

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

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	1.026.992.097,49	66,51%			1,86%	3,36%	4,62%	7,22%	8,43%	11,79%	15,89%
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	603.421.876,31	39,08%									
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	603.421.876,31	39,08%	100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
RF REFERENCIADO DI	423.570.221,18	27,43%									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	268.116.056,27	17,36%	ALFA	36,52%	1,14%	3,59%	6,73%	9,80%	12,05%	15,73%	19,49%
BRANCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	8.344.486,72	0,54%	BRANCO	38,03%	1,06%	3,26%	6,22%	8,74%	10,69%	13,91%	17,87%
URCA FI MULT CRED PRIV	147.109.678,19	9,53%	SANTANDER	35,96%	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	314.394.464,96	20,36%			-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	173.517.977,00	11,24%									
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	114.187.033,10	7,39%	SHARP	26,18%	0,24%	13,22%	-2,70%	12,85%	5,52%	24,93%	19,96%
FIA SAO CONRADO	6.907.621,83	0,45%	EQUITAS	26,18%	-1,86%	15,93%	-14,98%	-5,86%	-25,63%	-16,57%	-26,41%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	40.102.385,05	2,60%	CONSTANCIA	26,18%	-1,30%	10,85%	-2,42%	7,82%	3,38%	21,48%	15,42%
FIA PIPA	7.235.699,82	0,47%	XP	26,18%	-1,29%	12,27%	4,02%	17,28%	10,12%	15,18%	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	5.085.237,20	0,33%	CONSTELLATION	26,18%	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	59.876.478,70	3,88%									
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RV	59.876.478,70	3,88%	100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				-0,05%	10,77%	-9,10%	4,43%	-1,33%	16,26%	6,28%
RV VALOR	37.927.430,38	2,46%									
VINCI JOATINGA FIA	31.607.567,94	2,05%	VINCI	26,18%	0,72%	11,67%	-8,20%	2,03%	-3,02%	9,25%	9,66%
FIA ITACOATIARA	6.319.862,44	0,41%	INDIE CAPITAL	26,18%	-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	31.391.929,31	2,03%									
GRUMARI FIA	31.391.929,31	2,03%	AZ QUEST	26,18%	-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	11.680.649,56	0,76%									
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	11.680.649,56	0,76%	BLACKROCK	0,08%	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	86.950.183,75	5,63%			1,26%	3,82%	9,12%	12,18%	13,32%	19,63%	17,72%
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				0,47%	1,23%	5,84%	12,05%	17,91%	43,63%	64,14%
MM MACRO	60.271.746,49	3,90%									
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	15.027.857,46	0,97%	QUANTITAS	6,89%	0,85%	5,44%	9,57%	17,19%	17,17%	26,90%	33,44%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	5.144.548,28	0,33%	OCCAM	0,34%	1,88%	3,07%	7,65%	9,98%	10,81%	15,08%	25,11%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	20.366.143,44	1,32%	OCCAM	1,17%	1,88%	3,07%	7,66%	9,99%	10,81%	15,07%	-
PACIFICO MACRO FC FI MULT	4.623.364,22	0,30%	PACIFICO	3,78%	0,52%	3,12%	2,72%	4,80%	5,78%	6,46%	8,84%
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	15.109.833,09	0,98%	ZEITGEIST	0,76%	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	26.678.437,26	1,73%									
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	26.678.437,26	1,73%	NAVI CAPITAL	5,10%	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%
Exterior	42.766.420,56	2,77%			-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	42.766.420,56	2,77%									
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	42.766.420,56	2,77%	BLACKROCK	1,54%	-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	27.511.146,48	1,78%			2,39%	3,78%	9,36%	13,74%	19,30%	40,75%	51,64%
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				0,37%	0,92%	5,19%	11,04%	16,50%	40,21%	58,31%
Imobiliário	45.333.439,42	2,94%			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	1.544.169.076,08	100%			3,01%	1,13%	4,84%	2,35%	6,49%	6,10%	13,93%
Benchmark:	INPC + 4.8% a.a.				0,07%	-0,02%	3,28%	8,05%	12,34%	30,40%	41,97%

* 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.

