

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

Data-base: 30/06/2022

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	510.747.983,27	68,30%			-0,18%	1,29%	3,80%	3,80%	4,55%	8,76%	12,19%	
Benchmark:	CDI				1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	286.204.587,25	38,27%										
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RF	286.204.587,25	38,27%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%	
RF REFERENCIADO DI	224.543.396,02	30,03%										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	145.533.372,18	19,46%	ALFA	19,45%	1,08%	3,02%	5,99%	5,99%	9,60%	12,17%	17,12%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	4.254.546,21	0,57%	BRADESCO	20,02%	1,00%	2,87%	5,32%	5,32%	8,49%	10,86%	15,89%	
URCA FI MULT CRED PRIV	74.755.477,63	10,00%	SANTANDER	18,91%	0,95%	2,86%	5,76%	5,76%	8,77%	11,30%	16,41%	
Benchmark:	CDI				1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%	
Renda Variável	158.866.687,71	21,24%			-10,96%	-16,05%	-5,41%	-5,41%	-23,07%	3,45%	-7,56%	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				-11,42%	-17,54%	-4,80%	-4,80%	-21,51%	9,14%	6,14%	
RV ATIVO	87.844.128,95	11,75%										
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	57.538.590,40	7,69%	SHARP	14,93%	-10,02%	-14,06%	-0,33%	-0,33%	-18,00%	12,07%	11,65%	
FIA SAO CONRADO	3.399.316,73	0,45%	EQUITAS	14,93%	-15,35%	-26,66%	-18,80%	-18,80%	-46,39%	-27,59%	-33,43%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	20.639.279,68	2,76%	CONSTANCIA	14,93%	-10,96%	-11,98%	-2,73%	-2,73%	-17,05%	7,43%	11,67%	
FIA PIPA	3.676.855,52	0,49%	XP	14,93%	-7,33%	-7,35%	4,46%	4,46%	-17,95%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	2.590.086,61	0,35%	CONSTELLATION	14,93%	-10,95%	-22,03%	-17,97%	-17,97%	-41,80%	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA				-11,50%	-17,88%	-5,99%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-2,40%	
CARTEIRA PRÓPRIA RV	34.310.510,06	4,59%										
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RV	34.310.510,06	4,59%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX				-11,56%	-17,94%	-5,72%	-5,72%	-23,04%	4,91%	0,02%	
RV VALOR	19.329.200,68	2,58%										
VINCI JOATINGA FIA	16.148.191,33	2,16%	VINCI	14,93%	-11,51%	-17,79%	-8,64%	-8,64%	-24,02%	-1,33%	4,22%	
FIA ITACOATIARA	3.181.009,34	0,43%	INDIE CAPITAL	14,93%	-13,65%	-22,83%	-23,02%	-23,02%	-45,00%	-26,70%	-	
Benchmark:	IBOVESPA				-11,50%	-17,88%	-5,99%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-2,40%	
RV SMALL CAP	16.632.905,82	2,22%										
GRUMARI FIA	16.632.905,82	2,22%	AZ QUEST	14,93%	-10,53%	-16,20%	-10,85%	-10,85%	-28,75%	-1,41%	3,67%	
Benchmark:	SMLL				-16,33%	-24,72%	-19,69%	-19,69%	-39,59%	-15,65%	-11,30%	
RV PASSIVO	749.942,20	0,10%										
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	749.942,20	0,10%	BLACKROCK	0,01%	-11,36%	-17,82%	-5,75%	-5,75%	-22,01%	3,77%	-2,34%	
Benchmark:	IBOVESPA				-11,50%	-17,88%	-5,99%	-5,99%	-22,29%	3,67%	-2,40%	
Estruturado	43.977.117,19	5,88%			1,95%	5,10%	8,05%	8,05%	10,28%	12,13%		
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				1,42%	4,55%	10,68%	10,68%	23,11%	47,86%	66,52%	
MM MACRO	30.607.282,15	4,09%										
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	7.483.628,82	1,00%	QUANTITAS	3,52%	0,13%	3,91%	11,14%	11,14%	12,72%	18,78%	29,44%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.621.035,54	0,35%	OCCAM	0,16%	0,97%	4,45%	6,71%	6,71%	8,34%	14,85%	29,35%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	10.376.148,17	1,39%	OCCAM	0,56%	0,96%	4,46%	6,72%	6,72%	8,36%	14,84%	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.354.312,04	0,31%	PACIFICO	1,64%	0,39%	-0,39%	1,64%	1,64%	-0,29%	1,47%	8,52%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	7.772.157,58	1,04%	ZEITGEIST	0,39%	0,38%	2,24%	8,43%	8,43%	15,16%	18,24%	38,74%	
Benchmark:	CDI				1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%	
MM LONG-SHORT	13.369.835,05	1,79%										
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	13.369.835,05	1,79%	NAVI CAPITAL	2,68%	5,05%	8,55%	9,23%	9,23%	12,47%	17,37%	-	
Benchmark:	CDI				1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%	
Exterior	21.593.534,94	2,89%			1,03%	-7,95%	-26,34%	-26,34%	-6,99%	13,68%		
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				1,05%	-7,80%	-26,05%	-26,05%	-11,63%	10,62%	59,76%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	21.593.534,94	2,89%										
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	21.593.534,94	2,89%	BLACKROCK	0,65%	1,03%	-8,04%	-26,18%	-26,18%	-6,80%	18,76%	80,51%	
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				1,05%	-7,80%	-26,05%	-26,05%	-11,63%	10,62%	59,76%	
Operações com Participantes	12.630.916,60	1,69%			1,85%	5,59%	10,40%	10,40%	20,82%	38,76%		
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				1,32%	4,24%	10,03%	10,03%	21,63%	44,34%	60,60%	
Total	747.816.239,71	100%			2,07%	-2,47%	-2,87%	1,41%	1,41%	-2,91%	8,84%	13,11%
Benchmark:	INPC + 4.8% a.a.				1,01%	3,31%	8,08%	8,08%	17,29%	34,23%	44,00%	

