

## ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

Data-base: 31/08/2022

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>510.827.950,07</b>	<b>65,71%</b>			<b>1,89%</b>	<b>1,35%</b>	<b>5,23%</b>	<b>5,39%</b>	<b>6,50%</b>	<b>9,33%</b>	<b>13,91%</b>
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>280.273.795,80</b>	<b>36,05%</b>									
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RF	280.273.795,80	36,05%	100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>230.554.154,27</b>	<b>29,66%</b>									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	146.937.081,20	18,90%	ALFA	19,83%	1,22%	3,53%	6,76%	8,56%	11,31%	14,41%	18,69%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	4.491.768,38	0,58%	BRADESCO	20,69%	1,15%	3,20%	6,06%	7,60%	10,00%	12,88%	17,17%
URCA FI MULT CRED PRIV	79.125.304,70	10,18%	SANTANDER	19,54%	1,34%	3,41%	6,46%	8,33%	10,60%	13,45%	18,01%
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
<b>Renda Variável</b>	<b>185.699.685,18</b>	<b>23,89%</b>			<b>6,84%</b>	<b>-0,14%</b>	<b>-1,00%</b>	<b>6,07%</b>	<b>-7,00%</b>	<b>10,33%</b>	<b>3,66%</b>
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				6,34%	-1,49%	-2,67%	5,87%	-6,35%	15,46%	16,45%
<b>RV ATIVO</b>	<b>102.250.616,79</b>	<b>13,15%</b>									
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	66.945.700,81	8,61%	SHARP	15,38%	7,06%	1,64%	1,46%	12,58%	-1,58%	20,03%	24,06%
FIA SAO CONRADO	4.136.439,61	0,53%	EQUITAS	15,38%	10,66%	0,00%	-10,45%	-4,08%	-30,93%	-18,96%	-24,65%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	23.878.220,15	3,07%	CONSTANCIA	15,38%	7,07%	0,01%	6,33%	9,24%	-0,12%	17,78%	18,39%
FIA PIPA	4.308.086,17	0,55%	XP	15,38%	6,97%	5,41%	11,20%	18,82%	6,39%	9,31%	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	2.982.170,05	0,38%	CONSTELLATION	15,38%	3,69%	-0,46%	-8,39%	-8,31%	-32,06%	-	-
Benchmark:	IBOVESPA				6,16%	-1,64%	-3,20%	4,48%	-7,79%	10,22%	8,29%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RV</b>	<b>35.190.094,49</b>	<b>4,53%</b>									
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RV	35.190.094,49	4,53%	100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				6,15%	-2,00%	-3,64%	4,48%	-8,18%	10,99%	9,74%
<b>RV VALOR</b>	<b>22.218.716,20</b>	<b>2,86%</b>									
VINCI JOATINGA FIA	18.441.776,78	2,37%	VINCI	15,38%	5,95%	-1,89%	-5,05%	1,29%	-10,34%	5,40%	10,83%
FIA ITACOATIARA	3.776.939,42	0,49%	INDIE CAPITAL	15,38%	10,59%	-0,46%	-10,25%	-11,27%	-29,70%	-21,88%	-
Benchmark:	IBOVESPA				6,16%	-1,64%	-3,20%	4,48%	-7,79%	10,22%	8,29%
<b>RV SMALL CAP</b>	<b>18.853.215,14</b>	<b>2,43%</b>									
GRUMARI FIA	18.853.215,14	2,43%	AZ QUEST	15,38%	6,01%	-1,55%	-3,47%	-1,90%	-13,58%	-1,89%	4,00%
