

ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

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	181.190.931,66	47,86%				-1,18%	-1,85%	-0,88%	-1,90%	1,22%	7,21%	13,92%	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	105.705.647,15	27,92%											
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	105.705.647,15	27,92%		100%	3,63%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
RF REFERENCIADO DI	75.485.284,51	19,94%											
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	43.304.667,00	11,44%	ALFA	5,07%	0,02%	0,49%	1,41%	2,49%	3,12%	3,62%	6,66%	13,26%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	7.015.420,87	1,85%	BRADESCO	5,26%	0,00%	0,47%	1,33%	2,25%	2,93%	3,24%	6,48%	13,02%	
URCA FI MULT CRED PRIV	25.165.196,64	6,65%	SANTANDER	5,02%	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	120.029.407,49	31,70%				-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	58.039.484,37	15,33%											
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	36.704.579,62	9,69%	SHARP	9,55%	6,59%	-7,01%	-14,99%	-13,80%	-11,87%	11,04%	3,43%	35,29%	
FIA SAO CONRADO	2.856.415,90	0,75%	EQUITAS	9,55%	9,39%	-15,69%	-24,90%	-21,85%	-20,69%	-2,89%	-20,34%	1,77%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	14.080.386,98	3,72%	CONSTANCIA	9,55%	5,40%	-6,80%	-13,65%	-13,83%	-7,04%	11,43%	1,64%	-	
FIA PIPA	2.197.147,78	0,58%	XP	9,55%	4,84%	-8,33%	-19,54%	-15,76%	-15,35%	-0,20%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	2.200.954,08	0,58%	CONSTELLATION	9,55%	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%	
CARTEIRA PRÓPRIA RV	26.333.456,68	6,96%											
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	26.333.456,68	6,96%		100%	6,45%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-6,81%	-16,15%	-14,19%	-12,40%	10,40%	-1,79%	22,56%	
RV VALOR	16.736.671,87	4,42%											
VINCI JOATINGA FIA	14.033.400,07	3,71%	VINCI	9,55%	5,80%	-8,54%	-16,56%	-16,56%	-15,27%	4,74%	0,57%	-	
FIA ITACOATIARA	2.703.271,80	0,71%	INDIE CAPITAL	9,55%	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%	
RV SMALL CAP	14.203.725,91	3,75%											
GRUMARI FIA	14.203.725,91	3,75%	AZ QUEST	9,55%	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%	
RV PASSIVO	4.716.068,66	1,25%											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	4.716.068,66	1,25%	BLACKROCK	0,03%	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	25.879.579,32	6,84%											
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					1,93%	5,77%	11,18%	17,33%	22,10%	40,61%	58,62%	
MM MACRO	17.242.359,02	4,55%											
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	4.826.657,68	1,27%	QUANTITAS	1,93%		-1,33%	-0,79%	1,20%	3,06%	4,35%	13,80%	20,74%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	1.799.517,62	0,48%	OCCAM	0,10%	1,28%	1,63%	2,33%	2,59%	4,26%	5,23%	13,52%	31,97%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	7.123.845,57	1,88%	OCCAM	0,29%	1,28%	1,63%	2,34%	2,60%	4,29%	5,23%	-	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	1.653.349,75	0,44%	PACIFICO	0,51%	1,85%	-0,82%	-2,52%	-2,57%	-3,64%	0,30%	0,71%	11,41%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	1.838.988,40	0,49%	ZEITGEIST	0,10%	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	8.637.220,30	2,28%											
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	8.637.220,30	2,28%	KONDOR	1,97%	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%	
Exterior	17.903.983,79	4,73%											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					9,54%	13,97%	12,82%	28,15%	35,37%	100,32%	138,32%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17.903.983,79	4,73%											
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	17.903.983,79	4,73%	BLACKROCK	0,29%	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 **	11.981.884,32	3,16%											
Benchmark:	INPC + 5,97% a.a.					1,63%	4,78%	9,10%	13,77%	17,66%	30,57%	41,90%	
Imobiliário **	21.618.970,84	5,71%											
Benchmark:	INPC					1,16%	3,27%	5,96%	8,45%	11,08%	16,38%	19,35%	
Total	378.604.757,42	100%				2,84%	-2,89%	-6,39%	-4,99%	-3,71%	5,75%	14,84%	27,75%
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.

