

ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 29/07/2022

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	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	963.858.489,58	56,23%			-0,14%	1,03%	5,65%	7,95%	4,63%	22,20%	52,64%
Benchmark:	CDI				1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	758.225.860,12	44,23%									
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	758.225.860,12	44,23%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
RF REFERENCIADO DI	205.632.629,45	12,00%									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	130.894.890,35	7,64%	ALFA	18,19%	1,19%	3,41%	6,40%	7,25%	10,46%	13,20%	17,85%
BRANCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	4.021.618,12	0,23%	BRANCO	18,74%	1,01%	3,06%	5,62%	6,38%	9,20%	11,77%	16,41%
URCA FI MULT CRED PRIV	70.716.120,98	4,13%	SANTANDER	17,71%	1,08%	3,19%	5,91%	6,91%	9,59%	12,12%	16,99%
Benchmark:	CDI				1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
Renda Variável	417.843.377,94	24,38%			4,96%	-4,03%	-6,54%	-0,72%	-15,74%	-0,52%	-2,98%
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				4,57%	-4,21%	-7,00%	-0,45%	-14,65%	5,08%	9,52%
RV ATIVO	226.838.802,86	13,23%									
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	148.570.398,99	8,67%	SHARP	36,55%	5,51%	-1,23%	-2,23%	5,16%	-10,11%	8,19%	17,08%
FIA SAO CONRADO	8.881.232,12	0,52%	EQUITAS	36,55%	6,75%	-11,40%	-20,25%	-13,32%	-39,00%	-28,05%	-31,16%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	52.985.287,41	3,09%	CONSTANCIA	36,55%	4,90%	-4,10%	-1,61%	2,03%	-9,37%	3,64%	11,33%
FIA PIPA	9.568.492,52	0,56%	XP	36,55%	6,33%	2,01%	4,93%	11,08%	-8,46%	-	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	6.833.391,82	0,40%	CONSTELLATION	36,55%	7,80%	-4,19%	-12,05%	-11,57%	-35,50%	-	-
Benchmark:	IBOVESPA				4,69%	-4,37%	-8,01%	-1,58%	-15,30%	0,25%	1,33%
CARTEIRA PRÓPRIA RV	81.710.786,54	4,77%									
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	81.710.786,54	4,77%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				4,40%	-4,69%	-7,90%	-1,57%	-16,32%	1,03%	3,22%
RV VALOR	49.469.345,65	2,89%									
VINCI JOATINGA FIA	41.355.187,72	2,41%	VINCI	36,55%	4,64%	-5,23%	-10,95%	-4,40%	-17,09%	-5,37%	5,91%
FIA ITACOATIARA	8.114.157,93	0,47%	INDIE CAPITAL	36,55%	4,23%	-9,46%	-22,87%	-19,77%	-41,52%	-29,40%	-
Benchmark:	IBOVESPA				4,69%	-4,37%	-8,01%	-1,58%	-15,30%	0,25%	1,33%
RV SMALL CAP	42.251.926,26	2,46%									
GRUMARI FIA	42.251.926,26	2,46%	AZ QUEST	36,55%	3,80%	-7,79%	-9,87%	-7,47%	-22,60%	-10,39%	-0,28%
Benchmark:	SMLL				5,16%	-13,62%	-18,34%	-15,55%	-32,57%	-19,00%	-12,63%
RV PASSIVO	17.572.516,62	1,03%									