* 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.

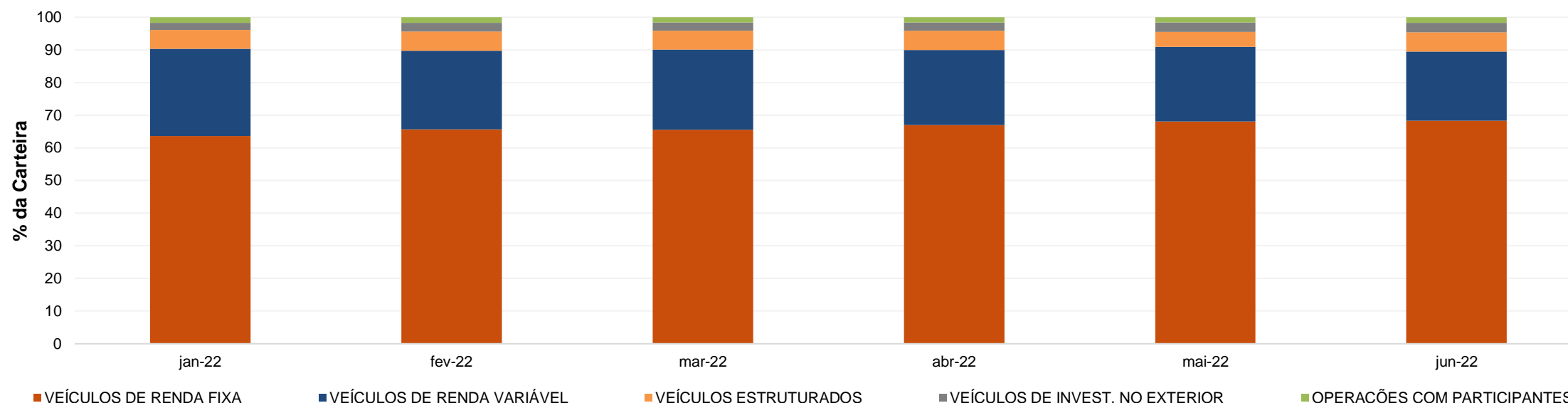
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

