

ELETROS - ELETROS PLANO CD I

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	369.462.969,00	59,12%			1,35%	1,38%	5,64%	9,23%				
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	259.465.054,28	41,52%										
ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA PROPRIA R	259.465.054,28	41,52%		100%	-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%	
RF REFERENCIADO DI	109.997.914,72	17,60%										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	70.104.017,76	11,22%	ALFA	9,46%	1,22%	3,53%	6,76%	8,56%	11,31%	14,41%	18,69%	
BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	2.143.032,97	0,34%	BRDESCO	9,87%	1,15%	3,20%	6,06%	7,60%	10,00%	12,88%	17,17%	
URCA FI MULT CRED PRIV	37.750.863,98	6,04%	SANTANDER	9,32%	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	147.306.001,10	23,57%			6,84%	-0,14%	-1,00%	6,07%				
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				6,34%	-1,49%	-2,67%	5,87%	-6,35%	15,46%	16,45%	
RV ATIVO	81.110.150,13	12,98%										
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	53.104.577,88	8,50%	SHARP	12,20%	7,06%	1,64%	1,46%	12,58%	-1,58%	20,03%	24,06%	
FIA SAO CONRADO	3.281.224,59	0,53%	EQUITAS	12,20%	10,66%	0,00%	-10,45%	-4,08%	-30,93%	-18,96%	-24,65%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	18.941.362,72	3,03%	CONSTANCIA	12,20%	7,07%	0,01%	6,33%	9,24%	-0,12%	17,78%	18,39%	
FIA PIPA	3.417.382,96	0,55%	XP	12,20%	6,97%	5,41%	11,20%	18,82%	6,39%	9,31%	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	2.365.601,97	0,38%	CONSTELLATION	12,20%	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	27.914.491,73	4,47%										
ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA PROPRIA R'	27.914.491,73	4,47%		100%	-	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				6,15%	-2,00%	-3,64%	4,48%	-8,18%	10,99%	9,74%	
RV VALOR	17.624.963,67	2,82%										
VINCI JOATINGA FIA	14.628.912,08	2,34%	VINCI	12,20%	5,95%	-1,89%	-5,05%	1,29%	-10,34%	5,40%	10,83%	
FIA ITACOATIARA	2.996.051,59	0,48%	INDIE CAPITAL	12,20%	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	14.955.284,95	2,39%										
GRUMARI FIA	14.955.284,95	2,39%	AZ QUEST	12,20%	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	5.701.110,62	0,91%										
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	5.701.110,62	0,91%	BLACKROCK	0,04%	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	27.174.458,76	4,35%			2,39%	3,59%	7,36%	8,54%				
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				0,56%	2,19%	8,03%	11,52%	19,71%	45,35%	64,58%	
MM MACRO	17.034.339,24	2,73%										
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	4.268.959,74	0,68%	QUANTITAS	1,98%	2,90%	4,69%	12,06%	16,19%	16,61%	24,87%	33,10%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	1.446.659,28	0,23%	OCCAM	0,09%	1,13%	2,14%	6,90%	7,95%	8,66%	10,83%	23,60%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	5.726.933,59	0,92%	OCCAM	0,32%	1,13%	2,14%	6,91%	7,96%	8,67%	10,82%	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	1.317.763,09	0,21%	PACIFICO	1,04%	1,70%	2,99%	3,51%	4,27%	3,60%	4,29%	9,73%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	4.274.023,54	0,68%	ZEITGEIST	0,22%	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	7.567.522,36	1,21%										
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	7.567.522,36	1,21%	NAVI CAPITAL	1,46%	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	2.572.597,15	0,41%										
SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES	2.572.597,15	0,41%	SIGNAL CAPITAL	2,14%	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	17.635.264,00	2,82%			-3,62%	5,36%	-7,86%	-23,17%				
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-4,51%	3,09%	-11,16%	-24,55%	-15,78%	1,28%	53,75%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	17.635.264,00	2,82%										
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	17.635.264,00	2,82%	BLACKROCK	0,59%	-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 **	19.179.150,20	3,07%			1,98%	4,83%	10,57%	15,06%				
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				0,45%	1,87%	7,37%	10,62%	18,27%	41,89%	58,74%	
Imobiliário **	43.472.003,23	6,96%			0,87%	2,28%	3,50%	3,50%				
Benchmark:	INPC				-0,31%	-0,29%	2,93%	4,65%	8,83%	20,17%	23,70%	
Total	624.950.537,79	100%			4,35%	2,50%	1,24%	3,44%	6,94%			
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.

