

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	499.919.779,82	66,20%			-0,35%	0,60%	3,85%	3,44%	4,07%	6,49%	11,80%
Benchmark:	CDI				1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	281.833.700,71	37,32%									
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RF	281.833.700,71	37,32%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
RF REFERENCIADO DI	218.086.079,11	28,88%									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	138.822.099,82	18,38%	ALFA	19,30%	1,19%	3,41%	6,40%	7,25%	10,46%	13,20%	17,85%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	4.265.173,92	0,56%	BRADESCO	19,87%	1,01%	3,06%	5,62%	6,38%	9,20%	11,77%	16,41%
URCA FI MULT CRED PRIV	74.998.805,37	9,93%	SANTANDER	18,78%	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	175.518.279,31	23,24%			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	95.285.359,21	12,62%									
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	62.408.122,67	8,26%	SHARP	15,35%	5,51%	-1,23%	-2,23%	5,16%	-10,11%	8,19%	17,08%
FIA SAO CONRADO	3.730.628,90	0,49%	EQUITAS	15,35%	6,75%	-11,40%	-20,25%	-13,32%	-39,00%	-28,05%	-31,16%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	22.256.871,75	2,95%	CONSTANCIA	15,35%	4,90%	-4,10%	-1,61%	2,03%	-9,37%	3,64%	11,33%
FIA PIPA	4.019.317,84	0,53%	XP	15,35%	6,33%	2,01%	4,93%	11,08%	-8,46%	-	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	2.870.418,05	0,38%	CONSTELLATION	15,35%	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	34.323.235,48	4,54%									
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RV	34.323.235,48	4,54%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				4,40%	-4,69%	-7,90%	-1,57%	-16,32%	1,03%	3,22%
RV VALOR	20.779.973,76	2,75%									
VINCI JOATINGA FIA	17.371.560,19	2,30%	VINCI	15,35%	4,64%	-5,23%	-10,95%	-4,40%	-17,09%	-5,37%	5,91%
FIA ITACOATIARA	3.408.413,57	0,45%	INDIE CAPITAL	15,35%	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	17.748.242,01	2,35%									
GRUMARI FIA	17.748.242,01	2,35%	AZ QUEST	15,35%	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	7.381.468,86	0,98%									
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	7.381.468,86	0,98%	BLACKROCK	0,06%	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	44.037.536,21	5,83%			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	30.690.824,69	4,06%									
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	7.603.720,81	1,01%	QUANTITAS	3,61%	1,60%	4,12%	8,68%	12,92%	13,52%	21,26%	30,66%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.621.943,34	0,35%	OCCAM	0,17%	0,03%	2,08%	6,00%	6,75%	8,29%	12,18%	24,81%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	10.379.602,35	1,37%	OCCAM	0,57%	0,03%	2,08%	6,01%	6,75%	8,30%	12,17%	-
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.374.852,18	0,31%	PACIFICO	1,68%	0,87%	0,66%	2,37%	2,52%	1,70%	1,56%	7,95%
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	7.710.706,01	1,02%	ZEITGEIST	0,39%	-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	13.346.711,52	1,77%									
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	13.346.711,52	1,77%	NAVI CAPITAL	2,68%	-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	23.367.254,03	3,09%			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	23.367.254,03	3,09%									
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	23.367.254,03	3,09%	BLACKROCK	0,75%	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	12.357.071,68	1,64%			1,04%	4,79%	8,57%	10,25%	19,06%	41,96%	
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				0,09%	2,61%	8,64%	10,13%	19,64%	42,75%	59,37%
Total	755.199.921,05	100%			2,50%	1,13%	0,01%	1,39%	2,55%	-0,93%	6,17%
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

* 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.

