

ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 30/09/2022

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	1.041.651.557,64	57,47%			0,76%	10,95%	13,32%	19,95%	19,89%	33,76%	69,61%
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	849.007.090,81	46,84%									
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	849.007.090,81	46,84%	100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
RF REFERENCIADO DI	192.644.466,83	10,63%									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	121.942.176,59	6,73%	ALFA	16,61%	1,14%	3,59%	6,73%	9,80%	12,05%	15,73%	19,49%
BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	3.795.165,75	0,21%	BRDESCO	17,30%	1,06%	3,26%	6,22%	8,74%	10,69%	13,91%	17,87%
URCA FI MULT CRED PRIV	66.907.124,49	3,69%	SANTANDER	16,35%	1,14%	3,60%	6,57%	9,57%	11,38%	14,85%	18,65%
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
Renda Variável	441.484.944,53	24,36%			-0,27%	11,84%	-6,11%	5,78%	-1,08%	14,96%	3,38%
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				0,12%	11,33%	-8,19%	5,99%	0,64%	20,95%	12,77%
RV ATIVO	243.660.697,65	13,44%									
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	160.345.876,72	8,85%	SHARP	36,76%	0,24%	13,22%	-2,70%	12,85%	5,52%	24,93%	19,96%
FIA SAO CONRADO	9.699.951,47	0,54%	EQUITAS	36,76%	-1,86%	15,93%	-14,98%	-5,86%	-25,63%	-16,57%	-26,41%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	56.313.330,10	3,11%	CONSTANCIA	36,76%	-1,30%	10,85%	-2,42%	7,82%	3,38%	21,48%	15,42%
FIA PIPA	10.160.651,34	0,56%	XP	36,76%	-1,29%	12,27%	4,02%	17,28%	10,12%	15,18%	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	7.140.888,03	0,39%	CONSTELLATION	36,76%	0,21%	12,01%	-12,66%	-8,12%	-26,59%	-	-
Benchmark:	IBOVESPA				0,47%	11,66%	-8,30%	4,97%	-0,85%	16,31%	5,05%
CARTEIRA PRÓPRIA RV	84.080.880,87	4,64%									
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	84.080.880,87	4,64%	100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				-0,05%	10,77%	-9,10%	4,43%	-1,33%	16,26%	6,28%
RV VALOR	53.259.174,10	2,94%									
VINCI JOATINGA FIA	44.384.577,26	2,45%	VINCI	36,76%	0,72%	11,67%	-8,20%	2,03%	-3,02%	9,25%	9,66%
FIA ITACOATIARA	8.874.596,84	0,49%	INDIE CAPITAL	36,76%	-1,66%	13,35%	-12,53%	-12,74%	-26,96%	-18,60%	-
Benchmark:	IBOVESPA				0,47%	11,66%	-8,30%	4,97%	-0,85%	16,31%	5,05%
RV SMALL CAP	44.081.769,10	2,43%									
GRUMARI FIA	44.081.769,10	2,43%	AZ QUEST	36,76%	-2,15%	7,68%	-9,77%	-4,01%	-11,78%	1,99%	0,51%
Benchmark:	SMLL				-1,84%	14,47%	-13,82%	-8,06%	-18,43%	-5,58%	-7,27%
RV PASSIVO	16.402.422,80	0,90%									
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	16.402.422,80	0,90%	BLACKROCK	0,11%	0,60%	12,06%	-7,91%	5,62%	-0,03%	16,92%	5,54%
Benchmark:	IBOVESPA				0,47%	11,66%	-8,30%	4,97%	-0,85%	16,31%	5,05%
Estruturado	60.526.719,55	3,34%			0,25%	2,91%	6,29%	8,95%	9,02%	16,29%	41,53%
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				0,47%	1,23%	5,84%	12,05%	17,91%	43,63%	64,14%
MM MACRO	33.478.814,82	1,85%									
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	8.347.441,15	0,46%	QUANTITAS	3,83%	0,85%	5,44%	9,57%	17,19%	17,17%	26,90%	33,44%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.857.613,88	0,16%	OCCAM	0,19%	1,88%	3,07%	7,65%	9,98%	10,81%	15,08%	25,11%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	11.312.669,44	0,62%	OCCAM	0,65%	1,88%	3,07%	7,66%	9,99%	10,81%	15,07%	-
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.568.114,64	0,14%	PACIFICO	2,10%	0,52%	3,12%	2,72%	4,80%	5,78%	6,46%	8,84%
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	8.392.975,70	0,46%	ZEITGEIST	0,42%	1,28%	2,08%	4,37%	10,69%	15,58%	23,39%	32,88%
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
MM LONG-SHORT	14.818.924,50	0,82%									
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	14.818.924,50	0,82%	NAVI CAPITAL	2,83%	1,00%	4,78%	13,73%	14,45%	15,21%	25,01%	27,51%
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
FIP	12.228.980,23	0,67%									
SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES	12.228.980,23	0,67%	SIGNAL CAPITAL	10,28%	-1,29%	-0,55%	-3,58%	-2,17%	-5,27%	-42,25%	-29,27%
Benchmark:	IPCA				-0,29%	-1,32%	0,86%	4,09%	7,17%	18,15%	21,85%
Exterior	40.856.077,35	2,25%			-5,53%	-1,48%	-9,31%	-27,42%	-16,45%	4,33%	12,01%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-5,49%	-3,57%	-11,09%	-28,69%	-21,36%	-3,69%	41,66%
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	40.856.077,35	2,25%									
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	40.856.077,35	2,25%	BLACKROCK	1,47%	-5,53%	-1,48%	-9,40%	-27,27%	-16,27%	4,67%	61,14%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-5,49%	-3,57%	-11,09%	-28,69%	-21,36%	-3,69%	41,66%
Operações com Participantes	67.648.793,14	3,73%			0,15%	4,01%	9,82%	14,82%	20,20%	41,02%	53,01%
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				0,37%	0,92%	5,19%	11,04%	16,50%	40,21%	58,31%
Imobiliário	160.048.283,05	8,83%			0,44%	1,96%	3,29%	4,44%	7,44%	31,64%	40,67%
Benchmark:	INPC				-0,32%	-1,23%	0,87%	4,32%	7,19%	18,75%	23,37%
Total	1.812.527.689,43	100%			2,89%	9,42%	6,28%	12,83%	11,78%	27,84%	49,73%
Benchmark:	INPC + 4.5% a.a.				0,05%	-0,10%	3,14%	7,82%	12,01%	29,65%	40,76%