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	17.572.516,62	1,03%	BLACKROCK	0,13%	4,53%	-3,97%	-8,04%	-1,49%	-15,21%	0,01%	1,25%
Benchmark:	IBOVESPA				4,69%	-4,37%	-8,01%	-1,58%	-15,30%	0,25%	1,33%
Estruturado	58.881.137,69	3,44%			0,11%	2,22%	4,87%	5,99%	6,62%	19,48%	37,69%
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				0,19%	2,93%	9,29%	10,90%	21,09%	46,21%	65,23%
MM MACRO	32.465.187,72	1,89%									
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	8.043.323,24	0,47%	QUANTITAS	3,81%	1,60%	4,12%	8,68%	12,92%	13,52%	21,26%	30,66%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.773.528,69	0,16%	OCCAM	0,18%	0,03%	2,08%	6,00%	6,75%	8,29%	12,18%	24,81%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	10.979.689,93	0,64%	OCCAM	0,61%	0,03%	2,08%	6,01%	6,75%	8,30%	12,17%	-
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.512.152,17	0,15%	PACIFICO	1,78%	0,87%	0,66%	2,37%	2,52%	1,70%	1,56%	7,95%
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	8.156.493,70	0,48%	ZEITGEIST	0,42%	-0,79%	1,03%	7,19%	7,57%	13,70%	16,16%	34,23%
Benchmark:	CDI				1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
MM LONG-SHORT	14.118.339,90	0,82%									
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	14.118.339,90	0,82%	NAVI CAPITAL	2,83%	-0,17%	5,77%	7,92%	9,04%	12,33%	16,03%	23,09%
Benchmark:	CDI				1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
FIP	12.297.610,07	0,72%									
SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES	12.297.610,07	0,72%	SIGNAL CAPITAL	10,28%	0,01%	-1,62%	-1,70%	-1,62%	-21,43%	-38,07%	-29,01%
Benchmark:	IPCA				-0,68%	0,46%	4,21%	4,77%	10,07%	19,97%	22,74%
Exterior	44.874.222,11	2,62%			8,21%	4,74%	-10,13%	-20,29%	-6,53%	23,02%	
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				6,84%	3,62%	-13,05%	-20,99%	-9,35%	18,81%	73,01%
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	44.874.222,11	2,62%									
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	44.874.222,11	2,62%	BLACKROCK	1,43%	8,21%	4,64%	-9,95%	-20,12%	-6,33%	27,67%	95,90%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				6,84%	3,62%	-13,05%	-20,99%	-9,35%	18,81%	73,01%
Operações com Participantes **	68.215.961,57	3,98%			1,65%	6,21%	10,60%	12,22%	20,99%	40,51%	
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				0,09%	2,61%	8,64%	10,13%	19,64%	42,75%	59,37%
Imobiliário **	160.428.431,87	9,36%			0,65%	1,56%	2,62%	3,09%	7,73%	32,52%	
Benchmark:	INPC				-0,60%	0,47%	4,28%	4,98%	10,12%	20,98%	24,23%
Total	1.714.101.620,76	100%			2,43%	1,41%	0,14%	1,95%	4,57%	-0,49%	17,36%
Benchmark:	INPC + 4.5% a.a.				-0,23%	1,60%	6,56%	7,67%	15,06%	32,04%	41,72%