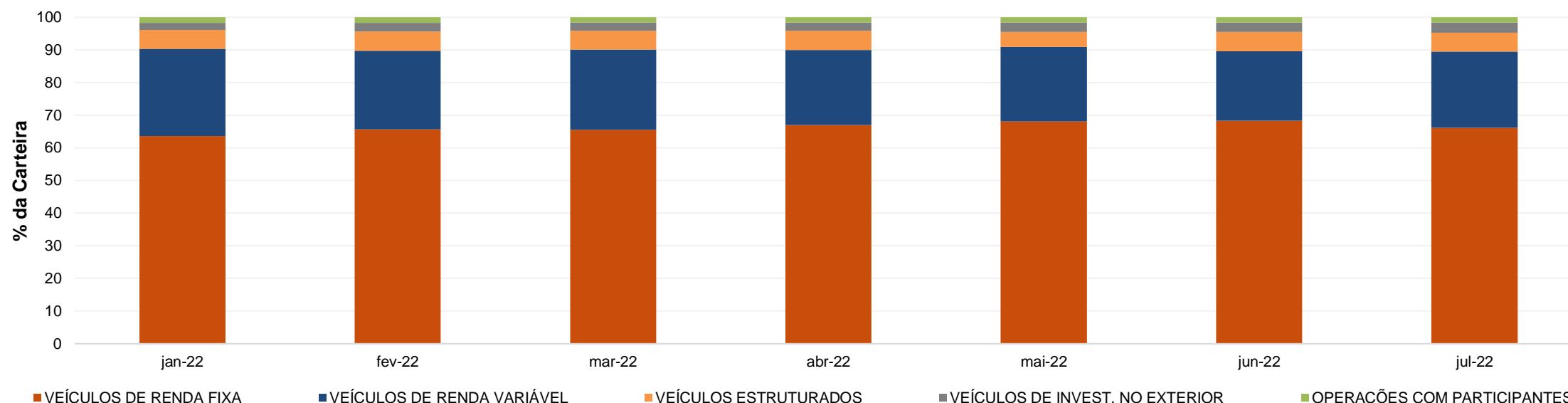
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

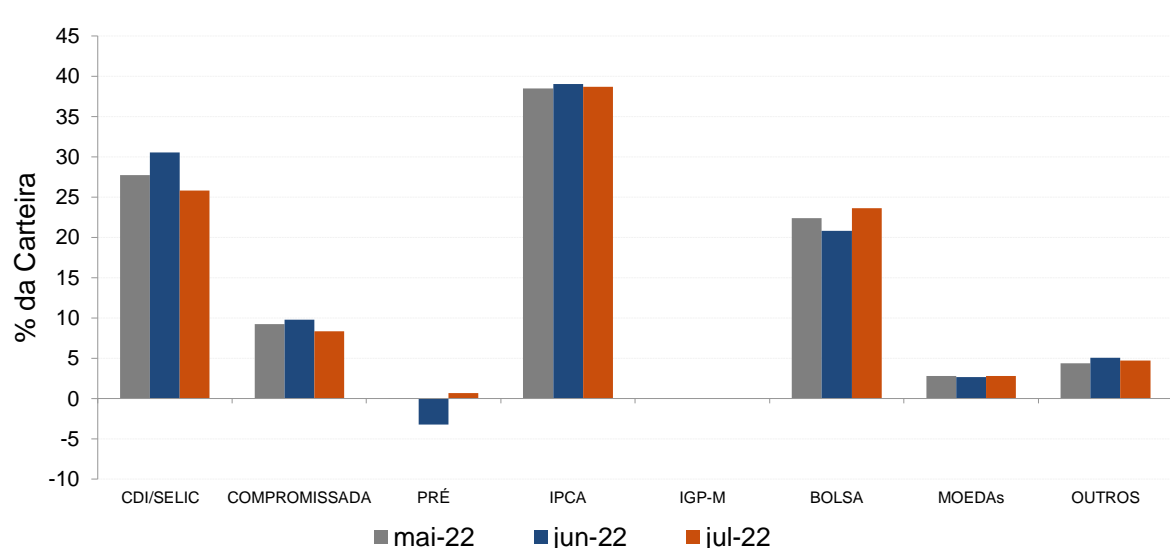
Distribuição da Carteira

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.

