

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

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	984.987.376,65	66,13%			-0,45%	0,44%	3,69%	3,27%	3,78%	6,17%	11,62%
Benchmark:	CDI				1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	592.698.429,08	39,79%									
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	592.698.429,08	39,79%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
RF REFERENCIADO DI	392.288.947,57	26,34%									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	249.710.461,39	16,76%	ALFA	34,71%	1,19%	3,41%	6,40%	7,25%	10,46%	13,20%	17,85%
BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	7.672.110,91	0,52%	BRDESCO	35,75%	1,01%	3,06%	5,62%	6,38%	9,20%	11,77%	16,41%
URCA FI MULT CRED PRIV	134.906.375,27	9,06%	SANTANDER	33,78%	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	299.920.787,88	20,14%			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	162.820.990,04	10,93%									
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	106.641.276,31	7,16%	SHARP	26,23%	5,51%	-1,23%	-2,23%	5,16%	-10,11%	8,19%	17,08%
FIA SAO CONRADO	6.374.795,62	0,43%	EQUITAS	26,23%	6,75%	-11,40%	-20,25%	-13,32%	-39,00%	-28,05%	-31,16%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	38.031.927,72	2,55%	CONSTANCIA	26,23%	4,90%	-4,10%	-1,61%	2,03%	-9,37%	3,64%	11,33%
FIA PIPA	6.868.099,31	0,46%	XP	26,23%	6,33%	2,01%	4,93%	11,08%	-8,46%	-	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	4.904.891,08	0,33%	CONSTELLATION	26,23%	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	58.650.596,78	3,94%									
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RV	58.650.596,78	3,94%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				4,40%	-4,69%	-7,90%	-1,57%	-16,32%	1,03%	3,22%
RV VALOR	35.508.245,21	2,38%									
VINCI JOATINGA FIA	29.684.042,25	1,99%	VINCI	26,23%	4,64%	-5,23%	-10,95%	-4,40%	-17,09%	-5,37%	5,91%
FIA ITACOATIARA	5.824.202,96	0,39%	INDIE CAPITAL	26,23%	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	30.327.705,75	2,04%									
GRUMARI FIA	30.327.705,75	2,04%	AZ QUEST	26,23%	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	12.613.250,11	0,85%									
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	12.613.250,11	0,85%	BLACKROCK	0,09%	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	83.864.097,84	5,63%			0,14%	3,29%	6,75%	8,20%	10,17%	13,54%	
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				0,19%	2,93%	9,29%	10,90%	21,09%	46,21%	65,23%
MM MACRO	58.446.919,30	3,92%									
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	14.480.355,64	0,97%	QUANTITAS	6,87%	1,60%	4,12%	8,68%	12,92%	13,52%	21,26%	30,66%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	4.993.170,19	0,34%	OCCAM	0,32%	0,03%	2,08%	6,00%	6,75%	8,29%	12,18%	24,81%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	19.766.682,30	1,33%	OCCAM	1,09%	0,03%	2,08%	6,01%	6,75%	8,30%	12,17%	-
PACIFICO MACRO FC FI MULT	4.522.615,31	0,30%	PACIFICO	3,21%	0,87%	0,66%	2,37%	2,52%	1,70%	1,56%	7,95%
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	14.684.095,87	0,99%	ZEITGEIST	0,75%	-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	25.417.178,54	1,71%									
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	25.417.178,54	1,71%	NAVI CAPITAL	5,10%	-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%
Exterior	46.972.446,37	3,15%			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	46.972.446,37	3,15%									
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	46.972.446,37	3,15%	BLACKROCK	1,50%	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 **	28.338.330,15	1,90%			0,83%	4,61%	9,03%	10,51%	19,14%	39,28%	
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				0,09%	2,61%	8,64%	10,13%	19,64%	42,75%	59,37%
Imobiliário **	45.438.107,25	3,05%			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	1.489.521.146,14	100%			2,42%	0,93%	0,07%	1,58%	2,51%	-0,47%	6,76%
Benchmark:	INPC + 4.8% a.a.				-0,21%	1,67%	6,71%	7,85%	15,39%	32,79%	42,94%

- 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.