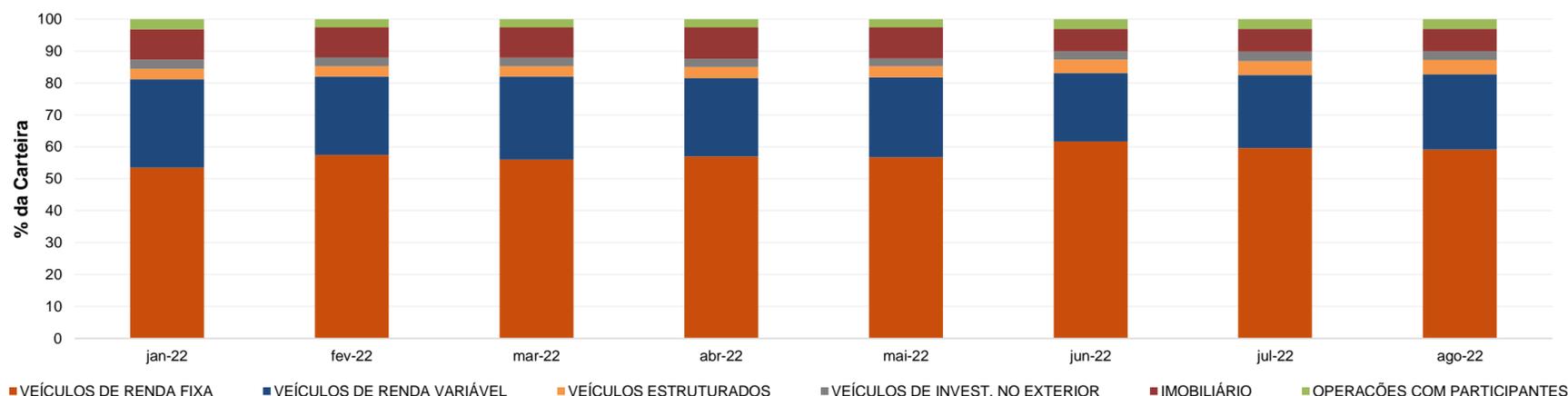
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

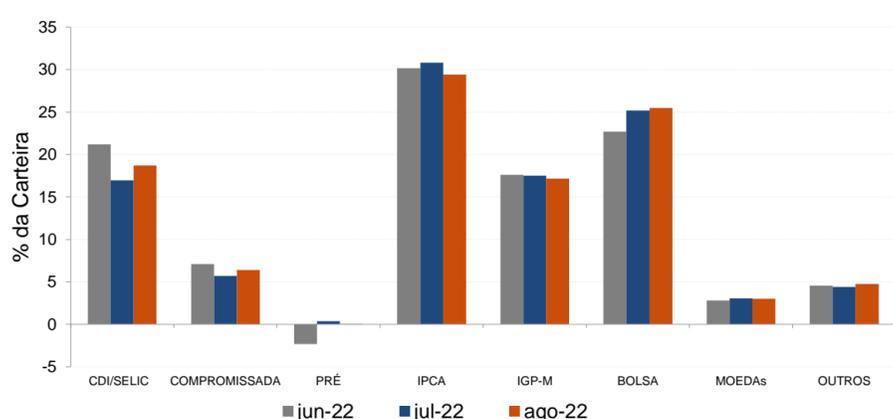
Distribuição da Carteira

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.