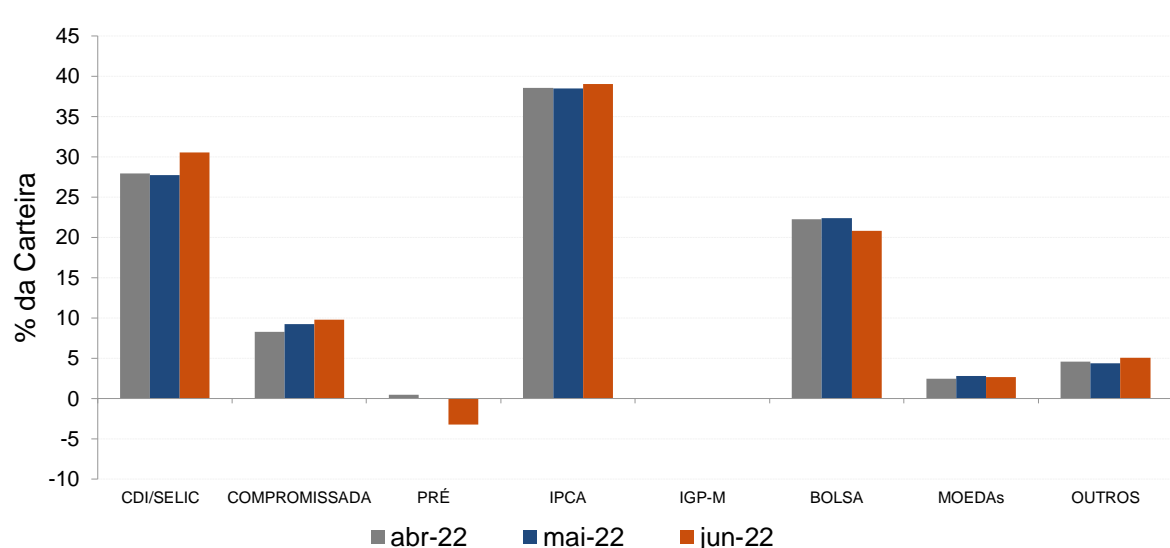
Distribuição da Carteira

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.