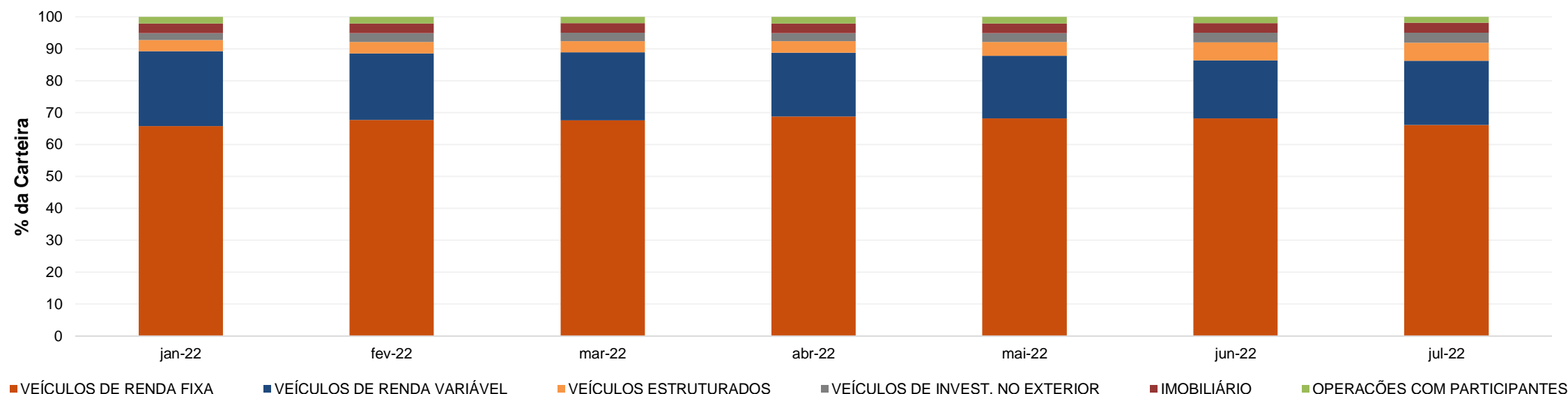
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

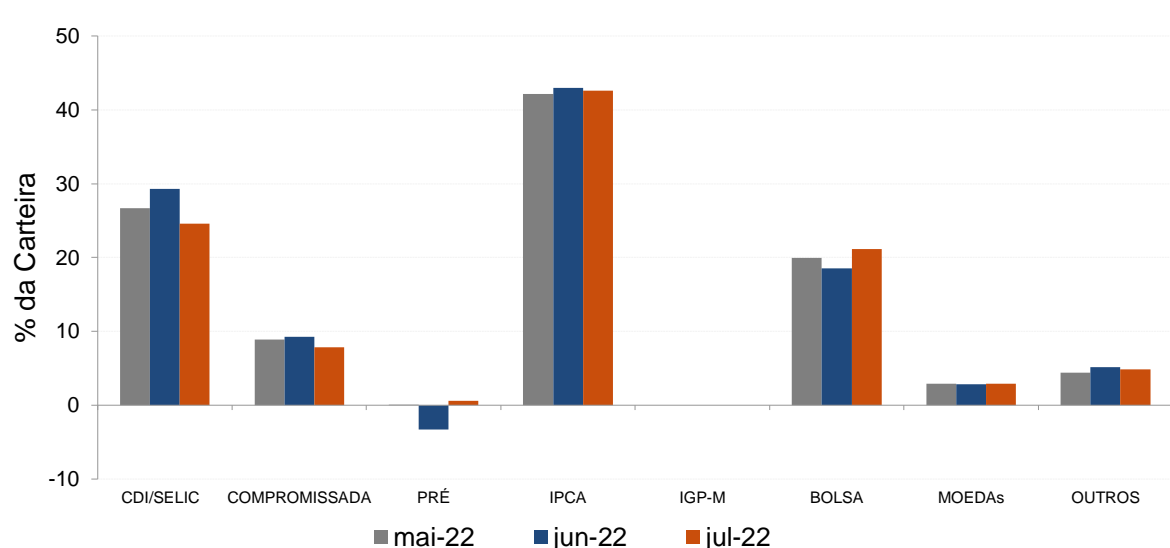
Distribuição da Carteira

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.