Benchmark:	SMLL				10,90%	-2,42%	-4,48%	-6,34%	-22,25%	-9,05%	-3,57%
<b>RV PASSIVO</b>	<b>7.187.042,55</b>	<b>0,92%</b>									
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	7.187.042,55	0,92%	BLACKROCK	0,05%	6,58%	-1,26%	-2,82%	4,99%	-7,23%	10,59%	8,63%
Benchmark:	IBOVESPA				6,16%	-1,64%	-3,20%	4,48%	-7,79%	10,22%	8,29%
<b>Estruturado</b>	<b>45.091.816,95</b>	<b>5,80%</b>			<b>2,39%</b>	<b>4,54%</b>	<b>8,84%</b>	<b>10,79%</b>	<b>11,96%</b>	<b>16,66%</b>	
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				0,56%	2,19%	8,03%	11,52%	19,71%	45,35%	64,58%
<b>MM MACRO</b>	<b>31.221.592,87</b>	<b>4,02%</b>									
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	7.824.414,03	1,01%	QUANTITAS	3,62%	2,90%	4,69%	12,06%	16,19%	16,61%	24,87%	33,10%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.651.526,81	0,34%	OCCAM	0,17%	1,13%	2,14%	6,90%	7,95%	8,66%	10,83%	23,60%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	10.496.678,88	1,35%	OCCAM	0,59%	1,13%	2,14%	6,91%	7,96%	8,67%	10,82%	-
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.415.277,88	0,31%	PACIFICO	1,90%	1,70%	2,99%	3,51%	4,27%	3,60%	4,29%	9,73%
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	7.833.695,27	1,01%	ZEITGEIST	0,40%	1,59%	1,18%	7,64%	9,29%	14,33%	18,51%	34,75%
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
<b>MM LONG-SHORT</b>	<b>13.870.224,08</b>	<b>1,78%</b>									
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	13.870.224,08	1,78%	NAVI CAPITAL	2,68%	3,92%	8,98%	11,32%	13,32%	14,65%	21,67%	26,31%
Benchmark:	CDI				1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
<b>Exterior</b>	<b>22.520.520,50</b>	<b>2,90%</b>			<b>-3,62%</b>	<b>5,36%</b>	<b>-7,86%</b>	<b>-23,17%</b>	<b>-11,21%</b>	<b>8,35%</b>	
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-4,51%	3,09%	-11,16%	-24,55%	-15,78%	1,28%	53,75%
<b>RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>22.520.520,50</b>	<b>2,90%</b>									
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	22.520.520,50	2,90%	BLACKROCK	0,75%	-3,62%	5,36%	-7,94%	-23,01%	-11,02%	9,10%	74,69%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-4,51%	3,09%	-11,16%	-24,55%	-15,78%	1,28%	53,75%
<b>Operações com Participantes</b>	<b>12.406.531,82</b>	<b>1,60%</b>			<b>1,81%</b>	<b>4,30%</b>	<b>9,09%</b>	<b>12,25%</b>	<b>19,11%</b>	<b>44,72%</b>	
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				0,45%	1,87%	7,37%	10,62%	18,27%	41,89%	58,74%
<b>Total</b>	<b>777.450.479,40</b>	<b>100%</b>			<b>4,53%</b>	<b>1,48%</b>	<b>3,84%</b>	<b>5,51%</b>	<b>3,06%</b>	<b>10,86%</b>	<b>16,17%</b>
Benchmark:	INPC + 4.8% a.a.				0,12%	0,92%	5,41%	7,98%	14,05%	31,96%	42,36%

