

ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 31/08/2022

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	958.179.045,88	55,22%			10,27%	10,48%	15,12%	19,04%	18,07%	34,14%	68,32%
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	752.687.247,86	43,38%									
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	752.687.247,86	43,38%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
RF REFERENCIADO DI	205.491.798,02	11,84%									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	130.964.306,87	7,55%	ALFA	17,68%	1,22%	3,53%	6,76%	8,56%	11,31%	14,41%	18,69%
BRASESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	4.003.491,34	0,23%	BRASESCO	18,44%	1,15%	3,20%	6,06%	7,60%	10,00%	12,88%	17,17%
URCA FI MULT CRED PRIV	70.523.999,81	4,06%	SANTANDER	17,42%	1,34%	3,41%	6,46%	8,33%	10,60%	13,45%	18,01%
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
Renda Variável	442.824.838,82	25,52%			6,84%	-0,14%	-1,00%	6,07%	-7,00%	10,33%	3,66%
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				6,34%	-1,49%	-2,67%	5,87%	-6,35%	15,46%	16,45%
RV ATIVO	243.829.774,72	14,05%									
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	159.640.652,14	9,20%	SHARP	36,68%	7,06%	1,64%	1,46%	12,58%	-1,58%	20,03%	24,06%
FIA SAO CONRADO	9.863.873,40	0,57%	EQUITAS	36,68%	10,66%	0,00%	-10,45%	-4,08%	-30,93%	-18,96%	-24,65%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	56.940.693,60	3,28%	CONSTANCIA	36,68%	7,07%	0,01%	6,33%	9,24%	-0,12%	17,78%	18,39%
FIA PIPA	10.273.186,73	0,59%	XP	36,68%	6,97%	5,41%	11,20%	18,82%	6,39%	9,31%	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	7.111.368,85	0,41%	CONSTELLATION	36,68%	3,69%	-0,46%	-8,39%	-8,31%	-32,06%	-	-
Benchmark:	IBOVESPA				6,16%	-1,64%	-3,20%	4,48%	-7,79%	10,22%	8,29%
CARTEIRA PRÓPRIA RV	83.915.320,74	4,84%									
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	83.915.320,74	4,84%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				6,15%	-2,00%	-3,64%	4,48%	-8,18%	10,99%	9,74%
RV VALOR	52.983.392,52	3,05%									
VINCI JOATINGA FIA	43.976.793,67	2,53%	VINCI	36,68%	5,95%	-1,89%	-5,05%	1,29%	-10,34%	5,40%	10,83%
FIA ITACOATIARA	9.006.598,85	0,52%	INDIE CAPITAL	36,68%	10,59%	-0,46%	-10,25%	-11,27%	-29,70%	-21,88%	-
Benchmark:	IBOVESPA				6,16%	-1,64%	-3,20%	4,48%	-7,79%	10,22%	8,29%
RV SMALL CAP	44.957.921,48	2,59%									
GRUMARI FIA	44.957.921,48	2,59%	AZ QUEST	36,68%	6,01%	-1,55%	-3,47%	-1,90%	-13,58%	-1,89%	4,00%
Benchmark:	SMLL				10,90%	-2,42%	-4,48%	-6,34%	-22,25%	-9,05%	-3,57%
RV PASSIVO	17.138.429,35	0,99%									
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	17.138.429,35	0,99%	BLACKROCK	0,11%	6,58%	-1,26%	-2,82%	4,99%	-7,23%	10,59%	8,63%
Benchmark:	IBOVESPA				6,16%	-1,64%	-3,20%	4,48%	-7,79%	10,22%	8,29%
Estruturado	60.376.846,91	3,48%			2,54%	3,72%	7,49%	8,68%	8,70%	15,84%	41,18%
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				0,56%	2,19%	8,03%	11,52%	19,71%	45,35%	64,58%
MM MACRO	33.026.641,62	1,90%									
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	8.276.775,60	0,48%	QUANTITAS	3,83%	2,90%	4,69%	12,06%	16,19%	16,61%	24,87%	33,10%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.804.822,49	0,16%	OCCAM	0,18%	1,13%	2,14%	6,90%	7,95%	8,66%	10,83%	23,60%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	11.103.535,08	0,64%	OCCAM	0,63%	1,13%	2,14%	6,91%	7,96%	8,67%	10,82%	-
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.554.915,03	0,15%	PACIFICO	2,01%	1,70%	2,99%	3,51%	4,27%	3,60%	4,29%	9,73%
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	8.286.593,43	0,48%	ZEITGEIST	0,42%	1,59%	1,18%	7,64%	9,29%	14,33%	18,51%	34,75%
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
MM LONG-SHORT	14.672.118,80	0,85%									
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	14.672.118,80	0,85%	NAVI CAPITAL	2,83%	3,92%	8,98%	11,32%	13,32%	14,65%	21,67%	26,31%
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
FIP	12.678.086,50	0,73%									
SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES	12.678.086,50	0,73%	SIGNAL CAPITAL	10,52%	0,74%	-1,53%	0,35%	-0,89%	-4,36%	-41,44%	-25,99%
Benchmark:	IPCA				-0,36%	-0,37%	2,79%	4,39%	8,73%	19,25%	22,16%
Exterior	43.248.164,14	2,49%			-3,62%	5,36%	-7,86%	-23,17%	-11,21%	8,35%	
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-4,51%	3,09%	-11,16%	-24,55%	-15,78%	1,28%	53,75%
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	43.248.164,14	2,49%									
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	43.248.164,14	2,49%	BLACKROCK	1,44%	-3,62%	5,36%	-7,94%	-23,01%	-11,02%	9,10%	74,69%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-4,51%	3,09%	-11,16%	-24,55%	-15,78%	1,28%	53,75%
Operações com Participantes **	68.025.824,24	3,92%			2,16%	5,77%	11,52%	14,65%	21,97%	42,13%	
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				0,45%	1,87%	7,37%	10,62%	18,27%	41,89%	58,74%
Imobiliário **	160.381.771,09	9,24%			0,87%	2,28%	3,50%	3,98%	7,69%	31,97%	
Benchmark:	INPC				-0,31%	-0,29%	2,93%	4,65%	8,83%	20,17%	23,70%
Total	1.735.190.410,37	100%			4,21%	7,59%	6,48%	8,83%	12,51%	9,19%	26,91%
Benchmark:	INPC + 4.5% a.a.				0,09%	0,84%	5,25%	7,77%	13,72%	31,20%	41,14%