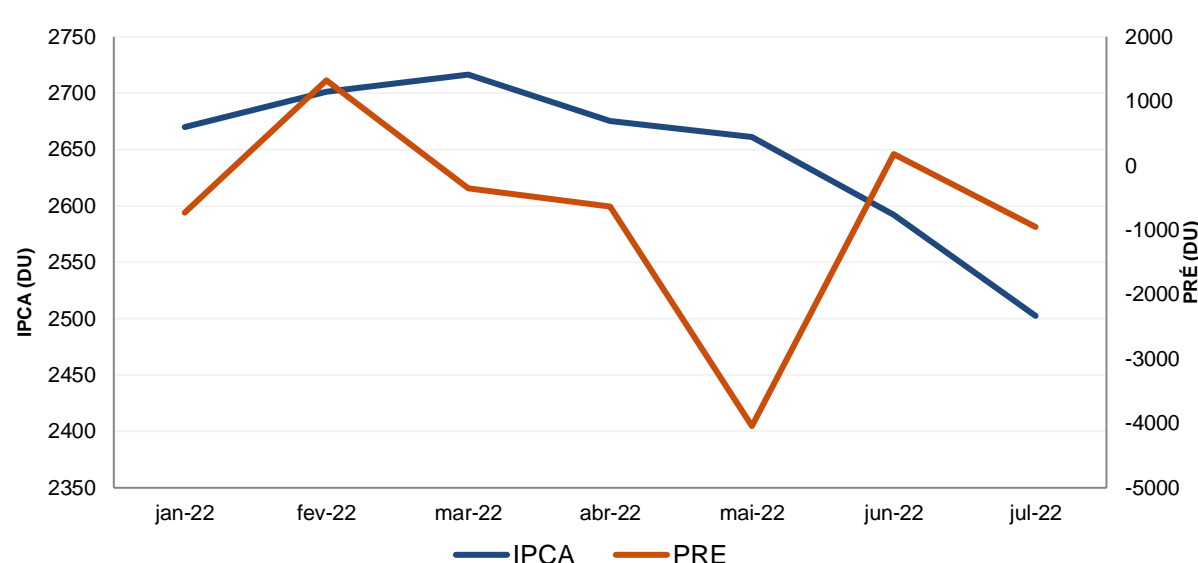
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Setor	Atual*	%	Anterior*	%
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	32.408,55	10,66	22.694,27	8,61
VALE3	Mineração	29.341,90	9,65	33.243,03	12,61
ELET3	Energia Elétrica	14.761,11	4,86	14.854,69	5,63
EQTL3	Energia Elétrica	13.159,92	4,33	11.505,73	4,36
ITUB4	Intermediários Financeiros	11.621,75	3,82	9.883,09	3,75
ITSA4	Intermediários Financeiros	11.313,40	3,72	9.933,40	3,77
BPAC11	Intermediários Financeiros	11.191,04	3,68	10.567,79	4,01
RENT3	Diversos	9.676,73	3,18	3.938,22	1,49
BBAS3	Intermediários Financeiros	8.320,79	2,74	5.568,25	2,11
BBDC4	Intermediários Financeiros	7.804,99	2,57	7.036,03	2,67

