

ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 31/10/2022

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	1.017.634.443,12	57,90%			-0,73%	10,30%	11,44%	19,07%	19,69%	30,48%	68,36%
Benchmark:	CDI				1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	838.320.017,15	47,70%									
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	838.320.017,15	47,70%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%
RF REFERENCIADO DI	179.314.425,97	10,20%									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	113.315.714,35	6,45%	ALFA	15,43%	1,08%	3,48%	7,01%	10,98%	12,71%	16,79%	20,21%
BRANCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	3.537.666,70	0,20%	BRANCO	15,96%	1,01%	3,26%	6,41%	9,84%	11,28%	14,88%	18,49%
URCA FI MULT CRED PRIV	62.461.044,93	3,55%	SANTANDER	15,11%	1,16%	3,68%	6,98%	10,84%	12,54%	16,06%	19,37%
Benchmark:	CDI				1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%
Renda Variável	408.711.116,15	23,26%			6,40%	13,37%	8,80%	12,56%	13,79%	23,99%	10,00%
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				5,74%	12,57%	7,84%	12,07%	14,02%	28,38%	16,46%
RV ATIVO	263.508.709,05	14,99%									
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	172.905.936,73	9,84%	SHARP	37,50%	5,70%	13,43%	12,03%	19,28%	19,93%	33,17%	24,05%
FIA SAO CONRADO	10.747.076,24	0,61%	EQUITAS	37,50%	8,60%	17,94%	4,50%	2,23%	-4,21%	-6,98%	-23,69%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	60.672.087,85	3,45%	CONSTANCIA	37,50%	5,60%	11,60%	7,03%	13,87%	17,13%	30,51%	19,06%
FIA PIPA	11.181.695,61	0,64%	XP	37,50%	7,87%	13,89%	16,18%	26,51%	29,57%	29,31%	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	8.001.912,63	0,46%	CONSTELLATION	37,50%	9,84%	14,13%	9,35%	0,92%	-7,44%	-14,79%	-
Benchmark:	IBOVESPA				5,45%	12,48%	7,57%	10,70%	12,11%	23,51%	8,22%
RV VALOR	58.956.676,69	3,35%									
VINCI JOATINGA FIA	49.088.548,01	2,79%	VINCI	37,50%	8,41%	15,69%	9,64%	10,60%	14,95%	20,41%	15,61%
FIA ITACOATIARA	9.868.128,68	0,56%	INDIE CAPITAL	37,50%	8,99%	18,53%	7,32%	-4,90%	-7,06%	-11,54%	-
Benchmark:	IBOVESPA				5,45%	12,48%	7,57%	10,70%	12,11%	23,51%	8,22%
RV SMALL CAP	46.668.134,49	2,66%									
GRUMARI FIA	46.668.134,49	2,66%	AZ QUEST	35,68%	9,05%	13,13%	4,32%	4,68%	2,46%	13,40%	5,96%
Benchmark:	SMLL				7,30%	16,81%	0,91%	-1,35%	0,06%	3,68%	-2,72%
CARTEIRA PRÓPRIA RV	29.085.785,64	1,65%									
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	29.085.785,64	1,65%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				5,57%	12,01%	6,76%	10,25%	11,78%	23,41%	9,78%
RV PASSIVO	10.491.810,28	0,60%									
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	10.491.810,28	0,60%	BLACKROCK	0,06%	5,34%	12,94%	8,46%	11,26%	12,51%	23,70%	8,64%
Benchmark:	IBOVESPA				5,45%	12,48%	7,57%	10,70%	12,11%	23,51%	8,22%
Estruturado	61.255.393,41	3,49%			1,20%	4,03%	6,34%	10,26%	10,50%	20,85%	43,24%
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				1,23%	2,28%	5,28%	13,43%	17,11%	42,98%	64,66%
MM MACRO	33.978.301,26	1,93%									
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	8.520.658,54	0,48%	QUANTITAS	3,84%	2,08%	5,93%	10,30%	19,62%	21,21%	26,48%	37,94%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.907.537,89	0,17%	OCCAM	0,20%	1,75%	4,83%	7,01%	11,90%	10,94%	16,74%	25,94%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	11.510.869,53	0,65%	OCCAM	0,68%	1,75%	4,84%	7,01%	11,92%	10,95%	16,74%	-
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.649.847,04	0,15%	PACIFICO	2,20%	3,18%	5,48%	6,18%	8,14%	10,05%	10,38%	10,82%
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	8.389.388,27	0,48%	ZEITGEIST	0,43%	-0,04%	2,85%	3,91%	10,64%	10,20%	24,26%	31,25%
Benchmark:	CDI				1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%
MM LONG-SHORT	15.055.846,10	0,86%									
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	15.055.846,10	0,86%	NAVI CAPITAL	2,83%	1,60%	6,64%	12,79%	16,28%	19,69%	28,26%	28,18%
Benchmark:	CDI				1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%
FIP	12.221.246,05	0,70%									
SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES	12.221.246,05	0,70%	SIGNAL CAPITAL	10,28%	-0,06%	-0,62%	-2,23%	-	-4,65%	-30,74%	-29,31%
Benchmark:	IPCA				0,59%	-0,06%	0,39%	4,70%	6,47%	17,83%	22,45%
Exterior	42.145.818,53	2,40%			3,16%	-6,08%	-1,63%	-25,13%	-22,34%	8,36%	15,54%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				4,14%	-6,01%	-2,61%	-25,74%	-25,24%	1,20%	49,76%
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	42.145.818,53	2,40%									
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	42.145.818,53	2,40%	BLACKROCK	1,50%	3,16%	-6,08%	-1,72%	-24,98%	-22,18%	8,71%	69,25%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				4,14%	-6,01%	-2,61%	-25,74%	-25,24%	1,20%	49,76%
Operações com Participantes **	67.648.793,14	3,85%			-0,83%	1,47%	7,77%	13,87%	17,81%	38,64%	51,75%
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				1,14%	1,97%	4,64%	12,30%	15,70%	39,58%	58,83%
Imobiliário **	160.048.283,05	9,11%			0,44%	1,75%	3,34%	4,90%	7,17%	31,23%	41,29%
Benchmark:	INPC				0,47%	-0,16%	0,30%	4,81%	6,46%	18,26%	23,90%
Total	1.757.500.490,06	100%			2,42%	9,31%	9,46%	14,30%	15,49%	28,58%	49,97%
Benchmark:	INPC + 4.5% a.a.				0,82%	0,96%	2,57%	8,71%	11,25%	29,09%	41,29%