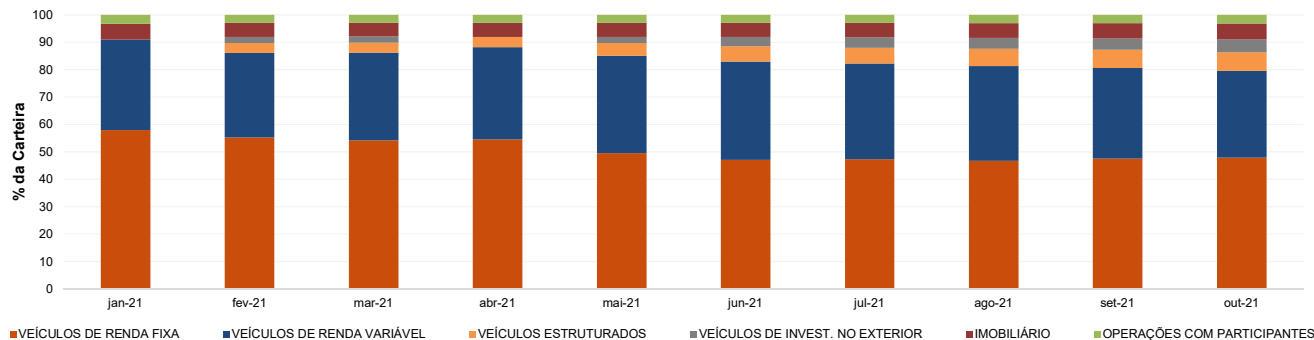
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

A ADITUS não se responsabiliza pela utilização das informações aqui contidas para outras finalidades que não sejam meramente informativas.

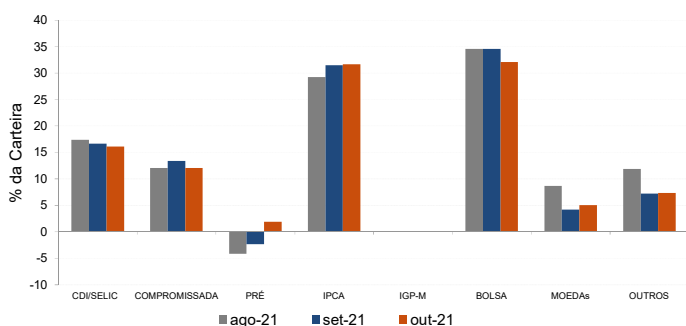
Distribuição da Carteira

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.

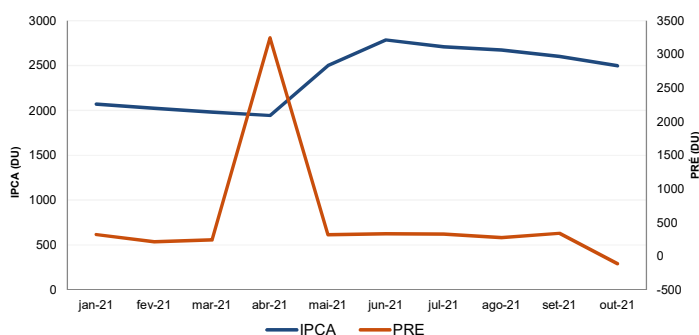
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	10.215,88	8,87	11.289,77	9,07
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	9.244,62	8,03	8.489,57	6,82
ITSA4	Intermediários Financeiros	4.772,49	4,14	5.309,51	4,27
EQTL3	Energia Elétrica	4.380,94	3,80	4.264,85	3,43
ITUB4	Intermediários Financeiros	4.042,55	3,51	4.556,98	3,66
GNDI3	Análises e Diagnósticos	3.782,11	3,28	4.185,35	3,36
SUZB3	Madeira e Papel	2.905,48	2,52	2.368,09	1,90
ABEV3	Bebidas	2.905,25	2,52	2.387,61	1,92
VBBR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	2.890,07	2,51	0,00	
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	2.442,02	2,12	2.612,78	2,10