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

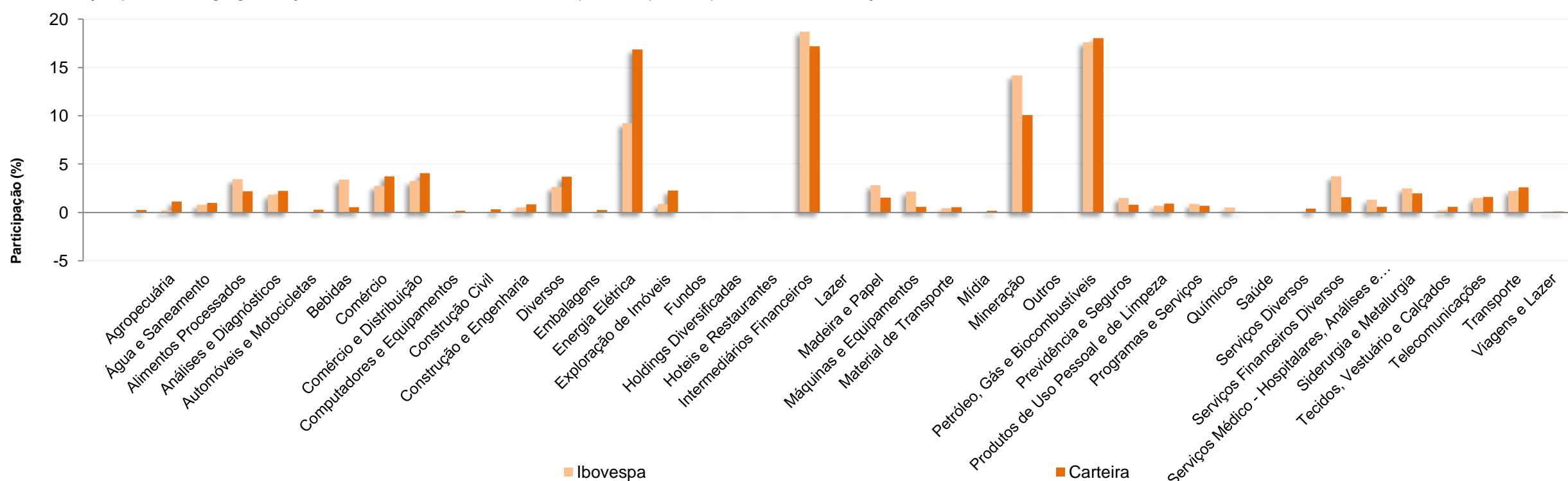
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
MTSA4	213,47	0,07	0,17	25
CRIV4	54,13	0,02	0,06	22
COCE5	402,28	0,13	0,04	6
HBRE3	286,19	0,09	0,25	6
SCAR3	107,99	0,04	0,02	6
EALT4	65,14	0,02	0,07	4
KRSA3	162,81	0,05	0,04	3
BEES3	29,41	0,01	0,05	3
EQPA3	6,03	0,00	0,00	3
TREN3	1.086,39	0,36	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 CD PURO

Data-base: 29/07/2022

Análises de Contrapartes

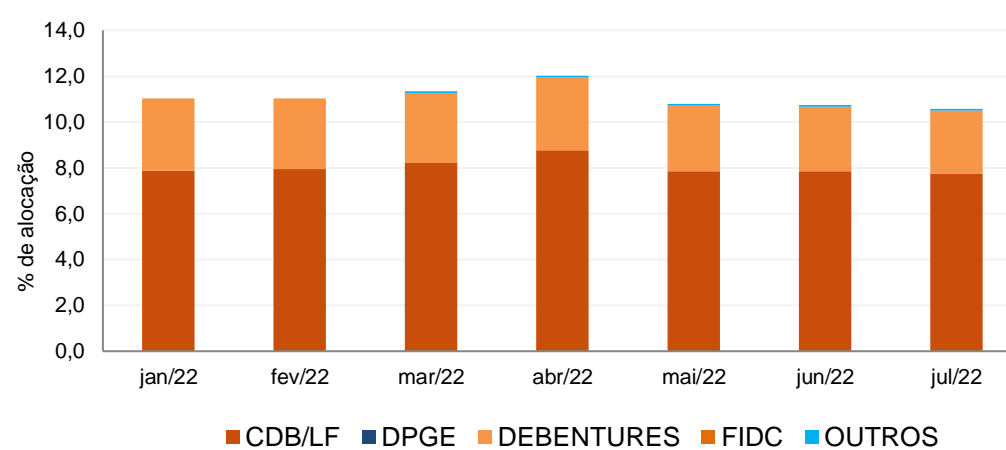
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	69.214,94	4,90	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	38.785,59	2,75	Faixa 2
VALE SA	29.341,90	2,08	Faixa 1
BCO SAFRA SA	19.050,02	1,35	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	17.003,46	1,20	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	15.237,99	1,08	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	13.159,92	0,93	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	11.621,06	0,82	Faixa 1
ITAUSA INVESTS ITAU SA	11.313,40	0,80	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	11.191,04	0,79	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	426,00	TELEFONICA BRASIL SA	Sem Faixa	Faixa 1	12-jul-27	CDI	1,35%	URCA FI MULT CRED PRIV



ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

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	426.003	0,03%	CDI	TELEFONICA BRASIL SA	14-jul-22	1,35%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