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

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 30/09/2022

* 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.

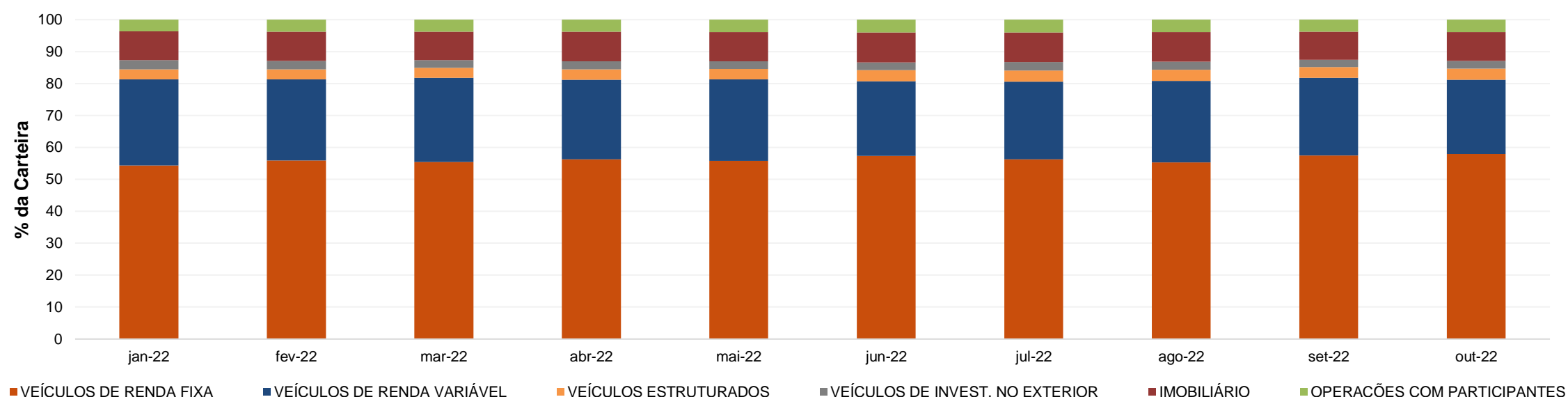
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