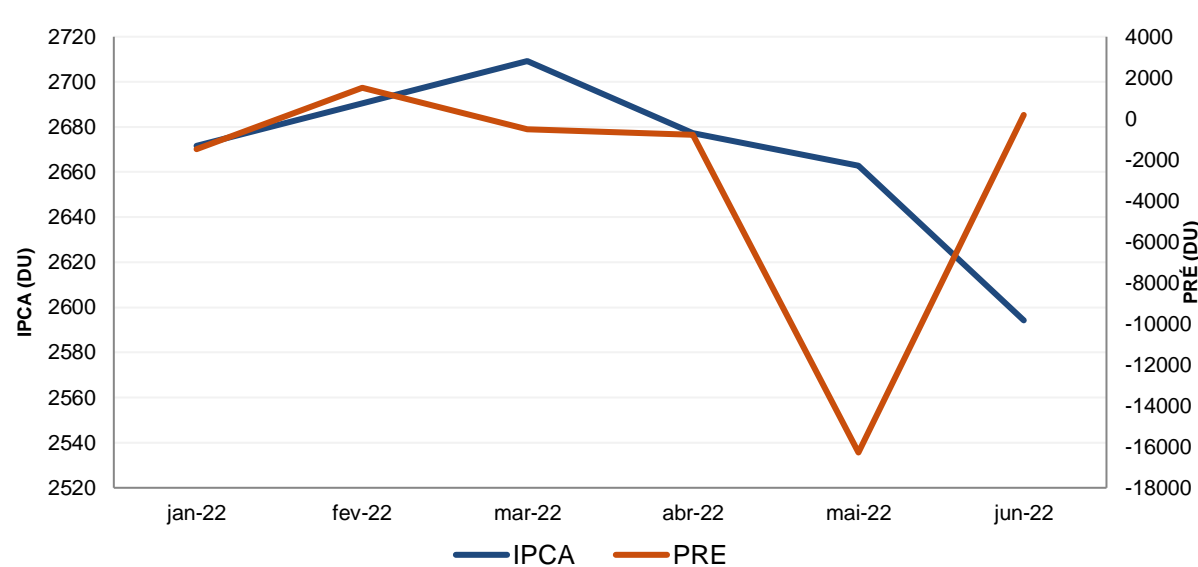
Evolução do Patrimônio Líquido



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	19.523,77	12,61	20.990,89	12,25
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	13.287,42	8,58	15.362,71	8,96
ELET3	Energia Elétrica	8.506,65	5,49	1.401,27	0,82
EQTL3	Energia Elétrica	6.698,80	4,33	7.641,54	4,46
BPAC11	Intermediários Financeiros	6.159,85	3,98	7.209,62	4,21
ITSA4	Intermediários Financeiros	5.859,73	3,79	6.625,03	3,87
ITUB4	Intermediários Financeiros	5.731,75	3,70	6.659,47	3,89
BBDC4	Intermediários Financeiros	4.144,56	2,68	4.013,87	2,34
VBBR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	3.513,24	2,27	4.201,34	2,45
BBAS3	Intermediários Financeiros	3.261,46	2,11	4.701,30	2,74

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

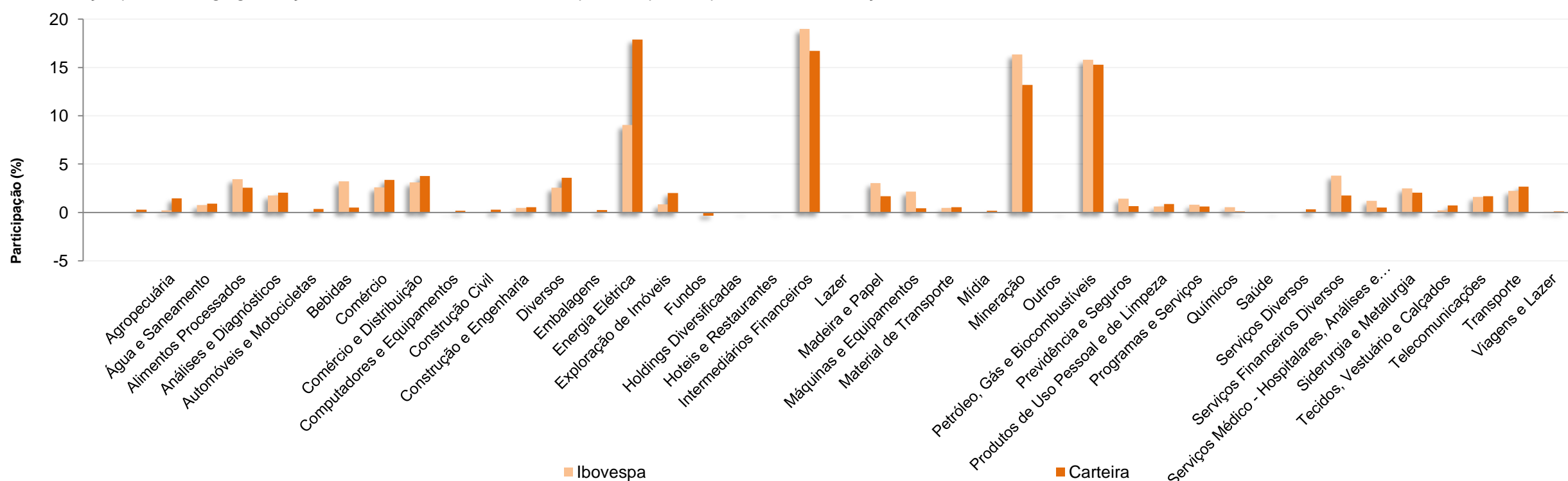
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	31,01	0,02	0,03	30
MTSA4	125,97	0,08	0,10	10
SCAR3	70,19	0,05	0,01	4
COCE5	231,20	0,15	0,02	3
HBRE3	151,40	0,10	0,14	3
LAND3	328,32	0,21	0,04	2
EALT4	35,48	0,02	0,04	2
BEES3	16,20	0,01	0,03	2
VALE3	19.523,77	12,61	0,01	1
PETR4	13.287,42	8,58	0,01	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.

