.444.092,11	2,72%	AZ QUEST	30,55%	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%	
<b>RV PASSIVO</b>	<b>15.088.819,64</b>	<b>0,90%</b>											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	15.088.819,64	0,90%	BLACKROCK	0,09%	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%	
<b>Estruturado</b>	<b>61.004.921,63</b>	<b>3,64%</b>											
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					1,93%	5,77%	11,18%	17,33%	22,10%	40,61%	58,62%	
<b>MM MACRO</b>	<b>40.644.739,54</b>	<b>2,43%</b>											
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	11.377.691,66	0,68%	QUANTITAS	4,54%		-1,33%	-0,79%	1,20%	3,06%	4,35%	13,80%	20,74%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	4.241.932,61	0,25%	OCCAM	0,23%	1,28%	1,63%	2,33%	2,59%	4,26%	5,23%	13,52%	31,97%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	16.792.762,94	1,00%	OCCAM	0,68%	1,28%	1,63%	2,34%	2,60%	4,29%	5,23%	-	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	3.897.376,79	0,23%	PACIFICO	1,21%	1,85%	-0,82%	-2,52%	-2,57%	-3,64%	0,30%	0,71%	11,41%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	4.334.975,54	0,26%	ZEITGEIST	0,24%	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%	
<b>MM LONG-SHORT</b>	<b>20.360.182,09</b>	<b>1,22%</b>											
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	20.360.182,09	1,22%	KONDOR	4,64%	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%	
<b>Exterior</b>	<b>39.662.830,82</b>	<b>2,37%</b>											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					9,54%	13,97%	12,82%	28,15%	35,37%	100,32%	138,32%	
<b>RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>39.662.830,82</b>	<b>2,37%</b>											
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	39.662.830,82	2,37%	BLACKROCK	0,63%	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%	
<b>Operações com Participantes **</b>	<b>35.658.248,81</b>	<b>2,13%</b>											
Benchmark:	INPC + 5,97% a.a.					1,63%	4,78%	9,10%	13,77%	17,66%	30,57%	41,90%	
<b>Imobiliário **</b>	<b>54.075.221,13</b>	<b>3,23%</b>											
Benchmark:	INPC					1,16%	3,27%	5,96%	8,45%	11,08%	16,38%	19,35%	
<b>Total</b>	<b>1.673.810.344,63</b>	<b>100%</b>				<b>2,28%</b>	<b>-2,30%</b>	<b>-4,80%</b>	<b>-3,31%</b>	<b>-3,33%</b>	<b>4,52%</b>	<b>6,12%</b>	<b>17,04%</b>
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.

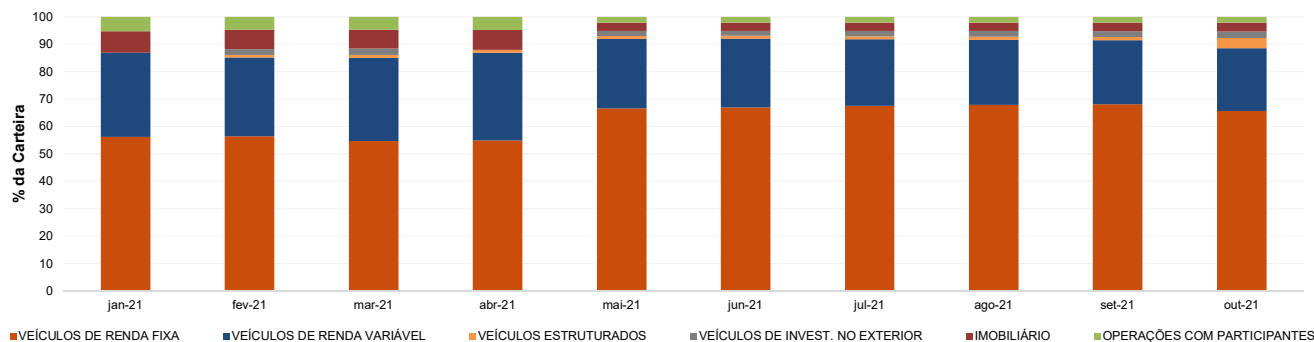
## ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 29/10/2021

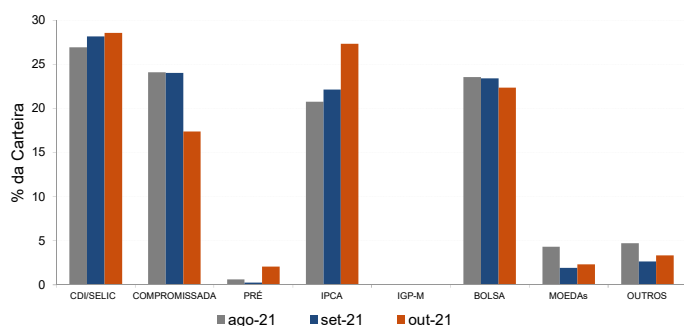
### Distribuição da Carteira

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.