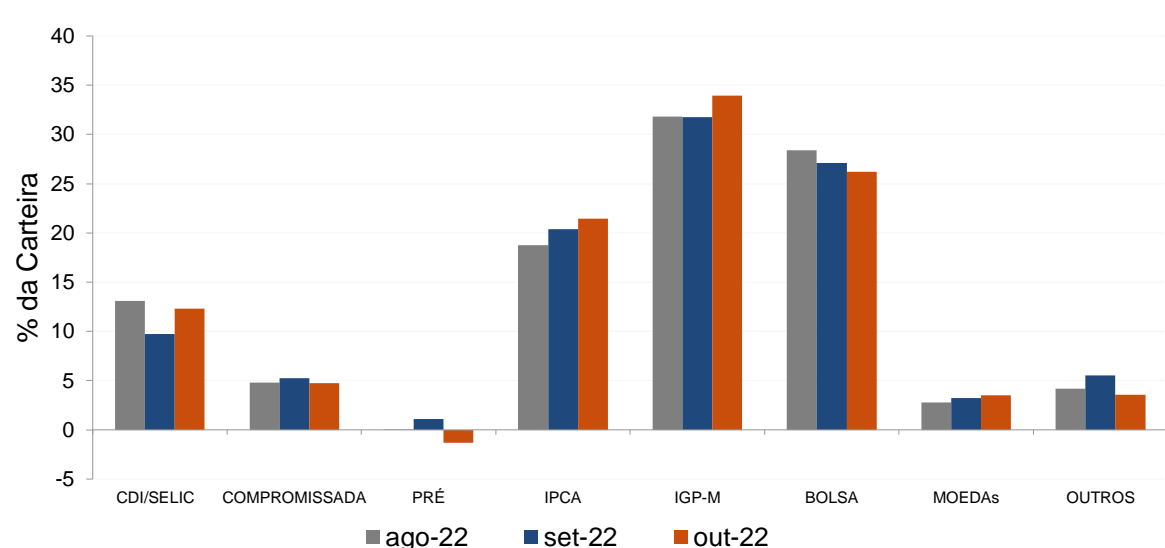
Distribuição da Carteira

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.

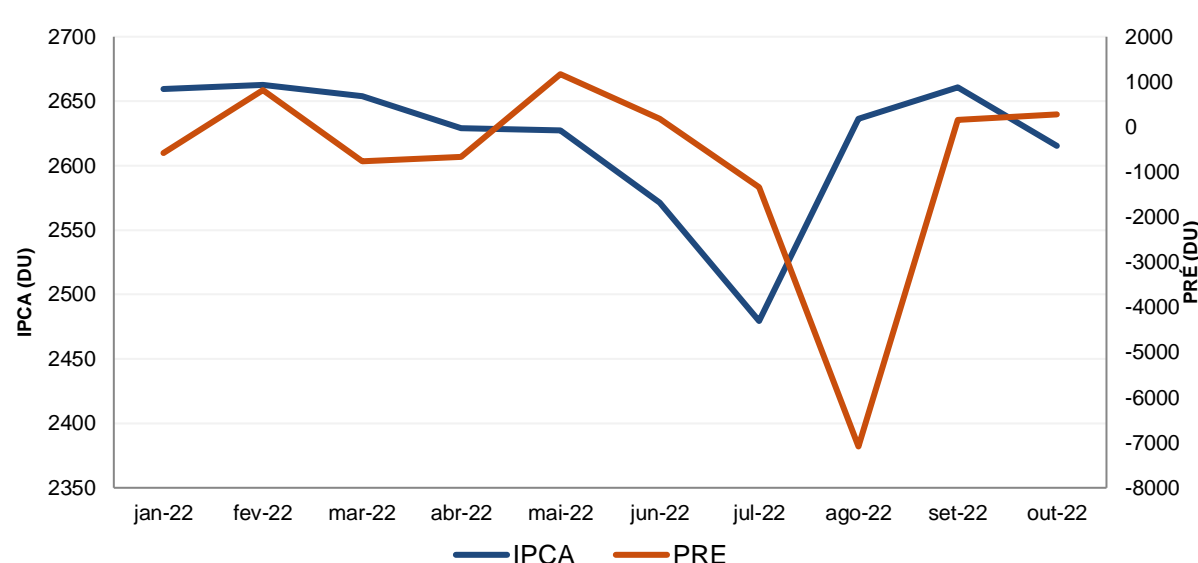
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
VALE3	Mineração	29.040,34	7,30	38.755,94	9,09
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	21.530,98	5,41	26.848,48	6,30
ITSA4	Intermediários Financeiros	19.271,33	4,85	20.902,62	4,90
ELET3	Energia Elétrica	18.578,38	4,67	18.908,64	4,44
EQTL3	Energia Elétrica	18.174,15	4,57	17.798,11	4,17
RENT3	Diversos	17.275,65	4,34	16.081,92	3,77
BPAC11	Intermediários Financeiros	17.255,38	4,34	15.416,11	3,62
ITUB4	Intermediários Financeiros	14.500,54	3,65	15.876,49	3,72
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	13.642,51	3,43	11.977,00	2,81
HAPV3	Análises e Diagnósticos	10.453,35	2,63	10.330,21	2,42