* 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.

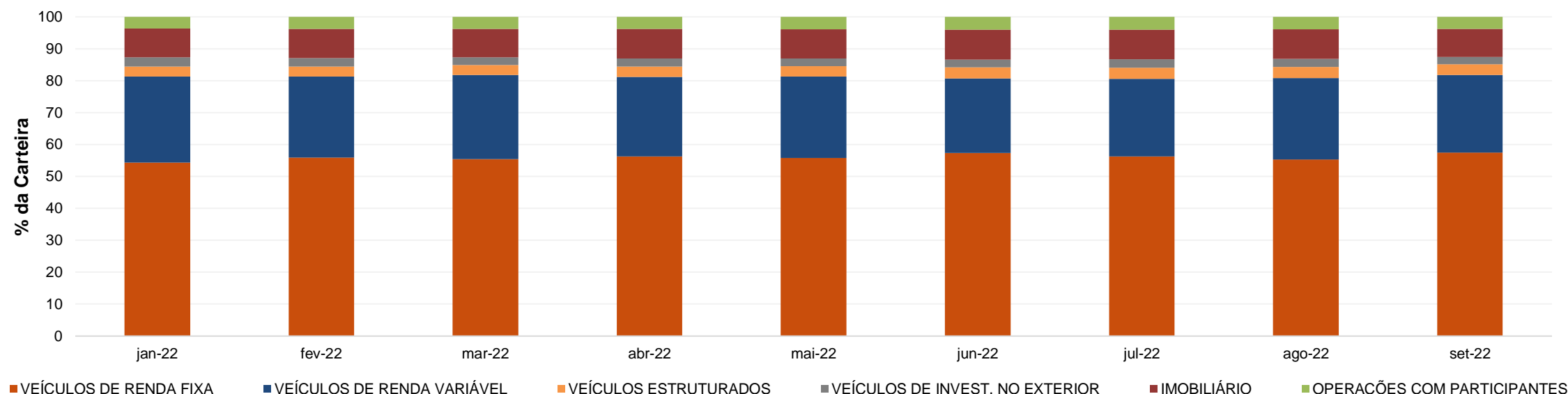
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

