

ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

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	162.789.283,47	54,30%			-0,54%	0,14%	3,75%	3,01%	2,27%	4,74%	23,59%
Benchmark:	CDI				1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	101.124.753,76	33,73%									
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	101.124.753,76	33,73%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
RF REFERENCIADO DI	61.664.529,71	20,57%									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	39.252.388,48	13,09%	ALFA	5,46%	1,19%	3,41%	6,40%	7,25%	10,46%	13,20%	17,85%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.205.991,44	0,40%	BRADESCO	5,62%	1,01%	3,06%	5,62%	6,38%	9,20%	11,77%	16,41%
URCA FI MULT CRED PRIV	21.206.149,80	7,07%	SANTANDER	5,31%	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	79.010.252,56	26,36%			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	42.893.083,99	14,31%									
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	28.093.265,01	9,37%	SHARP	6,91%	5,51%	-1,23%	-2,23%	5,16%	-10,11%	8,19%	17,08%
FIA SAO CONRADO	1.679.357,46	0,56%	EQUITAS	6,91%	6,75%	-11,40%	-20,25%	-13,32%	-39,00%	-28,05%	-31,16%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	10.019.019,47	3,34%	CONSTANCIA	6,91%	4,90%	-4,10%	-1,61%	2,03%	-9,37%	3,64%	11,33%
FIA PIPA	1.809.311,93	0,60%	XP	6,91%	6,33%	2,01%	4,93%	11,08%	-8,46%	-	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	1.292.130,12	0,43%	CONSTELLATION	6,91%	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	15.450.741,17	5,15%									
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	15.450.741,17	5,15%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				4,40%	-4,69%	-7,90%	-1,57%	-16,32%	1,03%	3,22%
RV VALOR	9.354.187,96	3,12%									
VINCI JOATINGA FIA	7.819.877,01	2,61%	VINCI	6,91%	4,64%	-5,23%	-10,95%	-4,40%	-17,09%	-5,37%	5,91%
FIA ITACOATIARA	1.534.310,94	0,51%	INDIE CAPITAL	6,91%	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	7.989.441,84	2,67%									
GRUMARI FIA	7.989.441,84	2,67%	AZ QUEST	6,91%	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	3.322.797,61	1,11%									
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	3.322.797,61	1,11%	BLACKROCK	0,02%	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	21.017.139,14	7,01%			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	14.647.352,88	4,89%									
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	3.628.914,60	1,21%	QUANTITAS	1,72%	1,60%	4,12%	8,68%	12,92%	13,52%	21,26%	30,66%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	1.251.335,86	0,42%	OCCAM	0,08%	0,03%	2,08%	6,00%	6,75%	8,29%	12,18%	24,81%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	4.953.718,25	1,65%	OCCAM	0,27%	0,03%	2,08%	6,01%	6,75%	8,30%	12,17%	-
PACIFICO MACRO FC FI MULT	1.133.410,33	0,38%	PACIFICO	0,80%	0,87%	0,66%	2,37%	2,52%	1,70%	1,56%	7,95%
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	3.679.973,84	1,23%	ZEITGEIST	0,19%	-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	6.369.786,26	2,12%									
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	6.369.786,26	2,12%	NAVI CAPITAL	1,28%	-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	11.940.841,10	3,98%			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	11.940.841,10	3,98%									
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	11.940.841,10	3,98%	BLACKROCK	0,38%	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 **	8.179.905,87	2,73%			-0,06%	3,50%	7,47%	7,49%	16,41%	38,64%	
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				0,09%	2,61%	8,64%	10,13%	19,64%	42,75%	59,37%
Imobiliário **	16.845.322,09	5,62%			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	299.782.744,23	100%			2,74%	1,31%	-0,62%	0,18%	1,37%	-3,09%	21,89%
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.