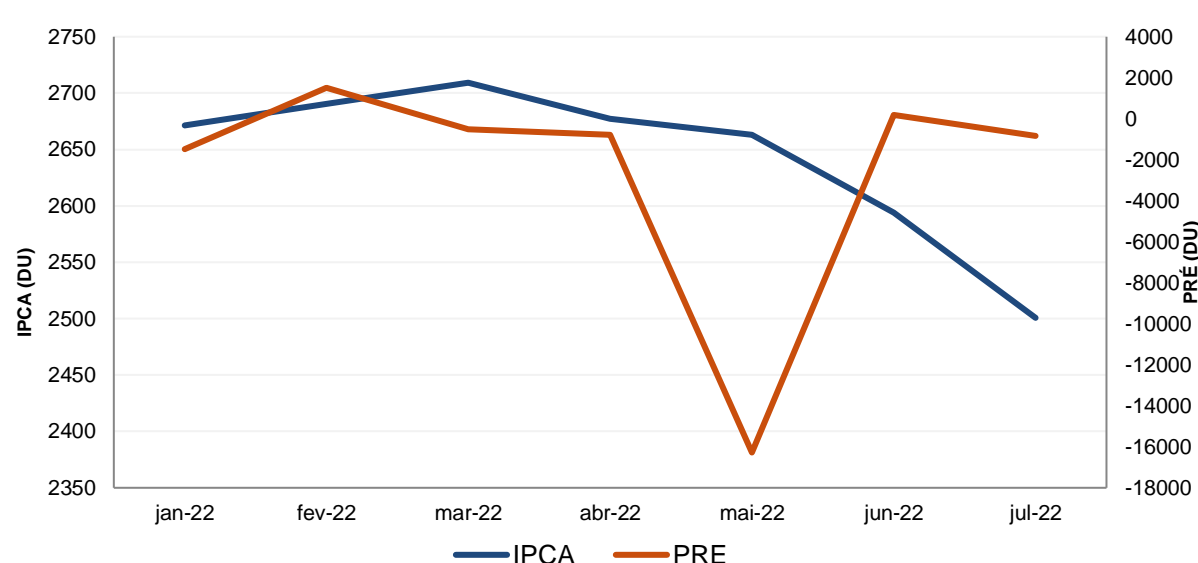
Evolução do Patrimônio Líquido



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	18.750,21	10,60	13.287,42	8,58
VALE3	Mineração	17.127,60	9,68	19.523,77	12,61
ELET3	Energia Elétrica	8.415,85	4,76	8.506,65	5,49
EQTL3	Energia Elétrica	7.618,95	4,31	6.698,80	4,33
ITUB4	Intermediários Financeiros	6.681,16	3,78	5.731,75	3,70
ITSA4	Intermediários Financeiros	6.620,46	3,74	5.859,73	3,79
BPAC11	Intermediários Financeiros	6.479,32	3,66	6.159,85	3,98
RENT3	Diversos	5.644,58	3,19	2.320,50	1,50
BBAS3	Intermediários Financeiros	4.841,11	2,74	3.261,46	2,11
BBDC4	Intermediários Financeiros	4.558,39	2,58	4.144,56	2,68