Análises de Contrapartes

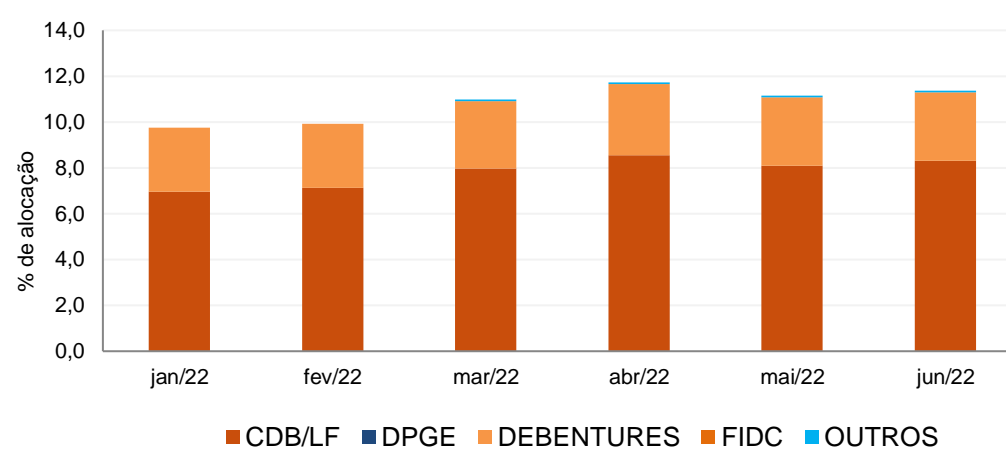
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	38.207,85	5,21	Faixa 1
VALE SA	19.523,77	2,66	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	16.314,27	2,22	Faixa 2
BCO SAFRA SA	10.675,42	1,46	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	9.719,15	1,33	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	8.536,65	1,16	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	6.698,80	0,91	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	6.159,85	0,84	Faixa 2
ITAUSA INVESTS ITAU SA	5.859,73	0,80	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	5.731,35	0,78	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
VSPT11	330,17	FERROVIA CENTRO ATLANTICA SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-jun-26	CDI	1,19%	URCA FI MULT CRED PRIV



ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

Data-base: 30/06/2022

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
BSA325	24-mai-26	340.423	0,05%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	10-jun-22	1,16%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
BSA325	24-mai-26	46.612	0,01%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	08-jun-22	1,18%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
BSA325	24-mai-26	46.213	0,01%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14-jun-22	1,16%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
BSA325	24-mai-26	1.394	0,00%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14-jun-22	1,16%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
VSPT11	20-jun-26	330.169	0,05%	CDI	FERROVIA CENTRO ATLANTICA SA	30-jun-22	1,19%	Faixa 1	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	1.181.308	0,16%	Selic		07-jun-22	0,14%	0,14%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2028-03-01	01-mar-28	20.554	0,00%	Selic		27-jun-22	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP



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.