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

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 30/06/2022

* 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.

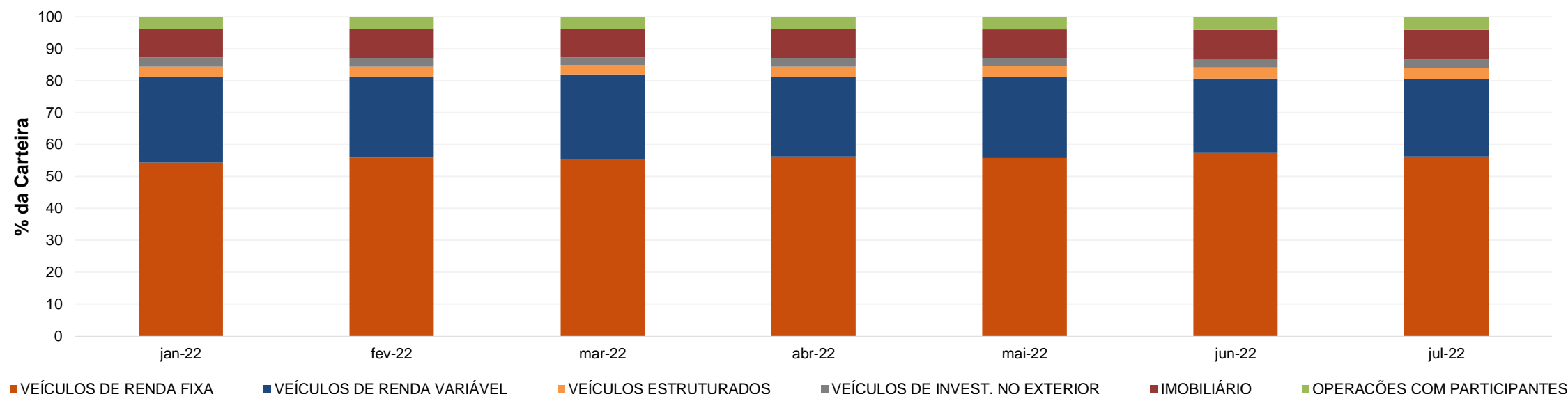
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

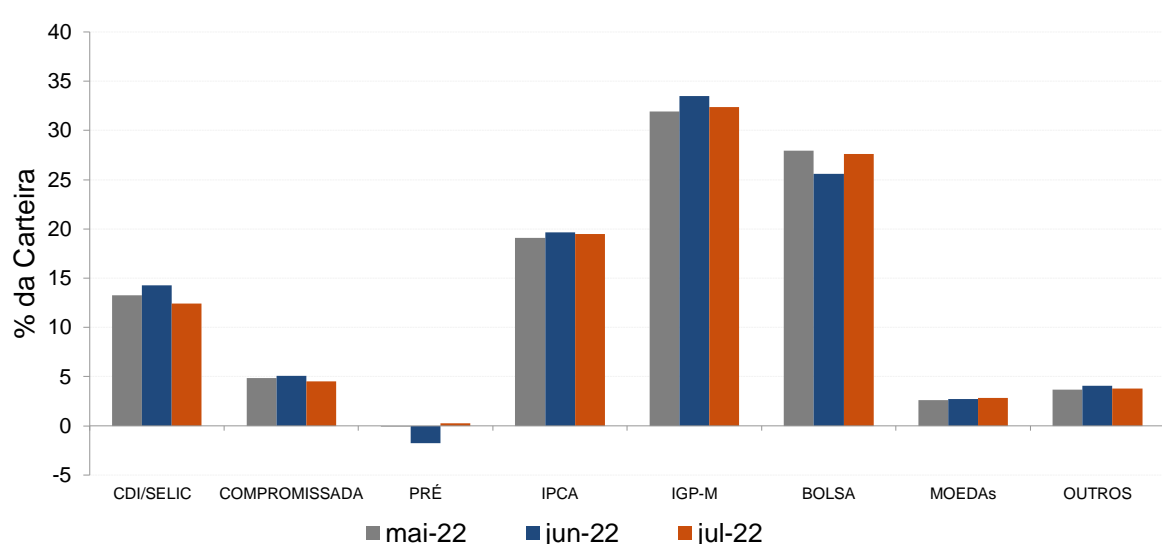
Distribuição da Carteira

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.

