

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 29/04/2022

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	1.187.548.484,09	68,76%				0,33%	3,23%	5,17%	2,79%	4,24%	8,57%	15,74%	
Benchmark:	CDI					0,83%	2,53%	4,68%	3,28%	7,08%	9,38%	15,07%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	689.773.360,57	39,94%											
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	689.773.360,57	39,94%		100%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					0,83%	2,53%	4,68%	3,28%	7,08%	9,38%	15,07%	
RF REFERENCIADO DI	497.775.123,52	28,82%											
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	329.620.190,01	19,09%	ALFA	41,94%		0,81%	2,89%	5,33%	3,72%	7,95%	10,37%	15,77%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	9.059.217,91	0,52%	BRADESCO	43,50%		0,82%	2,48%	4,57%	3,22%	6,93%	9,13%	14,73%	
URCA FI MULT CRED PRIV	159.095.715,59	9,21%	SANTANDER	40,99%		0,77%	2,64%	5,19%	3,60%	7,29%	9,93%	15,22%	
Benchmark:	CDI					0,83%	2,53%	4,68%	3,28%	7,08%	9,38%	15,07%	
Renda Variável	344.792.738,57	19,96%				-8,19%	-2,58%	4,58%	3,45%	-10,77%	32,61%	17,31%	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					-9,98%	-2,91%	5,73%	3,93%	-8,36%	41,35%	22,39%	
RV ATIVO	185.925.980,14	10,77%											
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	120.441.256,40	6,97%	SHARP	29,26%		-8,20%	-1,01%	7,05%	6,47%	-7,72%	41,94%	26,86%	
FIA SAO CONRADO	8.025.883,70	0,46%	EQUITAS	29,26%		-11,64%	-9,99%	-8,33%	-2,17%	-28,36%	-0,76%	-15,69%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	44.237.527,11	2,56%	CONSTANCIA	29,26%		-3,72%	2,59%	9,44%	6,39%	-5,70%	33,22%	-	
FIA PIPA	7.510.782,08	0,43%	XP	29,26%		-3,42%	2,87%	11,52%	8,89%	-6,06%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	5.710.530,86	0,33%	CONSTELLATION	29,26%		-12,27%	-8,21%	-15,35%	-7,71%	-30,78%	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA					-10,10%	-3,81%	4,23%	2,91%	-9,27%	34,00%	11,96%	
CARTEIRA PRÓPRIA RV	70.764.521,24	4,10%											
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RV	70.764.521,24	4,10%		100%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					-10,11%	-3,37%	4,71%	3,27%	-10,15%	35,89%	15,35%	
RV VALOR	44.922.507,20	2,60%											
VINCI JOATINGA FIA	37.746.718,98	2,19%	VINCI	29,26%		-9,23%	-6,04%	4,85%	0,88%	-12,51%	27,70%	-	
FIA ITACOATIARA	7.175.788,22	0,42%	INDIE CAPITAL	29,26%		-11,16%	-14,81%	-13,40%	-11,38%	-31,77%	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA					-10,10%	-3,81%	4,23%	2,91%	-9,27%	34,00%	11,96%	
RV SMALL CAP	39.910.075,64	2,31%											
GRUMARI FIA	39.910.075,64	2,31%	AZ QUEST	29,26%		-5,67%	-2,26%	-1,78%	0,35%	-14,58%	27,34%	23,61%	
Benchmark:	SMLL					-8,36%	-5,46%	-0,84%	-2,23%	-20,81%	23,46%	17,79%	
RV PASSIVO	3.269.654,34	0,19%											
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	3.269.654,34	0,19%	BLACKROCK	0,02%		-10,55%	-4,24%	3,73%	2,58%	-9,62%	33,33%	11,32%	
Benchmark:	IBOVESPA					-10,10%	-3,81%	4,23%	2,91%	-9,27%	34,00%	11,96%	
Estruturado	62.878.280,47	3,64%											
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					1,77%	6,18%	11,23%	7,74%	23,67%	46,25%	64,89%	
MM MACRO	41.833.672,65	2,42%											
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	12.179.244,44	0,71%	QUANTITAS	5,56%		1,40%	4,38%	9,89%	8,45%	11,22%	17,07%	27,96%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	4.283.642,98	0,25%	OCCAM	0,25%		2,35%	3,85%	3,67%	4,57%	6,35%	15,14%	30,67%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	16.958.284,40	0,98%	OCCAM	0,87%		2,37%	3,86%	3,67%	4,58%	6,37%	15,17%	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	3.934.604,19	0,23%	PACIFICO	2,36%		-0,18%	1,69%	3,64%	1,85%	0,98%	3,30%	11,48%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	4.477.896,64	0,26%	ZEITGEIST	0,22%		0,39%	6,10%	6,05%	6,48%	17,10%	16,69%	43,69%	
Benchmark:	CDI					0,83%	2,53%	4,68%	3,28%	7,08%	9,38%	15,07%	
MM LONG-SHORT	21.044.607,83	1,22%											
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	21.044.607,83	1,22%	KONDOR	4,47%		2,45%	2,03%	6,11%	3,09%	10,15%	11,65%	-	
Benchmark:	CDI					0,83%	2,53%	4,68%	3,28%	7,08%	9,38%	15,07%	
Exterior	43.244.252,70	2,50%											
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					-4,93%	-16,09%	-23,24%	-23,75%	-13,40%	23,44%	59,99%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	43.244.252,70	2,50%											
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	43.244.252,70	2,50%	BLACKROCK	1,16%		-4,90%	-13,94%	-20,81%	-23,66%	-9,27%	32,13%	81,29%	
Benchmark:	MSCIWBRL					-4,93%	-16,09%	-23,24%	-23,75%	-13,40%	23,44%	59,99%	
Operações com Participantes	35.505.455,16	2,06%											
Benchmark:	INPC + 8,68% a.a.					1,68%	5,87%	10,58%	7,32%	22,19%	42,78%	59,04%	
Imobiliário	53.120.387,52	3,08%											
Benchmark:	INPC					1,04%	3,80%	6,14%	4,49%	12,47%	21,00%	23,98%	
Total	1.727.089.598,51	100%				2,83%	-1,54%	1,51%	4,47%	2,44%	10,02%	14,92%	16,69%
Benchmark:	INPC + 4,8% a.a.					1,40%	4,96%	8,61%	6,08%	17,84%	32,82%	42,65%	

