

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	474.061.229,13	65,53%				-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%	
RF REFERENCIADO DI	282.347.328,40	39,03%											
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	161.978.021,47	22,39%	ALFA	18,95%	0,02%	0,49%	1,41%	2,49%	3,12%	3,62%	6,66%	13,26%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	26.240.681,91	3,63%	BRADESCO	19,69%	0,00%	0,47%	1,33%	2,25%	2,93%	3,24%	6,48%	13,02%	
URCA FI MULT CRED PRIV	94.128.625,02	13,01%	SANTANDER	18,79%	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%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	191.713.900,73	26,50%											
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RF	191.713.900,73	26,50%		100%	3,70%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
Renda Variável	183.948.662,20	25,43%				-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	88.947.248,24	12,30%											
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	56.250.867,68	7,78%	SHARP	14,63%	6,59%	-7,01%	-14,99%	-13,80%	-11,87%	11,04%	3,43%	35,29%	
FIA SAO CONRADO	4.377.542,92	0,61%	EQUITAS	14,63%	9,39%	-15,69%	-24,90%	-21,85%	-20,69%	-2,89%	-20,34%	1,77%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	21.578.614,80	2,98%	CONSTANCIA	14,63%	5,40%	-6,80%	-13,65%	-13,83%	-7,04%	11,43%	1,64%	-	
FIA PIPA	3.367.194,78	0,47%	XP	14,63%	4,84%	-8,33%	-19,54%	-15,76%	-15,35%	-0,20%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	3.373.028,06	0,47%	CONSTELLATION	14,63%	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	40.356.811,13	5,58%											
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RV	40.356.811,13	5,58%		100%	6,45%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-6,81%	-16,15%	-14,19%	-12,40%	10,40%	-1,79%	22,56%	
RV VALOR	25.649.450,95	3,55%											
VINCI JOATINGA FIA	21.506.605,95	2,97%	VINCI	14,63%	5,80%	-8,54%	-16,56%	-16,56%	-15,27%	4,74%	0,57%	-	
FIA ITACOATIARA	4.142.845,00	0,57%	INDIE CAPITAL	14,63%	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	21.767.635,40	3,01%											
GRUMARI FIA	21.767.635,40	3,01%	AZ QUEST	14,63%	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	7.227.516,48	1,00%											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	7.227.516,48	1,00%	BLACKROCK	0,04%	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	35.300.601,55	4,88%											
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					1,93%	5,77%	11,18%	17,33%	22,10%	40,61%	58,62%	
MM MACRO	23.519.147,59	3,25%											
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	6.583.720,61	0,91%	QUANTITAS	2,63%		-1,33%	-0,79%	1,20%	3,06%	4,35%	13,80%	20,74%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.454.601,51	0,34%	OCCAM	0,13%	1,28%	1,63%	2,33%	2,59%	4,26%	5,23%	13,52%	31,97%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	9.717.160,81	1,34%	OCCAM	0,39%	1,28%	1,63%	2,34%	2,60%	4,29%	5,23%	-	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.255.223,70	0,31%	PACIFICO	0,70%	1,85%	-0,82%	-2,52%	-2,57%	-3,64%	0,30%	0,71%	11,41%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	2.508.440,96	0,35%	ZEITGEIST	0,14%	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	11.781.453,96	1,63%											
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	11.781.453,96	1,63%	KONDOR	2,68%	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	17.063.109,24	2,36%											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					9,54%	13,97%	12,82%	28,15%	35,37%	100,32%	138,32%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17.063.109,24	2,36%											
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	17.063.109,24	2,36%	BLACKROCK	0,27%	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 **	13.026.344,86	1,80%											
Benchmark:	INPC + 5,97% a.a.					1,63%	4,78%	9,10%	13,77%	17,66%	30,57%	41,90%	
Total	723.399.946,98	100%				2,29%	-2,48%	-5,20%	-3,72%	-3,52%	4,52%	5,47%	17,04%
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.