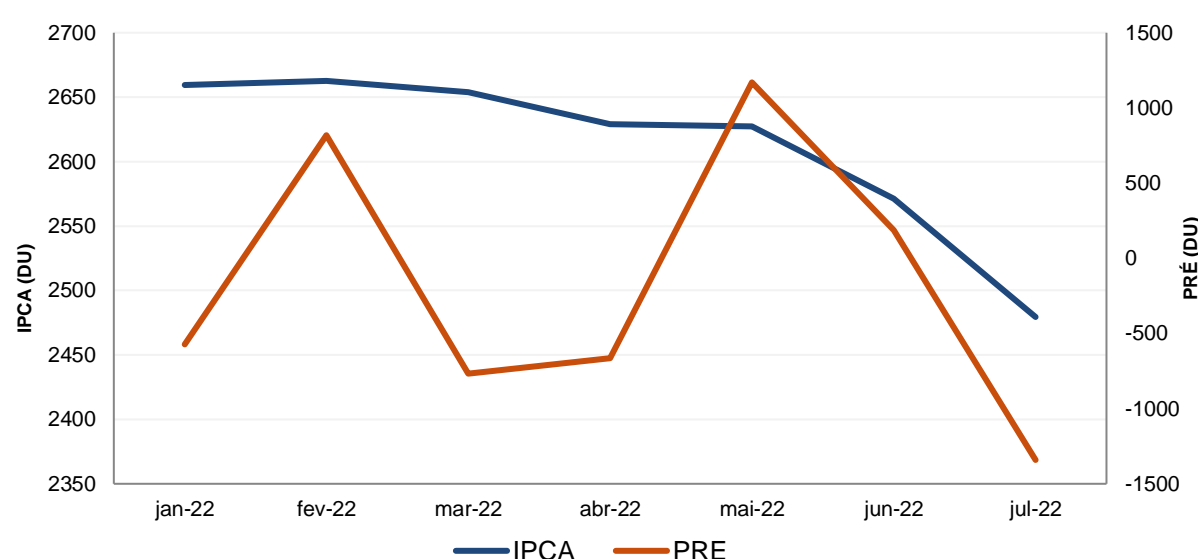
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	42.143,77	10,30	32.253,27	8,48
VALE3	Mineração	40.269,03	9,84	48.106,55	12,64
ELET3	Energia Elétrica	17.462,95	4,27	18.377,38	4,83
EQTL3	Energia Elétrica	17.185,20	4,20	15.810,64	4,15
ITSA4	Intermediários Financeiros	15.757,16	3,85	14.744,65	3,87
BPAC11	Intermediários Financeiros	14.617,65	3,57	14.623,91	3,84
ITUB4	Intermediários Financeiros	14.517,89	3,55	13.260,74	3,48
RENT3	Diversos	13.225,13	3,23	5.807,56	1,53
BBAS3	Intermediários Financeiros	11.197,25	2,74	7.931,82	2,08
BBDC4	Intermediários Financeiros	10.745,42	2,63	10.357,80	2,72

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

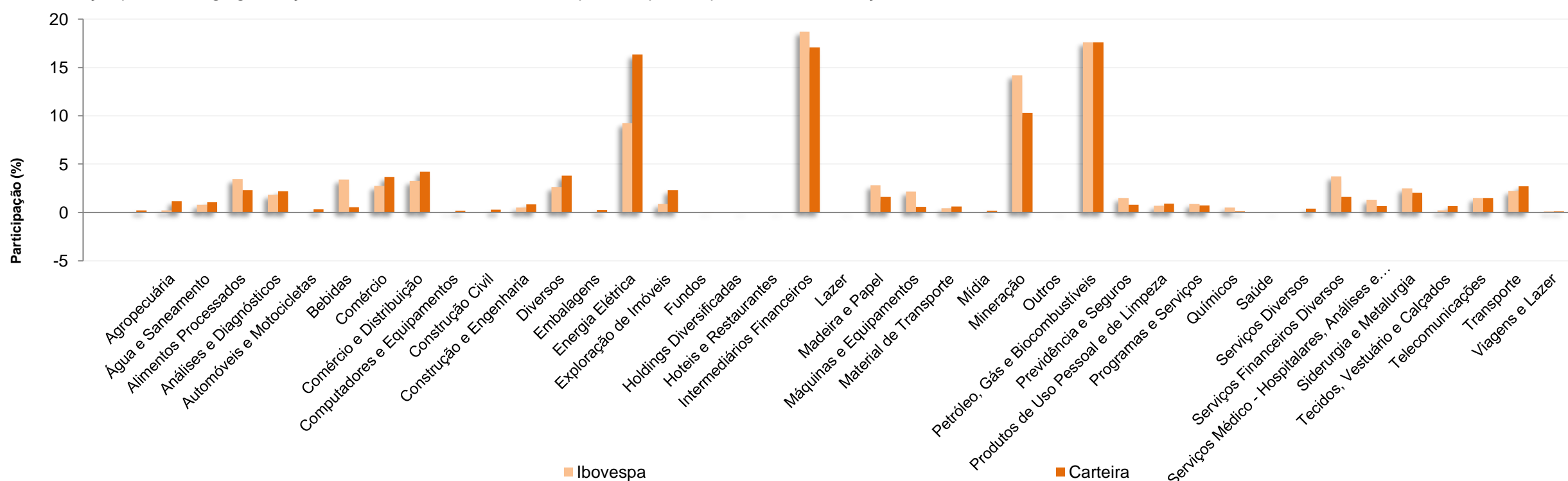
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
MTSA4	297,41	0,07	0,23	34
CRIV4	75,42	0,02	0,08	30
COCE5	560,45	0,14	0,06	9
HBRE3	398,71	0,10	0,35	8
SCAR3	150,44	0,04	0,03	8
EALT4	90,76	0,02	0,10	5
BEES3	40,97	0,01	0,06	4
EQPA3	8,41	0,00	0,00	4
ELMD3	781,97	0,19	0,13	3
LAND3	749,31	0,18	0,09	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.