* 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.

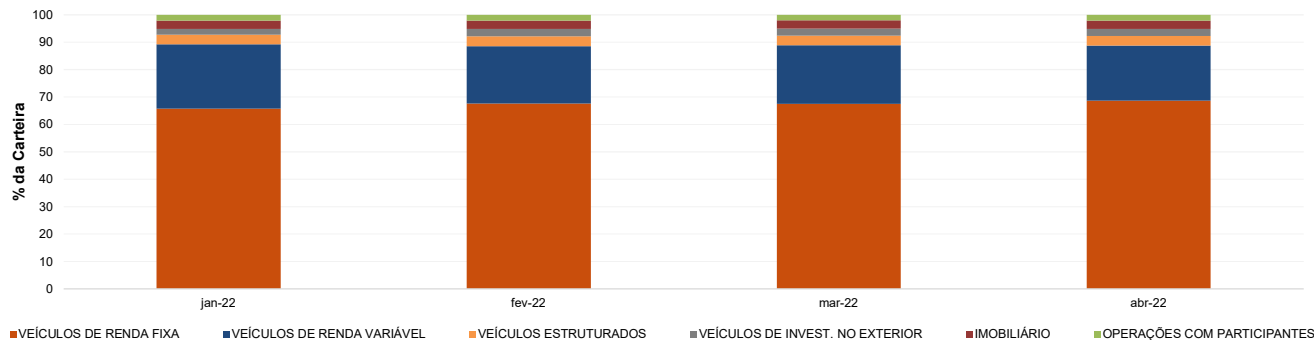
ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 29/04/2022

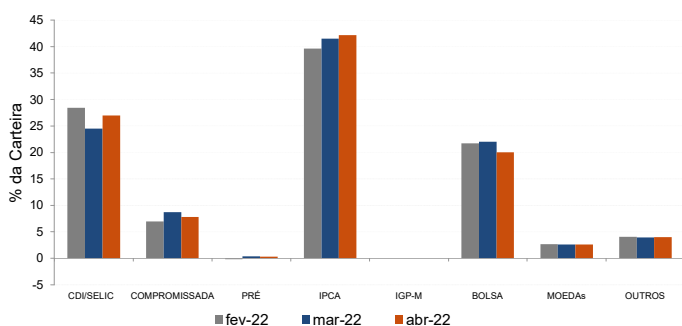
Distribuição da Carteira

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.

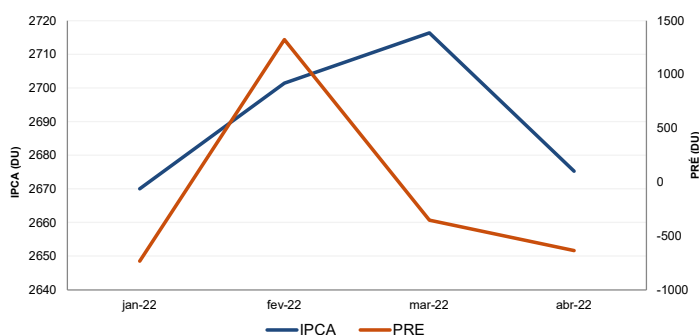
Evolução do Patrimônio Líquido



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	40.967,58	12,26	46.499,85	12,58
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	29.758,52	8,90	30.920,27	8,36
EQTL3	Energia Elétrica	16.850,56	5,04	18.366,35	4,97
BPAC11	Intermediários Financeiros	13.800,39	4,13	16.200,05	4,38
ITSA4	Intermediários Financeiros	12.643,08	3,78	14.259,74	3,86
ITUB4	Intermediários Financeiros	11.620,31	3,48	13.055,03	3,53
VBBR3	Energia Elétrica	8.455,91	2,53	9.971,40	2,70
HAPV3	Análises e Diagnósticos	7.541,77	2,26	10.235,44	2,77
BBAS3	Intermediários Financeiros	7.276,85	2,18	6.283,41	1,70
B3SA3	Serviços Financeiros Diversos	7.254,35	2,17	8.595,54	2,32