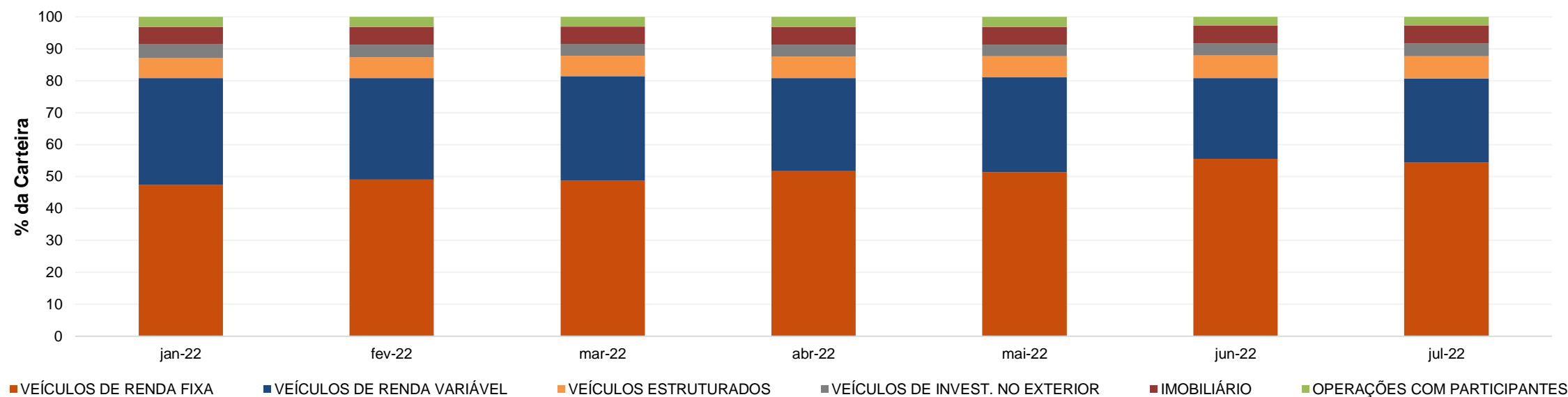
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

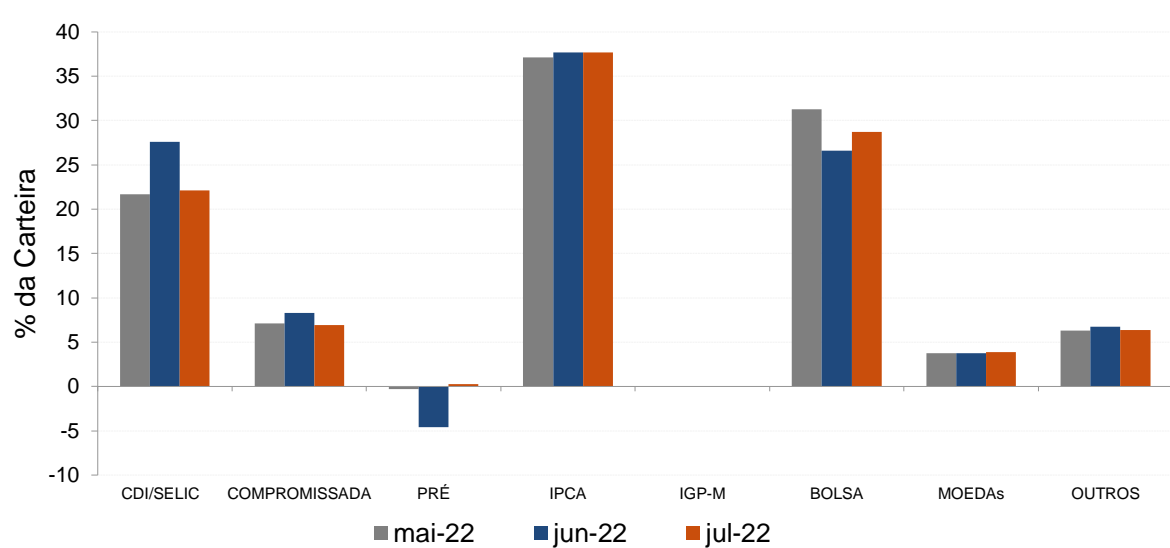
Distribuição da Carteira

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.