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

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 29/07/2022

* 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.

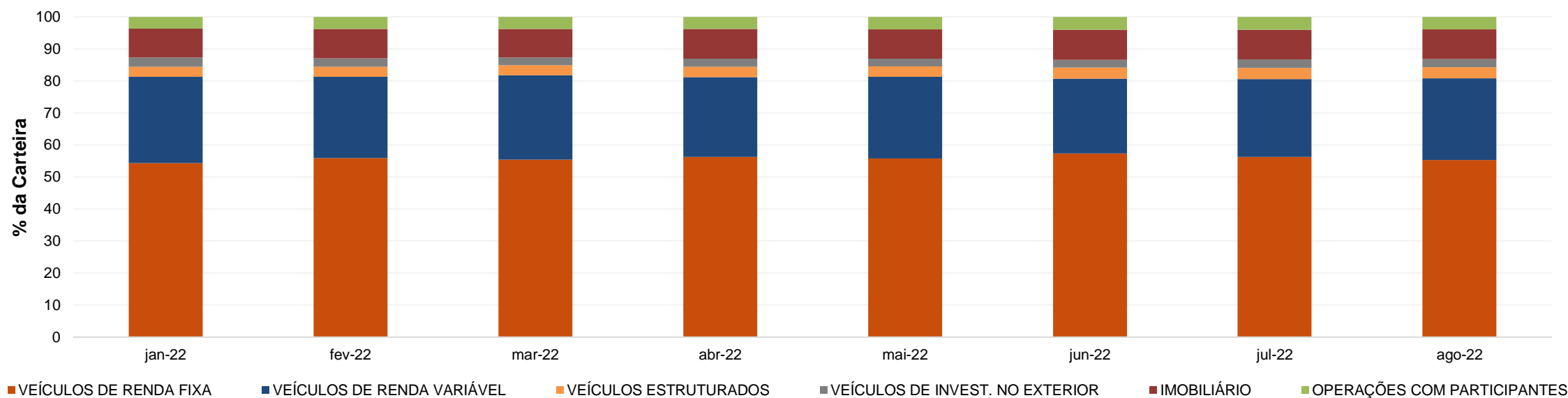
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