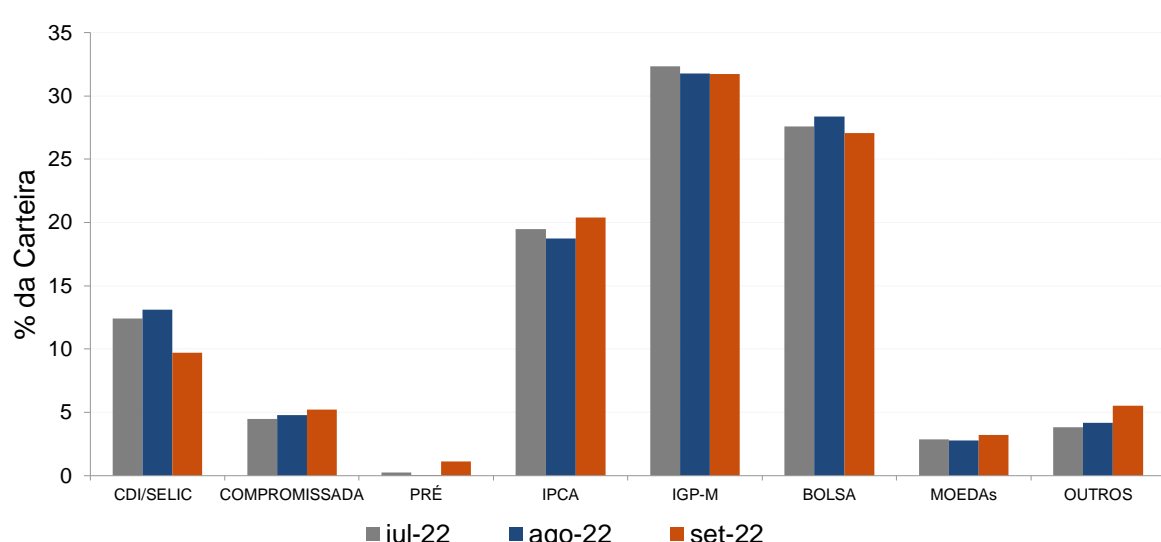
Distribuição da Carteira

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.