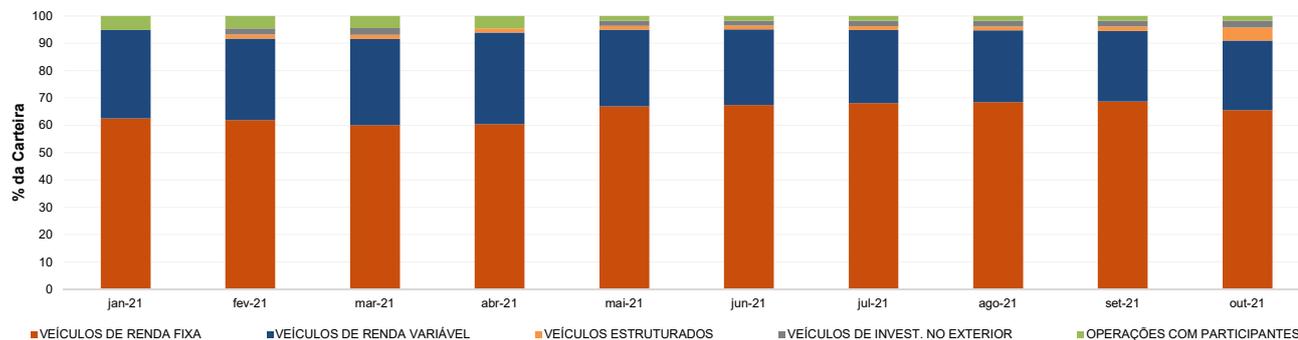
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

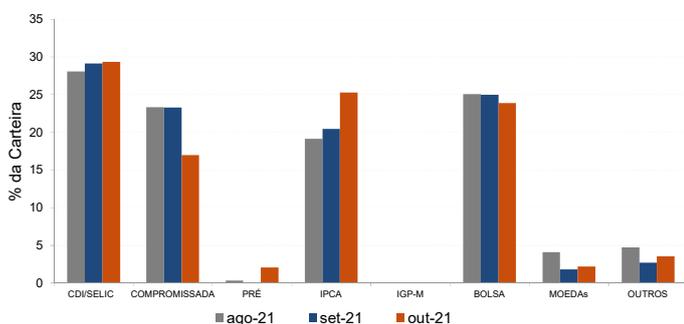
Distribuição da Carteira

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.

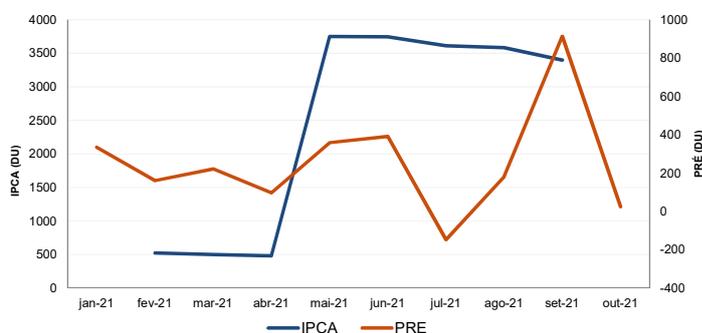
Evolução do Patrimônio Líquido



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	15.669,31	8,90	16.659,25	9,16
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	14.065,51	7,99	12.118,53	6,66
ITSA4	Intermediários Financeiros	7.313,72	4,15	7.831,50	4,31
EQTL3	Energia Elétrica	6.625,96	3,76	5.974,05	3,28
ITUB4	Intermediários Financeiros	6.182,29	3,51	6.660,05	3,66
GNDI3	Análises e Diagnósticos	5.742,71	3,26	5.949,48	3,27
SUZB3	Madeira e Papel	4.456,96	2,53	3.503,26	1,93
ABEV3	Bebidas	4.413,72	2,51	3.417,26	1,88
VBBR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	4.361,82	2,48	0,00	
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	3.749,23	2,13	3.865,48	2,13