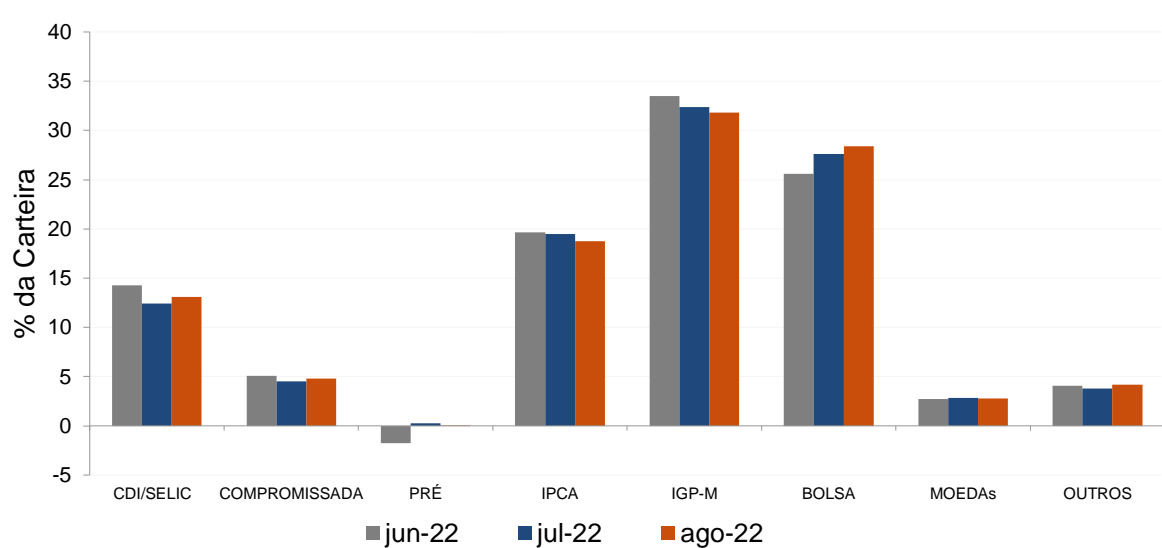
Distribuição da Carteira

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.