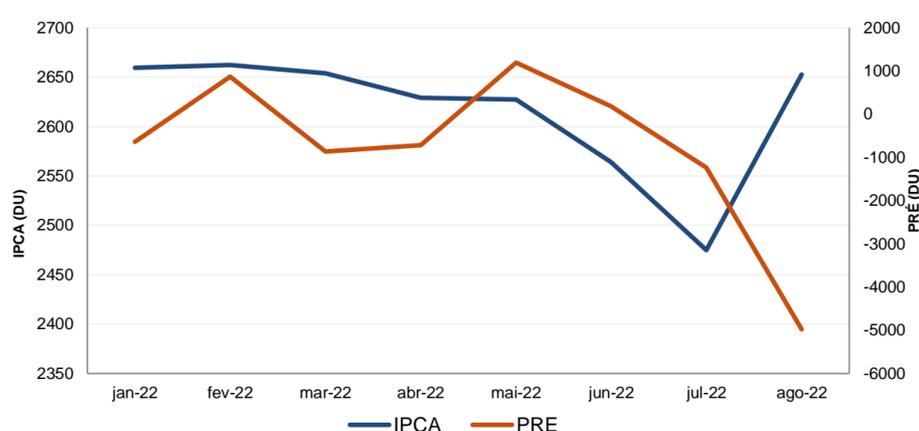
Evolução do Patrimônio Líquido



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	14.209,75	9,68	14.582,14	10,43
VALE3	Mineração	12.984,41	8,85	13.665,96	9,77
BPAC11	Intermediários Financeiros	6.254,28	4,26	5.049,62	3,61
ITUB4	Intermediários Financeiros	5.983,56	4,08	5.098,63	3,65
ITSA4	Intermediários Financeiros	5.787,82	3,94	5.319,80	3,81
EQTL3	Energia Elétrica	5.743,11	3,91	5.937,10	4,25
ELET3	Energia Elétrica	5.613,20	3,83	6.261,63	4,48
RENT3	Diversos	5.386,53	3,67	4.494,80	3,21
BBDC4	Intermediários Financeiros	4.128,85	2,81	3.642,58	2,61
VBBR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	3.714,09	2,53	3.007,50	2,15

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

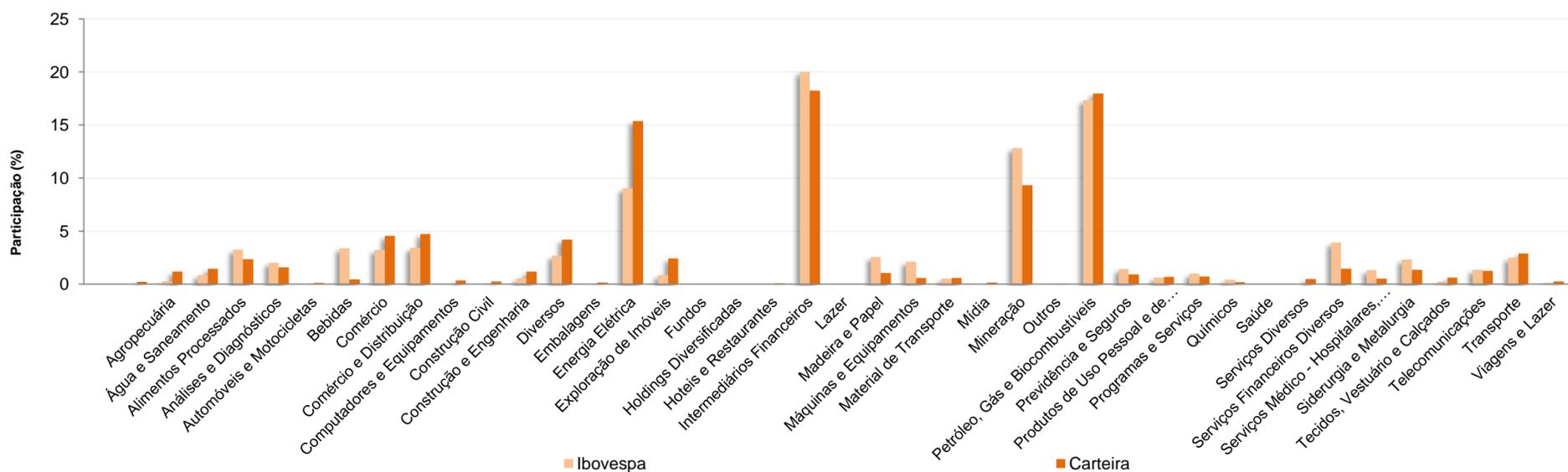
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	27,00	0,02	0,03	23
MTSA4	114,86	0,08	0,08	11
SCAR3	51,48	0,04	0,01	5
HBRE3	172,49	0,12	0,12	4
LAND3	238,91	0,16	0,03	2
COCE5	177,71	0,12	0,02	2
KRSA3	73,28	0,05	0,02	2
PETR4	14.209,75	9,68	0,01	1
VALE3	12.984,41	8,85	0,00	1
BPAC11	6.254,28	4,26	0,00	1