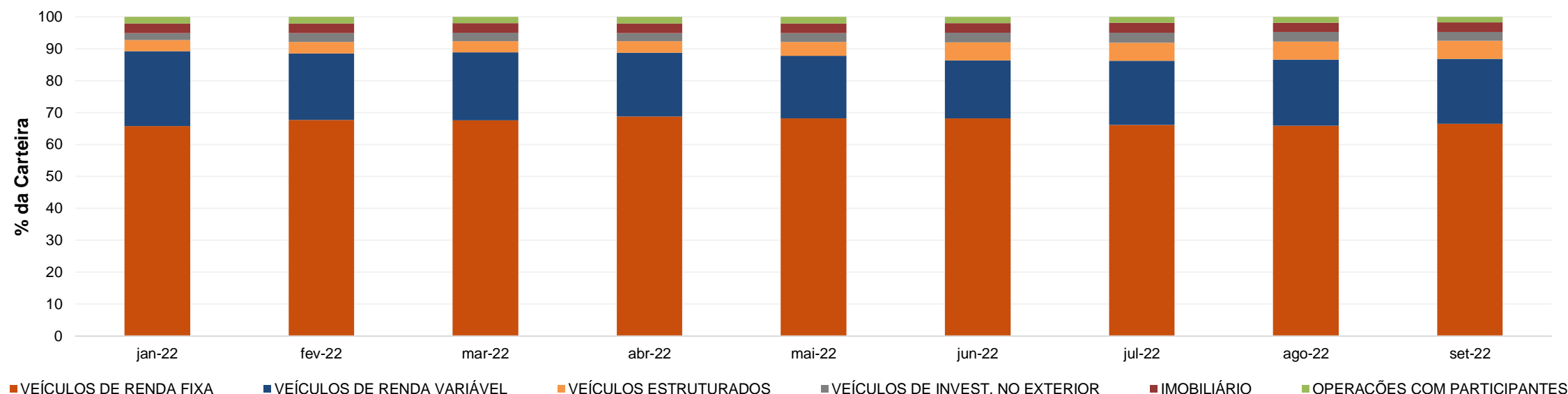
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

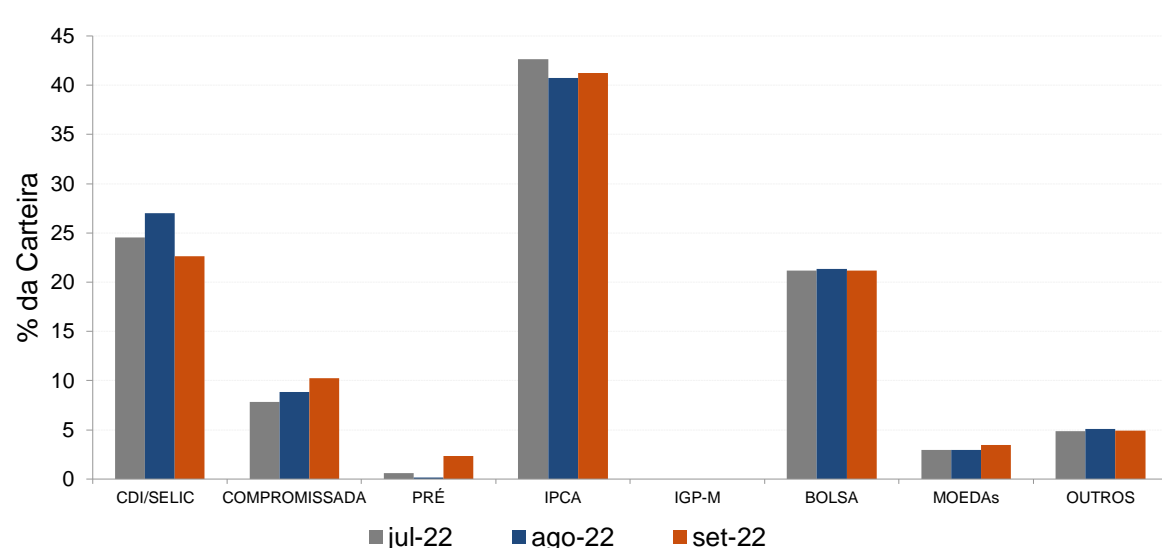
Distribuição da Carteira

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.