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

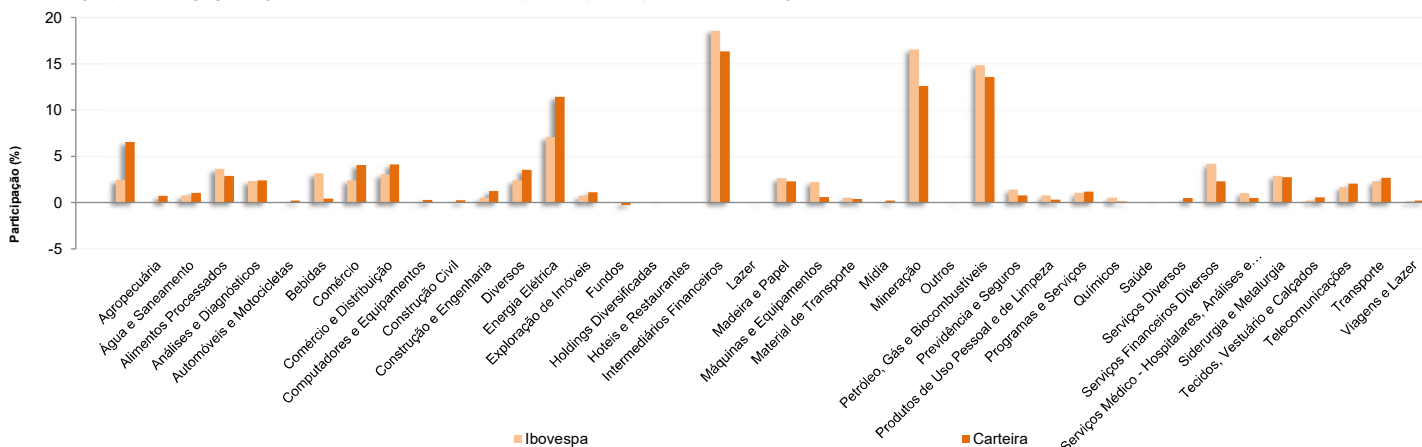
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
AFHI12	0,00	0,00	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	62,79	0,02	0,07	58
MTSA4	251,66	0,08	0,19	23
HBRE3	420,52	0,13	0,26	8
LAND3	622,82	0,19	0,07	5
SCAR3	175,81	0,05	0,02	5
COCE5	445,93	0,13	0,04	3
FIQE3	750,55	0,22	0,15	2
ELMD3	702,95	0,21	0,11	2
TFCO4	443,08	0,13	0,07	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.



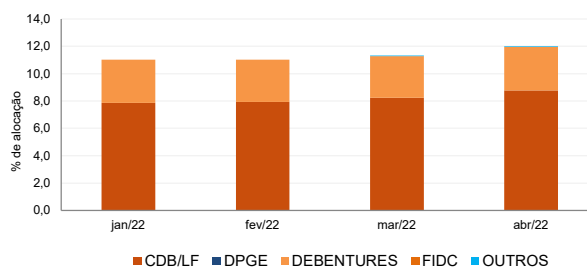
Análises de Contrapartes

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	90.169,32	5,51	Faixa 1
VALE SA	40.967,58	2,50	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	36.117,09	2,21	Faixa 2
BCO SAFRA SA	23.136,36	1,41	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	18.401,16	1,12	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	16.850,56	1,03	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	13.800,39	0,84	Faixa 2
ITAUSA INVESTS ITAU SA	12.643,08	0,77	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	11.620,48	0,71	Faixa 1
BCO ITAU SA	11.594,81	0,71	Faixa 1

* 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 CD PURO

Data-base: 29/04/2022

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
ASAI14	26-nov-27	2.251.373	0,14%	CDI	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	13-abr-22	1,67%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LF CDI	26-abr-27	3.080.856	0,19%	CDI	BCO BRADESCO SA	25-abr-22	2,25%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
RDORB9	20-ago-31	2.318.881	0,14%	CDI	REDE D OR SAO LUIZ SA	08-abr-22	1,84%	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 2025-09-01	01-set-25	3.388.680	0,21%	Selic		13-abr-22	0,11%	0,11%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	3.369.316	0,21%	Selic		13-abr-22	0,11%	0,11%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	3.369.316	0,21%	Selic		13-abr-22	0,11%	0,11%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.055.332	0,06%	Selic		13-abr-22	0,11%	0,11%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	968.194	0,06%	Selic		07-abr-22	0,10%	0,10%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	634.167	0,04%	Selic		13-abr-22	0,11%	0,11%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