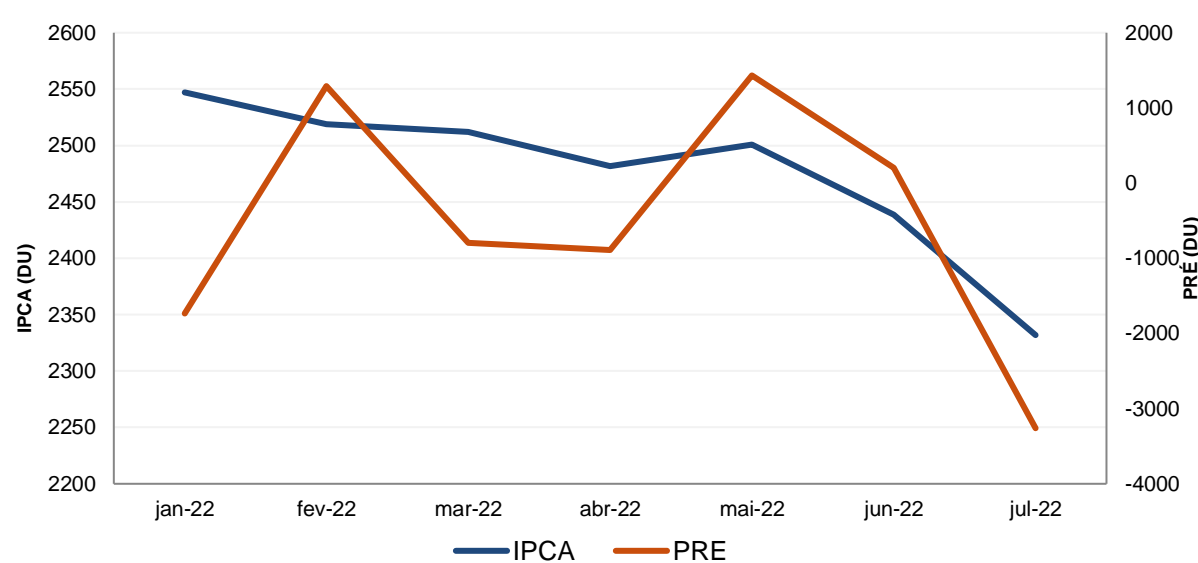
Evolução do Patrimônio Líquido



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	8.491,57	10,63	6.310,10	8,58
VALE3	Mineração	7.720,41	9,67	9.270,46	12,61
ELET3	Energia Elétrica	3.841,12	4,81	4.043,66	5,50
EQTL3	Energia Elétrica	3.449,22	4,32	3.181,99	4,33
ITUB4	Intermediários Financeiros	3.035,98	3,80	2.723,09	3,70
ITSA4	Intermediários Financeiros	2.980,30	3,73	2.781,84	3,78
BPAC11	Intermediários Financeiros	2.933,23	3,67	2.925,83	3,98
RENT3	Diversos	2.545,28	3,19	1.101,69	1,50
BBAS3	Intermediários Financeiros	2.185,95	2,74	1.548,82	2,11
BBDC4	Intermediários Financeiros	2.054,16	2,57	1.967,71	2,68