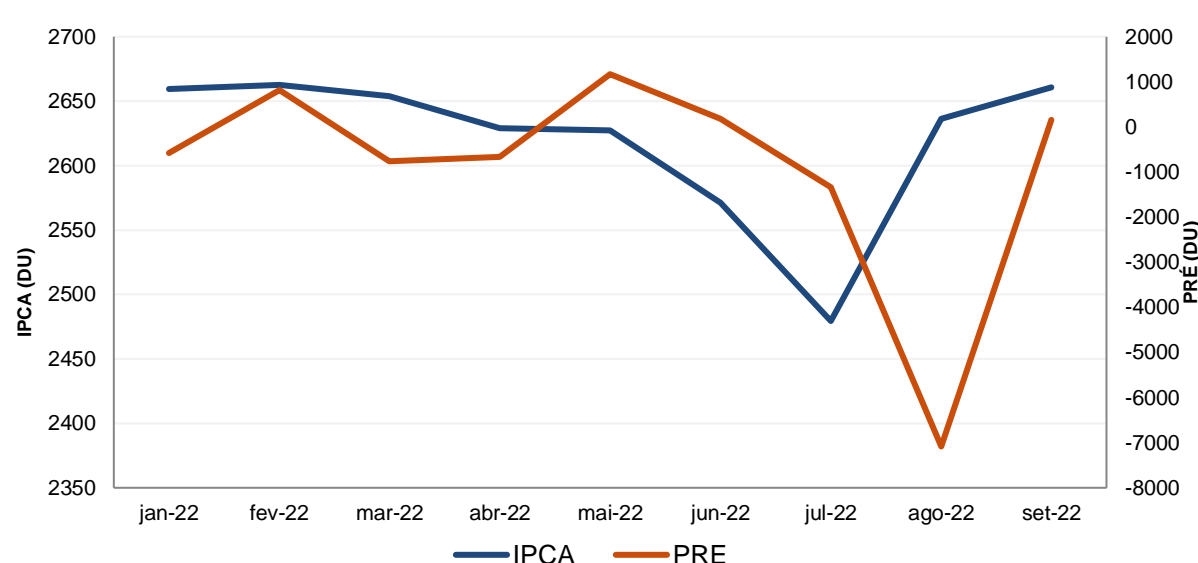
Evolução do Patrimônio Líquido



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	38.755,94	9,09	38.652,13	8,89
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	26.848,48	6,30	41.609,91	9,57
ITSA4	Intermediários Financeiros	20.902,62	4,90	17.204,22	3,96
ELET3	Energia Elétrica	18.908,64	4,44	15.878,47	3,65
EQTL3	Energia Elétrica	17.798,11	4,17	16.824,31	3,87
RENT3	Diversos	16.081,92	3,77	16.044,46	3,69
ITUB4	Intermediários Financeiros	15.876,49	3,72	17.226,00	3,96
BPAC11	Intermediários Financeiros	15.416,11	3,62	18.531,13	4,26
BBDC4	Intermediários Financeiros	12.547,83	2,94	12.313,42	2,83
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	11.977,00	2,81	10.914,01	2,51

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

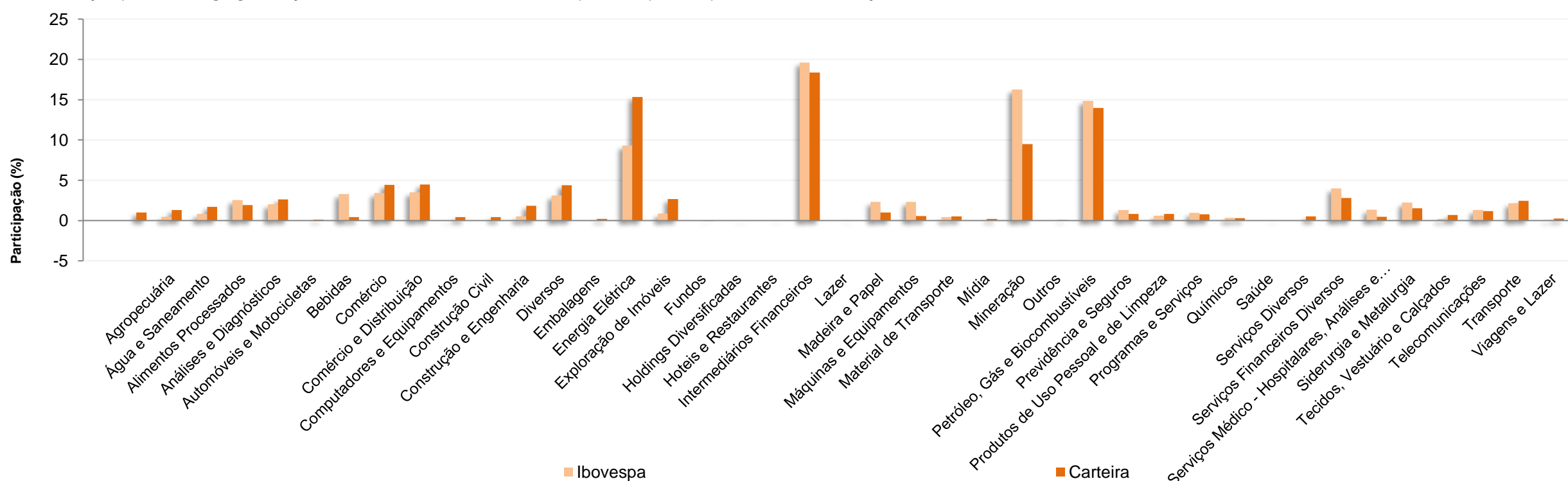
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
MTSA4	342,28	0,08	0,24	33
CRIV4	85,29	0,02	0,08	23
SCAR3	147,66	0,03	0,03	11
HBRE3	468,53	0,11	0,36	10
COCE5	564,66	0,13	0,06	6
ELMD3	784,17	0,18	0,14	4
LAND3	733,06	0,17	0,09	4
EALT4	111,63	0,03	0,10	4
EQPA3	10,89	0,00	0,00	4
ALLD3	232,33	0,05	0,11	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.