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

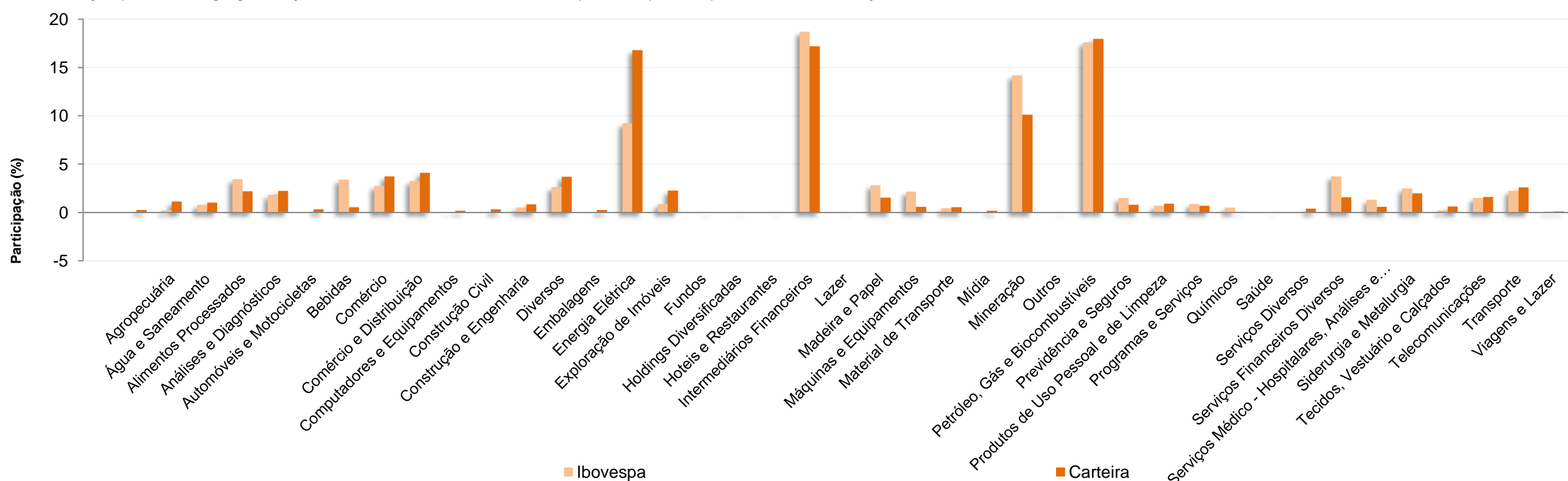
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
MTSA4	124,93	0,07	0,10	15
CRIV4	31,68	0,02	0,03	13
COCE5	235,42	0,13	0,03	4
HBRE3	167,48	0,09	0,15	4
SCAR3	63,19	0,04	0,01	4
LAND3	314,75	0,18	0,04	2
ALLD3	115,35	0,07	0,04	2
KRSA3	95,28	0,05	0,02	2
EALT4	38,12	0,02	0,04	2
BEES3	17,21	0,01	0,03	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 CV ONS

Data-base: 29/07/2022

Análises de Contrapartes

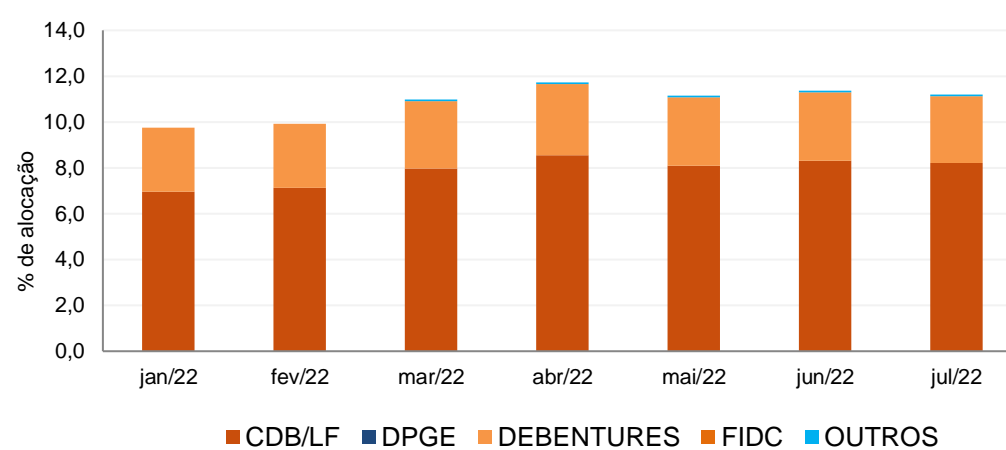
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	38.723,06	5,23	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	22.373,21	3,02	Faixa 2
VALE SA	17.127,60	2,31	Faixa 1
BCO SAFRA SA	10.590,52	1,43	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	9.659,57	1,30	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	8.471,29	1,14	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	7.618,95	1,03	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	6.680,80	0,90	Faixa 1
ITAUSA INVESTS ITAU SA	6.620,46	0,89	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	6.479,32	0,88	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	236,83	TELEFONICA BRASIL SA	Sem Faixa	Faixa 1	12-jul-27	CDI	1,35%	URCA FI MULT CRED PRIV



ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	236.829	0,03%	CDI	TELEFONICA BRASIL SA	14-jul-22	1,35%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