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

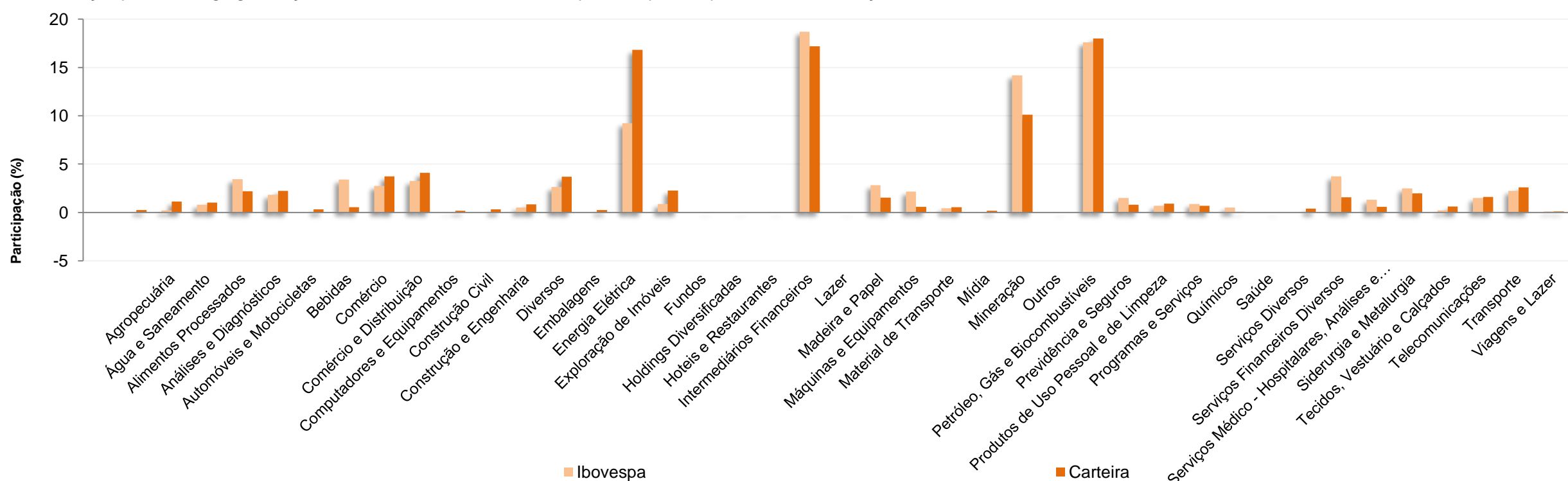
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
MTSA4	56,24	0,07	0,04	7
CRIV4	14,26	0,02	0,02	6
COCE5	105,98	0,13	0,01	2
HBRE3	75,39	0,09	0,07	2
SCAR3	28,45	0,04	0,00	2
PETR4	8.491,57	10,63	0,01	1
VALE3	7.720,41	9,67	0,00	1
ELET3	3.841,12	4,81	0,02	1
EQTL3	3.449,22	4,32	0,01	1
ITUB4	3.035,98	3,80	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.



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 SALDADO

Data-base: 29/07/2022

Análises de Contrapartes

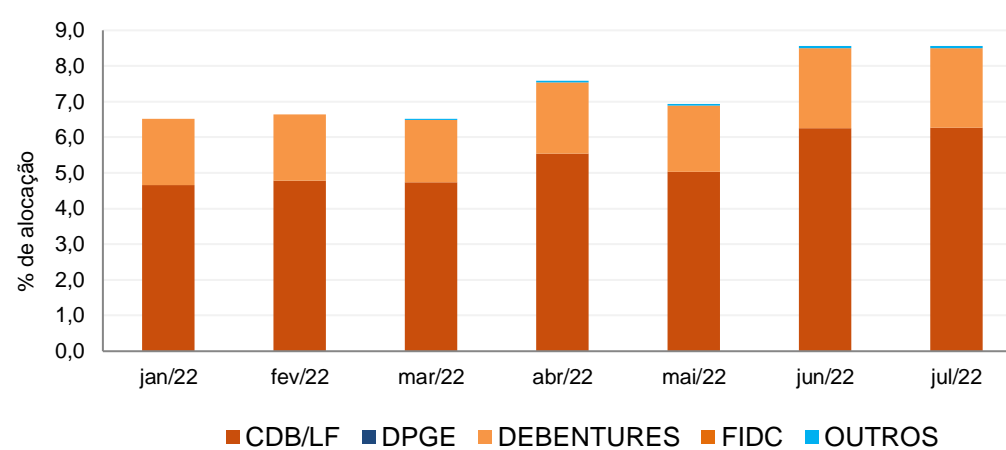
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	11.789,40	4,30	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	9.784,24	3,57	Faixa 2
VALE SA	7.720,41	2,82	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	4.338,67	1,58	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	3.449,22	1,26	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	3.035,80	1,11	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.994,50	1,09	Faixa 1
ITAUSA INVESTS ITAU SA	2.980,30	1,09	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	2.933,23	1,07	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	2.545,28	0,93	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
TLPP27	66,96	TELEFONICA BRASIL SA	Sem Faixa	Faixa 1	12-jul-27	CDI	1,35%	URCA FI MULT CRED PRIV



ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

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	66.964	0,02%	CDI	TELEFONICA BRASIL SA	14-jul-22	1,35%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