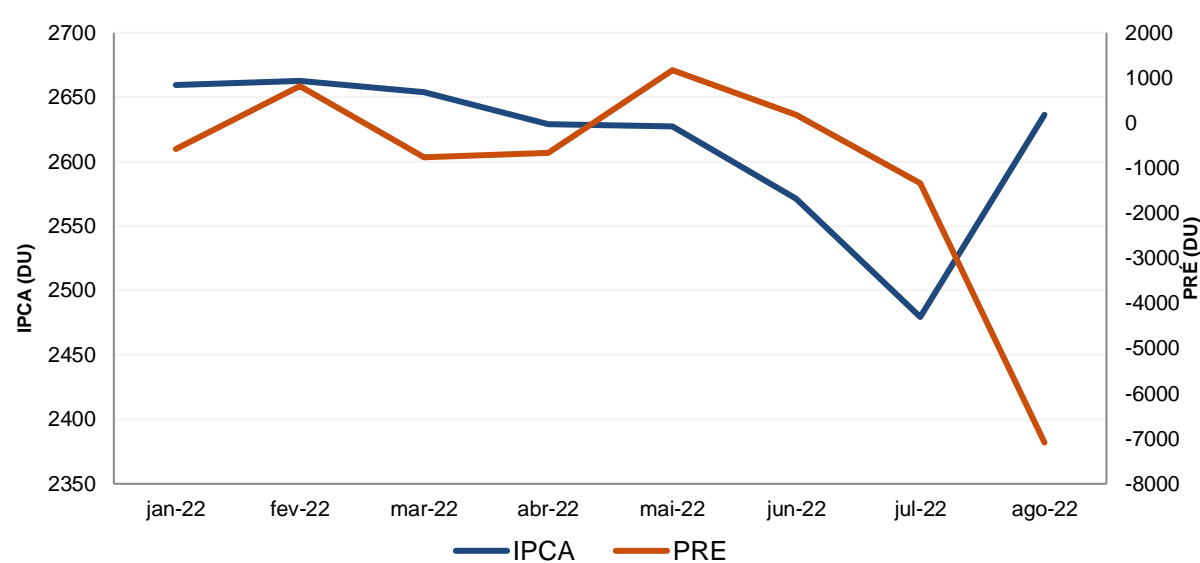
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	41.609,91	9,57	42.143,77	10,30
VALE3	Mineração	38.652,13	8,89	40.269,03	9,84
BPAC11	Intermediários Financeiros	18.531,13	4,26	14.617,65	3,57
ITUB4	Intermediários Financeiros	17.226,00	3,96	14.517,89	3,55
ITSA4	Intermediários Financeiros	17.204,22	3,96	15.757,16	3,85
EQTL3	Energia Elétrica	16.824,31	3,87	17.185,20	4,20
RENT3	Diversos	16.044,46	3,69	13.225,13	3,23
ELET3	Energia Elétrica	15.878,47	3,65	17.462,95	4,27
BBDC4	Intermediários Financeiros	12.313,42	2,83	10.745,42	2,63
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	10.914,01	2,51	8.230,20	2,01

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

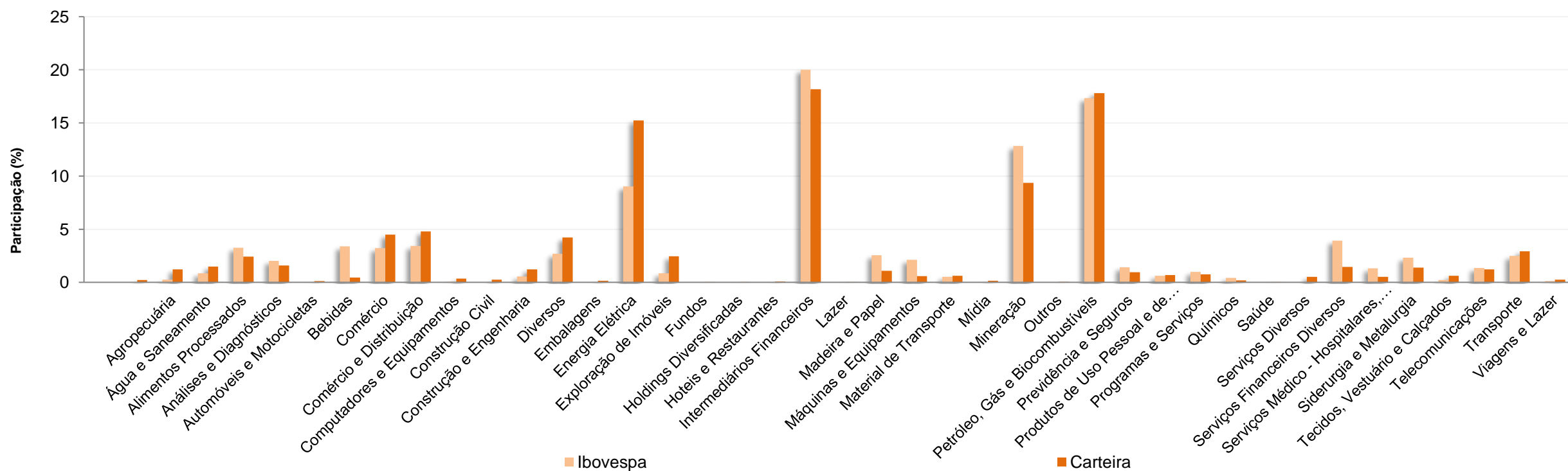
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	81,17	0,02	0,08	70
MTSA4	345,29	0,08	0,24	33
SCAR3	154,75	0,04	0,03	13
HBRE3	518,52	0,12	0,36	11
LAND3	718,19	0,17	0,09	4
COCE5	534,23	0,12	0,06	4
KRSA3	220,28	0,05	0,05	4
ALLD3	264,23	0,06	0,11	3
EMAE4	62,20	0,01	0,01	3
ELMD3	708,83	0,16	0,13	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.



ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 31/08/2022

Análises de Contrapartes

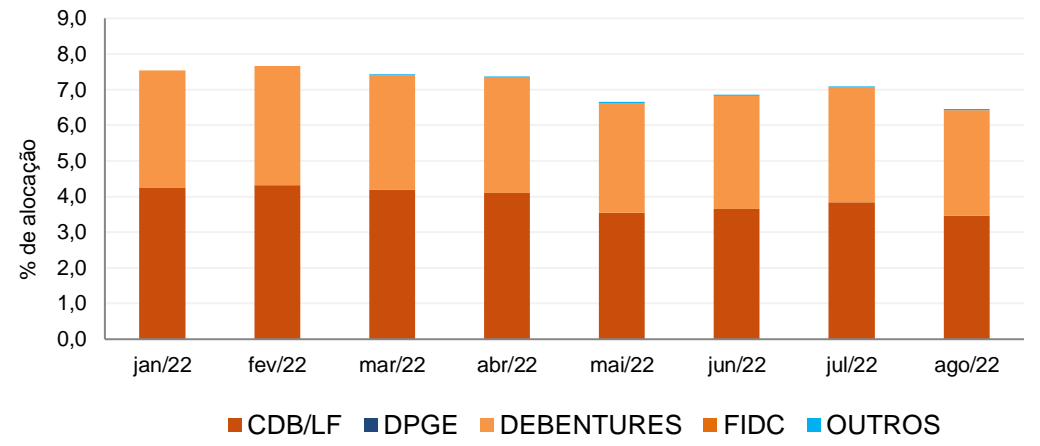
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
VALE SA	66.700,74	4,40	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	45.424,84	3,00	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	41.117,01	2,71	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	18.531,13	1,22	Faixa 2
ITAUSA INVESTS ITAU SA	17.648,09	1,16	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	17.330,67	1,14	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	17.225,68	1,14	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	16.824,31	1,11	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	16.044,46	1,06	Faixa 1
PETRO RIO SA	10.914,01	0,72	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								



ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 31/08/2022

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
BSA316	05-ago-27	352.352	0,02%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	09-ago-22	1,30%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
CSBR11	10-dez-25	75.646	0,00%	CDI	CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÔES	04-ago-22	3,02%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
ITSA15	08-ago-25	317.205	0,02%	CDI	ITAUSA INVESTS ITAU SA	10-ago-22	1,12%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
ITSA25	08-ago-25	126.665	0,01%	CDI	ITAUSA INVESTS ITAU SA	10-ago-22	1,12%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2025-09-01	01-set-25	3.704.878	0,24%	Selic		03-ago-22	0,11%	0,11%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP



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.