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

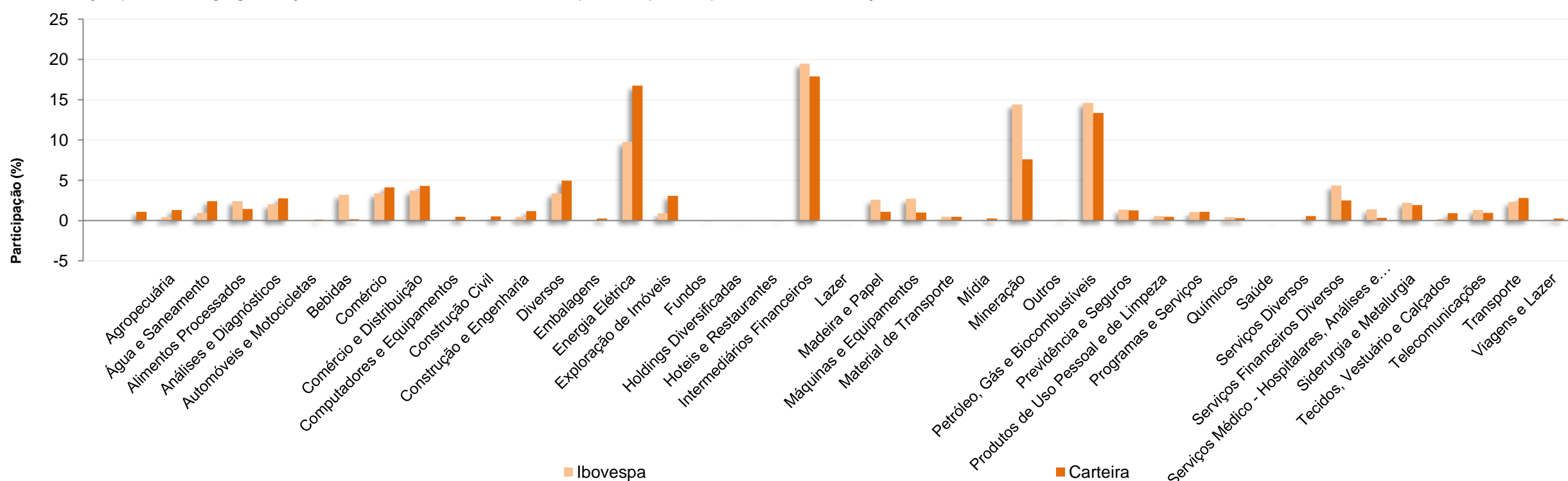
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	84,13	0,02	0,08	28
HBRE3	535,75	0,13	0,37	21
MTSA4	359,88	0,09	0,24	18
SCAR3	167,32	0,04	0,03	11
EALT4	104,91	0,03	0,11	6
KRSA3	142,32	0,04	0,04	5
LAND3	815,16	0,20	0,09	4
COCE5	517,00	0,13	0,06	3
ALLD3	219,53	0,06	0,11	3
BEES3	52,05	0,01	0,07	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.



ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 31/10/2022

Análises de Contrapartes

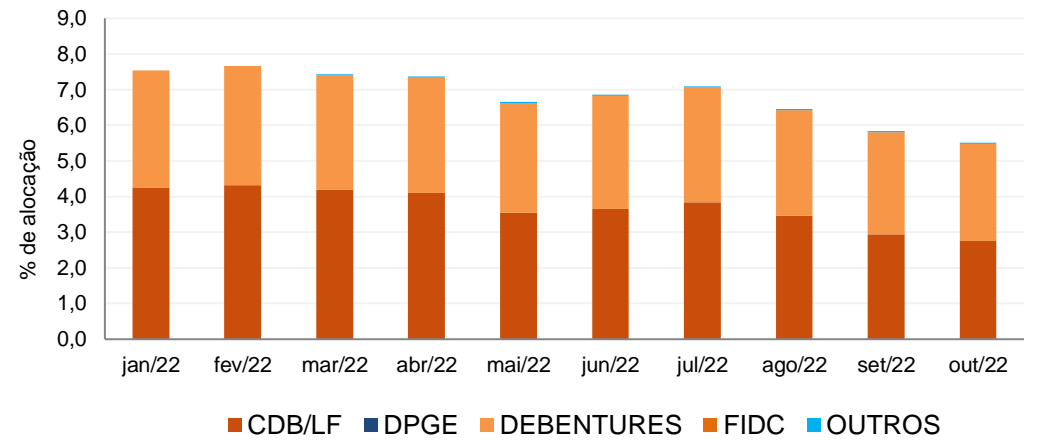
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
VALE SA	58.136,79	3,77	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	32.308,53	2,09	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	21.573,94	1,40	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	19.899,33	1,29	Faixa 2
ITAUSA SA	19.664,45	1,27	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	18.174,15	1,18	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	17.328,33	1,12	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	17.255,38	1,12	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	14.500,40	0,94	Faixa 1
PETRO RIO SA	13.642,51	0,88	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: 31/10/2022

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	65.575	0,00%	CDI	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	17-out-22	1,62%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ASAI14	26-nov-27	65.405	0,00%	CDI	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	17-out-22	1,62%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ASAI22	20-mai-28	74.489	0,00%	CDI	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	19-out-22	1,69%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ASAI22	20-mai-28	53.922	0,00%	CDI	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	17-out-22	1,70%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
CSBR11	10-dez-25	325.868	0,02%	CDI	CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÕE:	06-out-22	2,74%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
DASAA5	30-out-26	257.494	0,02%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	19-out-22	1,44%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
DASAA5	30-out-26	115.548	0,01%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	24-out-22	1,43%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
DASAA5	30-out-26	54.850	0,00%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	20-out-22	1,44%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ELET22	25-abr-24	51.823	0,00%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EL	20-out-22	0,95%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ELET22	25-abr-24	51.823	0,00%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EL	20-out-22	0,95%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ELET22	25-abr-24	51.823	0,00%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EL	20-out-22	0,95%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ELET22	25-abr-24	32.671	0,00%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EL	21-out-22	0,96%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.549.956	0,10%	Selic		18-out-22	0,01%	0,01%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	1.143.879	0,07%	Selic		07-out-22	0,01%	0,01%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-03-01	01-mar-25	264.310	0,02%	Selic		05-out-22	5,00%	0,05%	GRUMARI FIA
LFT 2025-09-01	01-set-25	3.722.462	0,24%	Selic		21-out-22	7,00%	0,07%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	2.331.296	0,15%	Selic		06-out-22	0,08%	0,08%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2026-03-01	01-mar-26	1.900.424	0,12%	Selic		18-out-22	0,11%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2026-09-01	01-set-26	1.899.500	0,12%	Selic		18-out-22	0,11%	0,10%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