- 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.

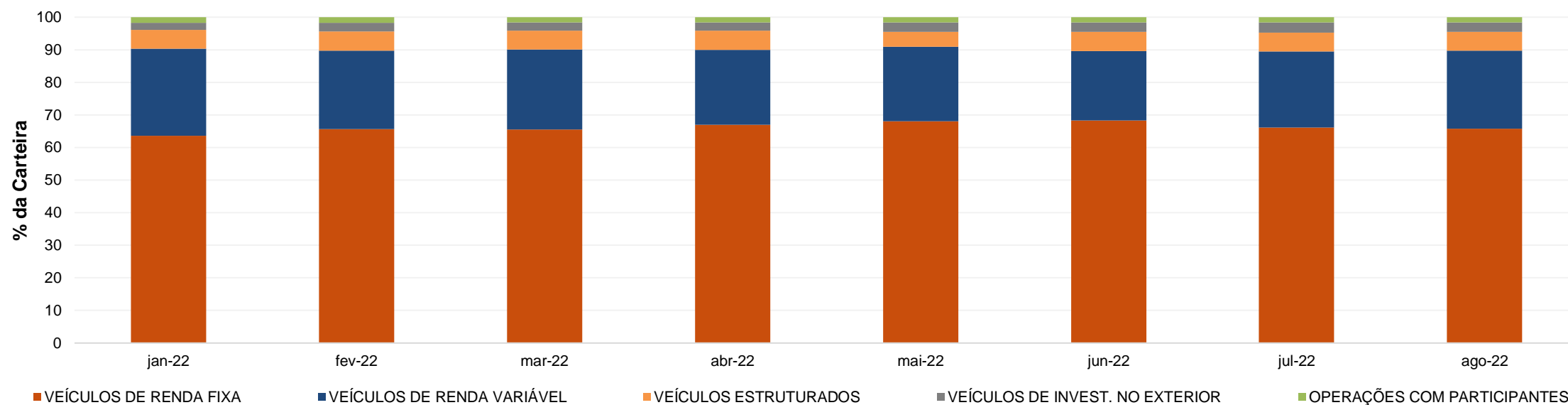
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

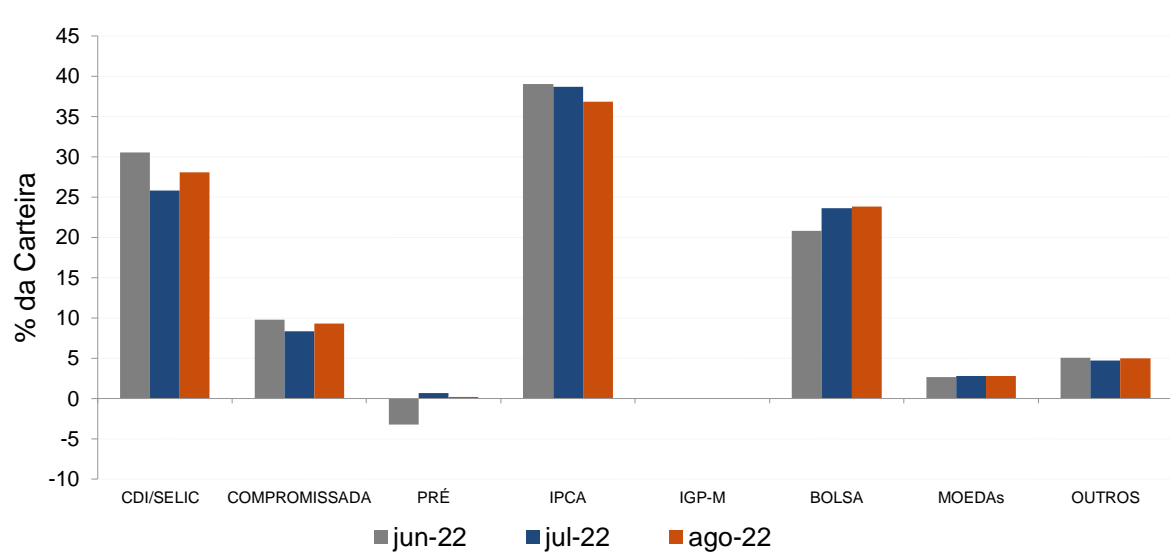
## Distribuição da Carteira

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.