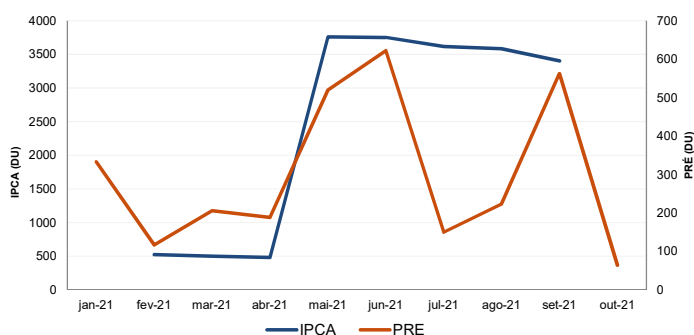
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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	32.751,01	8,94	34.798,62	9,17
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	29.067,14	7,93	25.249,22	6,65
ITSA4	Intermediários Financeiros	15.268,03	4,17	16.358,30	4,31
EQTL3	Energia Elétrica	13.576,92	3,71	12.428,48	3,27
ITUB4	Intermediários Financeiros	12.868,78	3,51	13.901,67	3,66
GNDI3	Análises e Diagnósticos	11.833,33	3,23	12.391,80	3,26
SUZB3	Madeira e Papel	9.317,01	2,54	7.319,18	1,93
ABEV3	Bebidas	9.101,95	2,48	7.121,42	1,88
VBBR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	8.910,27	2,43	0,00	
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	7.846,93	2,14	8.075,99	2,13

\* em mil R\$

#### Liquidez da Carteira de Ações

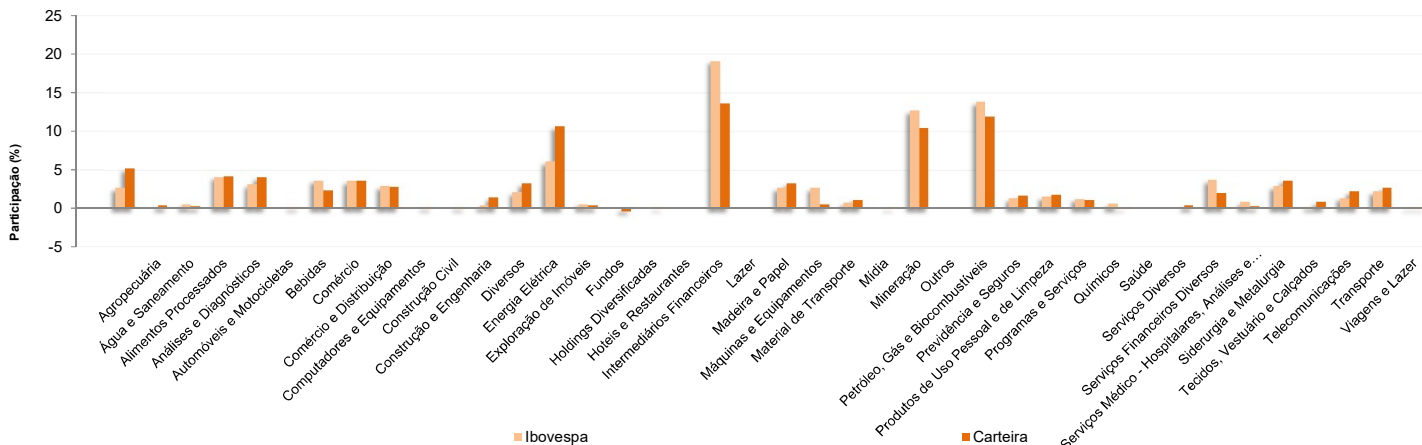
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BIME11	9,96	0,00	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	73,71	0,02	0,07	52
HBRE3	704,52	0,19	0,24	16
MTSA4	336,85	0,09	0,25	11
EMAE4	112,25	0,03	0,01	4
LAND3	704,82	0,19	0,11	3
SCAR3	210,99	0,06	0,02	3
CLSC4	72,45	0,02	0,00	3
EALT4	71,47	0,02	0,09	3
BEES3	33,60	0,01	0,06	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.



ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 29/10/2021

## Análises de Contrapartes

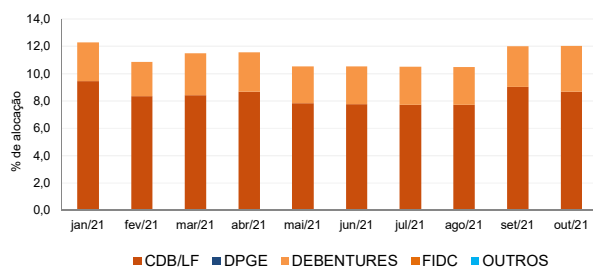
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	91.369,23	5,75	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	37.650,10	2,37	Faixa 2
VALE SA	32.751,01	2,06	Faixa 1
BCO SAFRA SA	24.903,99	1,57	Faixa 1
ITAUSA INVESTS ITAU SA	18.795,61	1,18	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	18.016,97	1,13	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	13.576,92	0,86	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	12.869,33	0,81	Faixa 1
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	11.833,33	0,75	Sem Faixa
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	10.128,89	0,64	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
MGLUA0	5.085,17	MAGAZINE LUIZA SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-26	CDI	1,25%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	650,04	MAGAZINE LUIZA SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-26	CDI	1,25%	URCA FI MULT CRED PRIV

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

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	152.548	0,01%	CDI	CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÃO	14-out-21	3,00%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
ENGIB5	15-out-26	2.396.599	0,15%	CDI	ENERGISA SA	29-out-21	1,64%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
ITSA14	15-jun-27	628.199	0,04%	CDI	ITAUSA INVESTS ITAU SA	18-out-21	1,25%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	15-out-26	5.085.173	0,32%	CDI	MAGAZINE LUIZA SA	15-out-21	1,25%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	15-out-26	650.039	0,04%	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	4.967.205	0,31%	Selic		29-out-21	0,11%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	26.256.718	1,65%	IPCA		21-out-21	5,04%	5,12%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	26.256.718	1,65%	IPCA		25-out-21	5,42%	5,33%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	26.256.718	1,65%	IPCA		21-out-21	5,06%	5,12%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	4.621.182	0,29%	IPCA		29-out-21	5,63%	5,46%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	3.413.373	0,21%	IPCA		26-out-21	5,38%	5,44%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	367.594	0,02%	IPCA		29-out-21	5,63%	5,46%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F