* 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 CD I

Data-base: 31/08/2022

Análises de Contrapartes

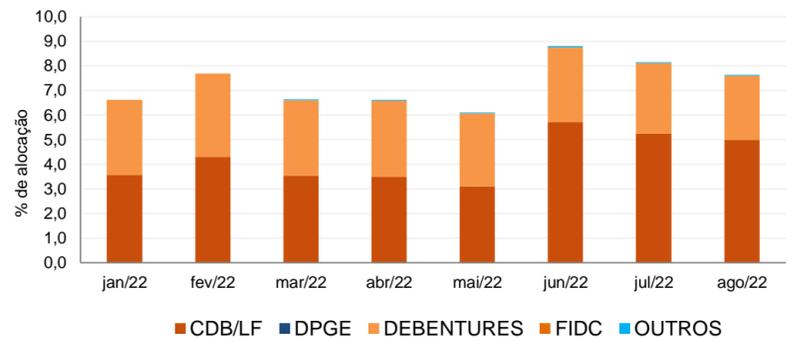
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	19.298,65	3,43	Faixa 1
VALE SA	18.616,80	3,31	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15.491,22	2,75	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	6.264,06	1,11	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	6.254,28	1,11	Faixa 2
ITAUSA INVESTS ITAU SA	6.025,41	1,07	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	5.983,39	1,06	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	5.743,11	1,02	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	5.386,53	0,96	Faixa 1
BCO SAFRA SA	5.206,03	0,92	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 I

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	188.611	0,03%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	09-ago-22	1,30%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
CSBR11	10-dez-25	40.493	0,01%	CDI	CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÔES	04-ago-22	3,02%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
CVRDA6	08-jul-50	5.632.390	1,00%	IGP-M	VALE SA	31-ago-22	2,95%	Faixa 1	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
ITSA15	08-ago-25	169.797	0,03%	CDI	ITAUSA INVESTS ITAU SA	10-ago-22	1,12%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
ITSA25	08-ago-25	67.803	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	1.983.188	0,35%	Selic		03-ago-22	0,11%	0,11%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	3.080.945	0,55%	IPCA		31-ago-22	8,17%	8,17%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	1.130.476	0,20%	IPCA		31-ago-22	8,17%	8,17%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2024-08-15	15-ago-24	2.483.219	0,44%	IPCA		31-ago-22	6,77%	6,77%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	28.018.432	4,97%	IPCA		31-ago-22	5,91%	5,91%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.933.818	0,34%	IPCA		31-ago-22	5,91%	5,91%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	231.261	0,04%	IPCA		31-ago-22	5,91%	5,91%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	3.497.257	0,62%	IPCA		31-ago-22	5,83%	5,83%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2028-08-15	15-ago-28	56.149	0,01%	IPCA		31-ago-22	5,83%	5,83%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	3.651.266	0,65%	IPCA		31-ago-22	5,85%	5,85%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	325.360	0,06%	IPCA		31-ago-22	5,85%	5,85%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	4.067.619	0,72%	IPCA		31-ago-22	5,94%	5,94%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	2.671.151	0,47%	IPCA		31-ago-22	5,94%	5,94%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2040-08-15	15-ago-40	20.097.286	3,57%	IPCA		31-ago-22	5,93%	5,93%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2040-08-15	15-ago-40	4.318.591	0,77%	IPCA		31-ago-22	5,93%	5,93%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2045-05-15	15-mai-45	2.387.718	0,42%	IPCA		31-ago-22	5,99%	5,99%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2045-05-15	15-mai-45	1.469.054	0,26%	IPCA		31-ago-22	5,99%	5,99%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	39.880.362	7,08%	IPCA		31-ago-22	5,99%	5,99%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	18.257.230	3,24%	IPCA		31-ago-22	5,99%	5,99%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	13.391.825	2,38%	IPCA		31-ago-22	5,99%	5,99%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	5.786.640	1,03%	IPCA		31-ago-22	5,99%	5,99%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	5.140.884	0,91%	IPCA		31-ago-22	5,99%	5,99%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-B 2055-05-15	15-mai-55	3.444.797	0,61%	IPCA		31-ago-22	5,99%	5,99%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA
NTN-C 2031-01-01	01-jan-31	91.041.686	16,16%	IGP-M		31-ago-22	4,41%	4,41%	ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA