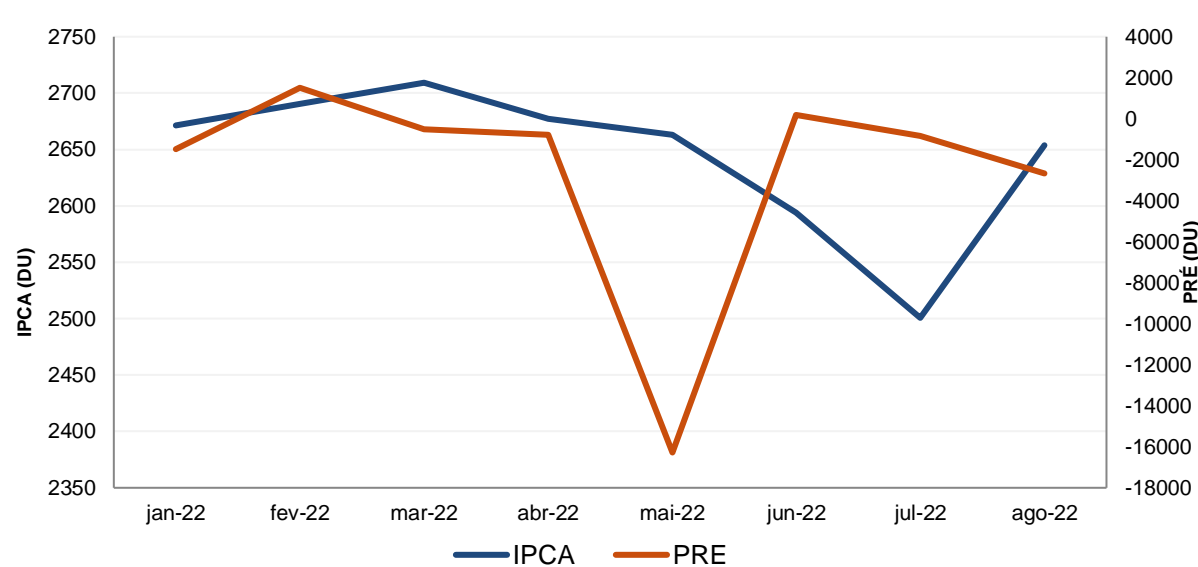
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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	18.506,75	9,83	18.750,21	10,60
VALE3	Mineração	16.572,93	8,80	17.127,60	9,68
BPAC11	Intermediários Financeiros	8.029,26	4,26	6.479,32	3,66
ITUB4	Intermediários Financeiros	7.951,37	4,22	6.681,16	3,78
ELET3	Energia Elétrica	7.610,04	4,04	8.415,85	4,76
EQTL3	Energia Elétrica	7.476,08	3,97	7.618,95	4,31
ITSA4	Intermediários Financeiros	7.400,81	3,93	6.620,46	3,74
RENT3	Diversos	6.869,98	3,65	5.644,58	3,19
BBDC4	Intermediários Financeiros	5.257,81	2,79	4.558,39	2,58
VBBR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	4.882,18	2,59	3.883,82	2,20

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

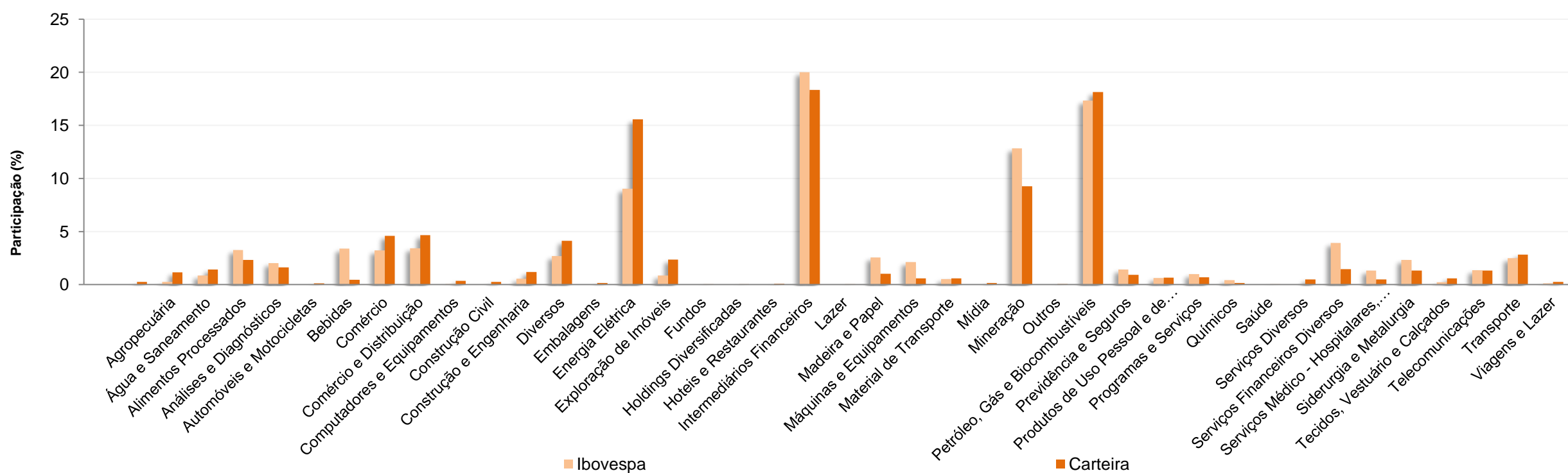
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	34,04	0,02	0,03	29
MTSA4	144,80	0,08	0,10	14
SCAR3	64,89	0,03	0,01	6
HBRE3	217,44	0,12	0,15	5
LAND3	301,17	0,16	0,04	2
COCE5	224,03	0,12	0,03	2
KRSA3	92,37	0,05	0,02	2
PETR4	18.506,75	9,83	0,01	1
VALE3	16.572,93	8,80	0,01	1
BPAC11	8.029,26	4,26	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.



ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

Data-base: 31/08/2022

## Análises de Contrapartes

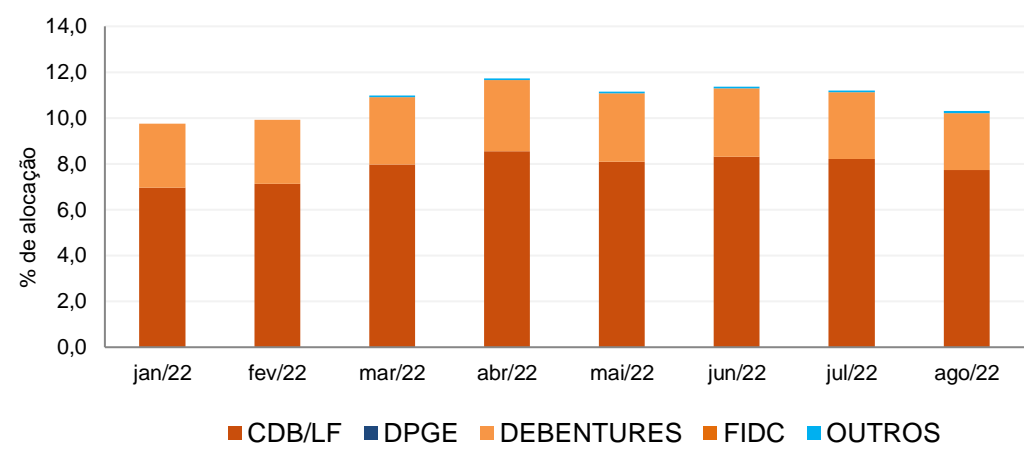
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	36.710,83	4,82	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	20.142,26	2,64	Faixa 2
VALE SA	16.572,93	2,18	Faixa 1
BCO SAFRA SA	10.911,78	1,43	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	8.750,42	1,15	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	8.718,34	1,14	Faixa 2
BCO BTG PACTUAL SA	8.029,26	1,05	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	7.951,07	1,04	Faixa 1
ITAUSA INVESTS ITAU SA	7.898,82	1,04	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	7.476,08	0,98	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 CV ONS

Data-base: 31/08/2022

## 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
BSA316	05-ago-27	395.325	0,05%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	09-ago-22	1,30%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
CSBR11	10-dez-25	84.872	0,01%	CDI	CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÔES	04-ago-22	3,02%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
ITSA15	08-ago-25	355.893	0,05%	CDI	ITAUSA INVESTS ITAU SA	10-ago-22	1,12%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
ITSA25	08-ago-25	142.113	0,02%	CDI	ITAUSA INVESTS ITAU SA	10-ago-22	1,12%	Faixa 2	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	4.156.736	0,55%	Selic		03-ago-22	0,11%	0,11%	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.