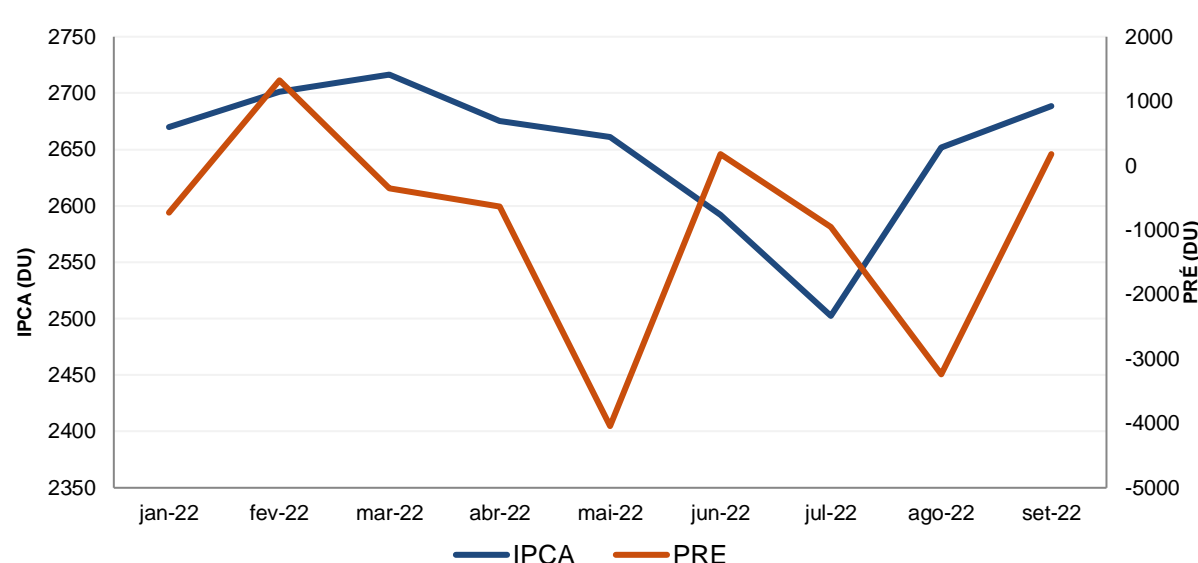
Evolução do Patrimônio Líquido



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	27.288,04	8,86	28.346,91	8,78
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	20.430,42	6,63	31.890,82	9,88
ITSA4	Intermediários Financeiros	15.339,87	4,98	12.667,17	3,93
ELET3	Energia Elétrica	14.736,36	4,78	13.301,05	4,12
EQTL3	Energia Elétrica	13.577,07	4,41	12.880,43	3,99
ITUB4	Intermediários Financeiros	12.400,65	4,02	13.800,95	4,28
RENT3	Diversos	11.587,61	3,76	11.747,31	3,64
BPAC11	Intermediários Financeiros	11.354,46	3,68	13.763,20	4,26
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	8.665,60	2,81	7.797,41	2,42
BBDC4	Intermediários Financeiros	8.604,87	2,79	8.985,38	2,78