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

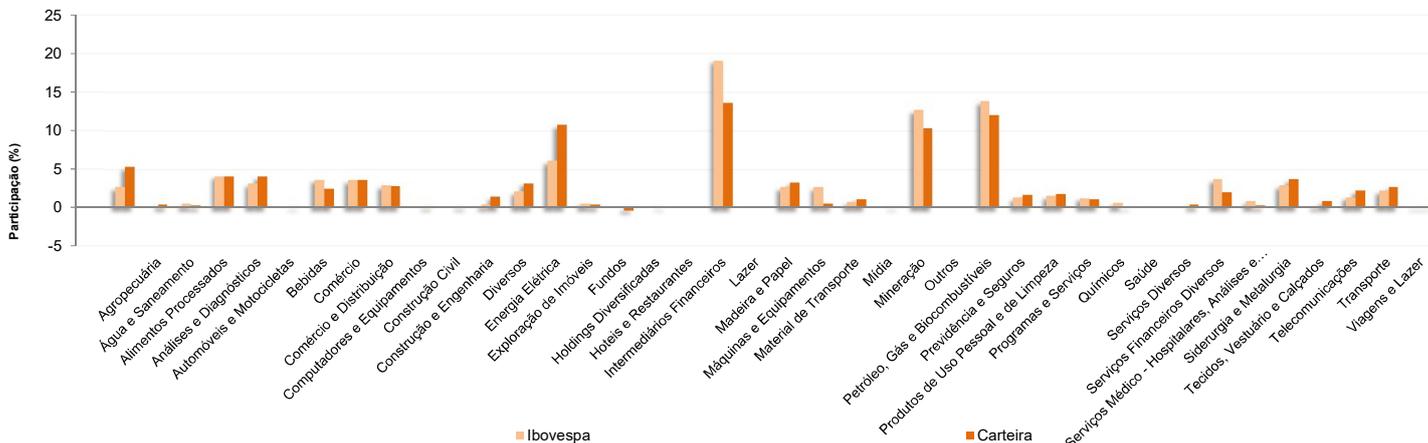
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BIME11	5,76	0,00	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	35,31	0,02	0,03	25
HBRE3	337,46	0,19	0,11	8
MTSA4	161,35	0,09	0,12	5
LAND3	337,61	0,19	0,05	2
SCAR3	101,06	0,06	0,01	2
EMAE4	53,77	0,03	0,00	2
CLSC4	34,70	0,02	0,00	2
EALT4	34,23	0,02	0,04	2
BEEES3	16,09	0,01	0,03	2

* 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.



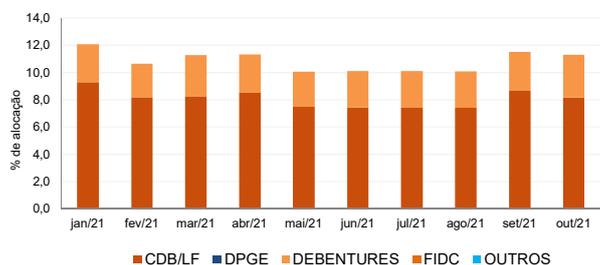
Análises de Contrapartes

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	38.947,79	5,47	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	18.020,66	2,53	Faixa 2
VALE SA	15.669,31	2,20	Faixa 1
BCO SAFRA SA	10.502,03	1,47	Faixa 1
ITAUSA INVESTS ITAU SA	8.801,30	1,24	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	7.597,77	1,07	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	6.625,96	0,93	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	6.182,61	0,87	Faixa 1
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	5.742,71	0,81	Sem Faixa
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	4.649,48	0,65	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	2.144,42	MAGAZINE LUIZA SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-26	CDI	1,25%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	274,12	MAGAZINE LUIZA SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-26	CDI	1,25%	URCA FI MULT CRED PRIV

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	64.329	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	1.010.648	0,14%	CDI	ENERGISA SA	29-out-21	1,64%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
ITSA14	15-jun-27	264.912	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	2.144.422	0,30%	CDI	MAGAZINE LUIZA SA	15-out-21	1,25%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	15-out-26	274.122	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	2.094.675	0,29%	Selic		29-out-21	0,11%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	10.935.348	1,54%	IPCA		21-out-21	5,04%	5,12%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	10.935.348	1,54%	IPCA		25-out-21	5,42%	5,33%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	10.935.348	1,54%	IPCA		21-out-21	5,06%	5,12%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.924.621	0,27%	IPCA		29-out-21	5,63%	5,46%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.421.595	0,20%	IPCA		26-out-21	5,38%	5,44%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	153.095	0,02%	IPCA		29-out-21	5,63%	5,46%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F