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: 30/09/2022

Análises de Contrapartes

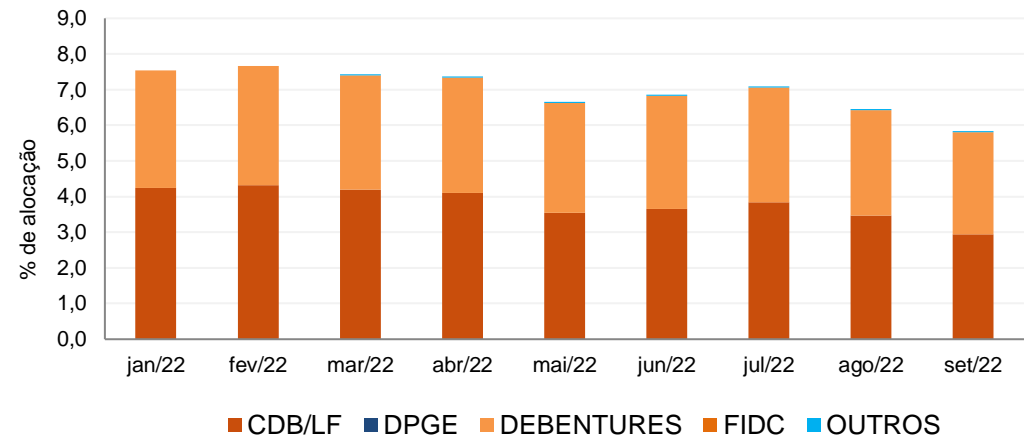
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
VALE SA	70.286,55	4,40	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	37.679,71	2,36	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	27.768,10	1,74	Faixa 2
ITAUSA SA	21.323,84	1,34	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	20.248,09	1,27	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	17.798,11	1,11	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	16.090,90	1,01	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	15.876,15	0,99	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	15.416,12	0,97	Faixa 2
PETRO RIO SA	11.977,00	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								



ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 30/09/2022

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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	371.792	0,02%	Selic	06-set-22	0,01%	0,01%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.958.948	0,19%	Selic	01-set-22	5,00%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	913.882	0,06%	Selic	29-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	249.794	0,02%	Selic	29-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	71.080	0,00%	Selic	23-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	2.128.196	0,13%	Selic	22-set-22	0,09%	0,09%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.013.427	0,06%	Selic	05-set-22	0,10%	0,10%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2028-03-01	01-mar-28	247.890	0,02%	Selic	23-set-22	0,17%	0,17%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