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

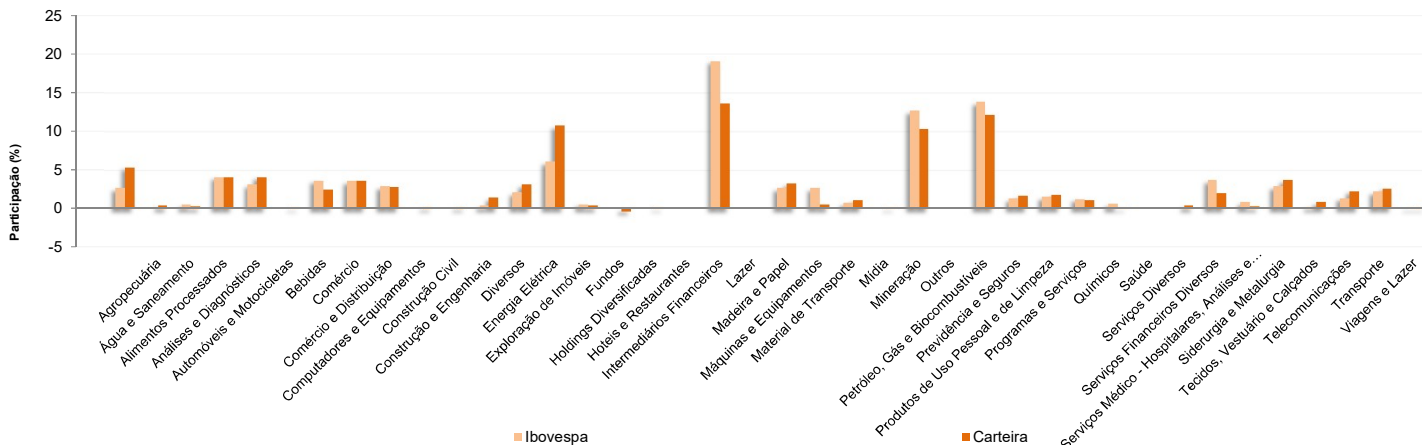
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BIME11	4,22	0,00	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	23,04	0,02	0,02	17
HBRE3	220,20	0,19	0,07	5
MTSA4	105,28	0,09	0,08	4
VALE3	10.215,88	8,87	0,00	1
PETRA4	9.244,62	8,03	0,01	1
ITSA4	4.772,49	4,14	0,01	1
EQTL3	4.380,94	3,80	0,02	1
ITUB4	4.042,55	3,51	0,00	1
GNDI3	3.782,11	3,28	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.



Análises de Contrapartes

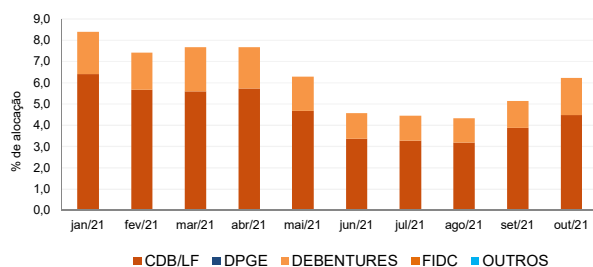
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	11.738,33	3,39	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	11.125,10	3,22	Faixa 2
VALE SA	10.215,88	2,95	Faixa 1
ITAUSA INVESTS ITAU SA	5.170,19	1,49	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	4.380,94	1,27	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4.042,78	1,17	Faixa 1
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	3.782,11	1,09	Sem Faixa
SUZANO PAPEL CELULOSE SA	2.905,48	0,84	Faixa 1
AMBEV S.A	2.905,25	0,84	Faixa 1
VIBRA ENERGIA SA	2.890,07	0,84	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	573,31	MAGAZINE LUIZA SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-26	CDI	1,25%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	73,29	MAGAZINE LUIZA SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-26	CDI	1,25%	URCA FI MULT CRED PRIV

ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

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	17.198	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	270.196	0,08%	CDI	ENERGISA SA	29-out-21	1,64%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
ITSA14	15-jun-27	70.824	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	573.309	0,17%	CDI	MAGAZINE LUIZA SA	15-out-21	1,25%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	15-out-26	73.286	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	560.009	0,16%	Selic		29-out-21	0,11%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