Esse 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 BD

Data-base: 29/07/2022

Análises de Contrapartes

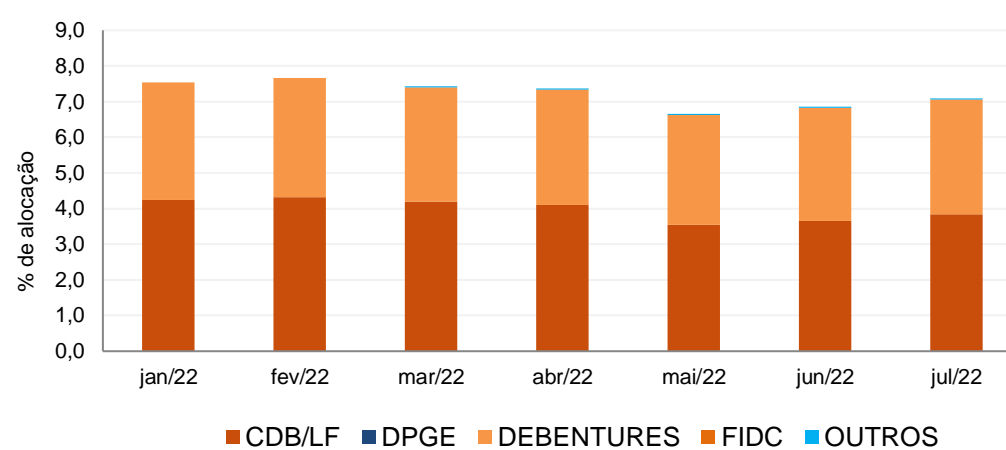
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
VALE SA	68.075,63	4,55	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	47.832,07	3,20	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	43.636,66	2,92	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	19.269,65	1,29	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	17.185,20	1,15	Faixa 1
ITAUSA INVESTS ITAU SA	15.757,16	1,05	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	14.617,65	0,98	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	14.517,51	0,97	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	13.225,13	0,88	Faixa 1
BCO BRASIL SA	11.197,25	0,75	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
TLPP27	223,30	TELEFONICA BRASIL SA	Sem Faixa	Faixa 1	12-jul-27	CDI	1,35%	URCA FI MULT CRED PRIV



ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 29/07/2022

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
TLPP27	12-jul-27	223.305	0,01%	CDI	TELEFONICA BRASIL SA	14-jul-22	1,35%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