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

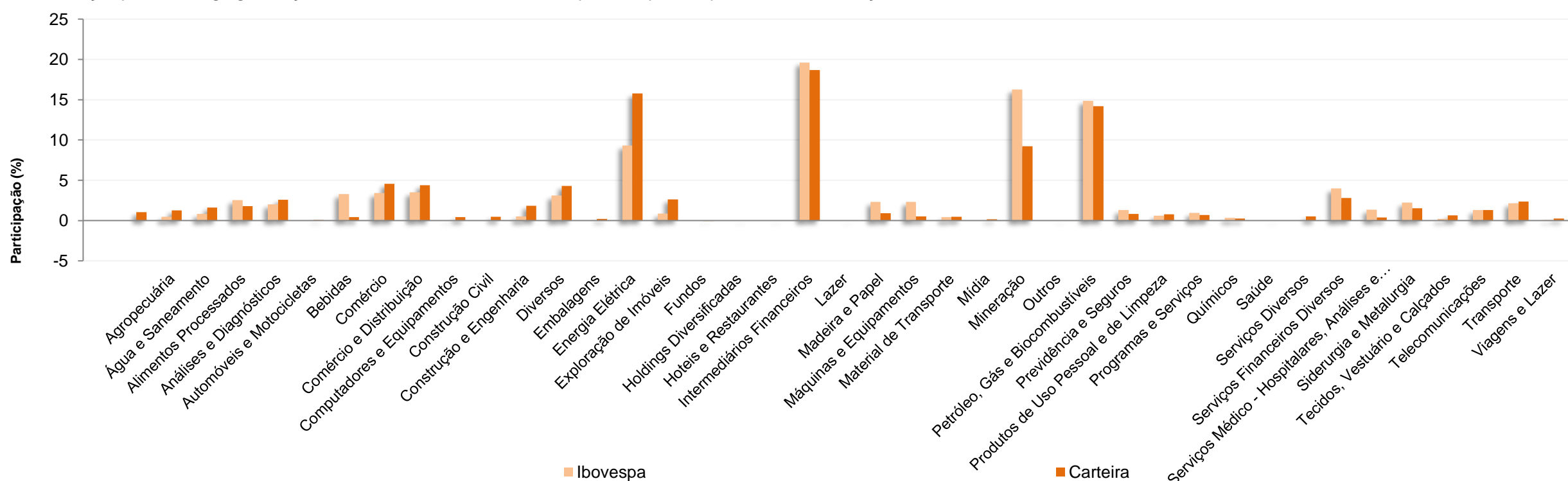
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
MTSA4	243,75	0,08	0,17	23
CRIV4	60,74	0,02	0,06	17
HBRE3	333,66	0,11	0,26	8
SCAR3	105,16	0,03	0,02	8
COCE5	402,11	0,13	0,05	5
ELMD3	558,43	0,18	0,10	3
LAND3	522,03	0,17	0,06	3
EALT4	79,50	0,03	0,07	3
EQPA3	7,75	0,00	0,00	3
ALLD3	165,45	0,05	0,08	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 CD PURO

Data-base: 30/09/2022

Análises de Contrapartes

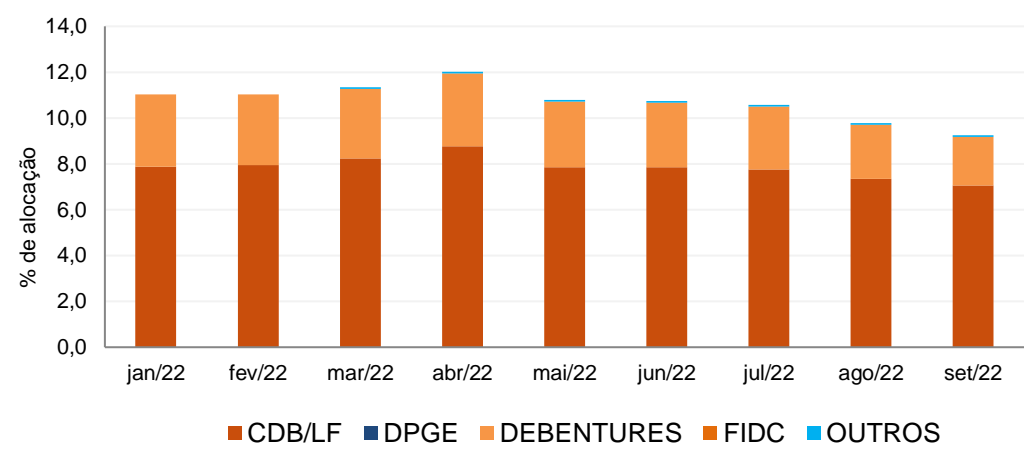
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	61.874,83	4,22	Faixa 1
VALE SA	27.288,04	1,86	Faixa 1
BCO SAFRA SA	20.095,40	1,37	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	20.063,95	1,37	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	16.704,60	1,14	Faixa 2
ITAUSA SA	16.266,02	1,11	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	16.061,18	1,10	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	13.577,07	0,93	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	12.400,05	0,85	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	11.594,12	0,79	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 PURO

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	817.464	0,06%	Selic	06-set-22	0,01%	0,01%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	6.505.882	0,44%	Selic	01-set-22	5,00%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	2.009.366	0,14%	Selic	29-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	549.227	0,04%	Selic	29-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	156.284	0,01%	Selic	23-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	4.679.295	0,32%	Selic	22-set-22	0,09%	0,09%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	2.228.236	0,15%	Selic	05-set-22	0,10%	0,10%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2028-03-01	01-mar-28	545.039	0,04%	Selic	23-set-22	0,17%	0,17%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

