

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	521.449.654,70	66,34%			1,81%	3,37%	4,71%	7,30%	8,55%	11,97%	15,97%
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	286.920.021,63	36,50%									
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RF	286.920.021,63	36,50%	100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
RF REFERENCIADO DI	234.529.633,07	29,84%									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	148.455.101,78	18,89%	ALFA	20,22%	1,14%	3,59%	6,73%	9,80%	12,05%	15,73%	19,49%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	4.620.318,69	0,59%	BRADESCO	21,06%	1,06%	3,26%	6,22%	8,74%	10,69%	13,91%	17,87%
URCA FI MULT CRED PRIV	81.454.212,60	10,36%	SANTANDER	19,91%	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	185.257.249,22	23,57%			-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	102.245.639,61	13,01%									
SHARP ARPOADOR IBrX ATIVO FIA	67.284.822,22	8,56%	SHARP	15,42%	0,24%	13,22%	-2,70%	12,85%	5,52%	24,93%	19,96%
FIA SAO CONRADO	4.070.323,00	0,52%	EQUITAS	15,42%	-1,86%	15,93%	-14,98%	-5,86%	-25,63%	-16,57%	-26,41%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	23.630.370,06	3,01%	CONSTANCIA	15,42%	-1,30%	10,85%	-2,42%	7,82%	3,38%	21,48%	15,42%
FIA PIPA	4.263.643,28	0,54%	XP	15,42%	-1,29%	12,27%	4,02%	17,28%	10,12%	15,18%	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	2.996.481,05	0,38%	CONSTELLATION	15,42%	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	35.282.274,21	4,49%									
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RV	35.282.274,21	4,49%	100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				-0,05%	10,77%	-9,10%	4,43%	-1,33%	16,26%	6,28%
RV VALOR	22.348.775,87	2,84%									
VINCI JOATINGA FIA	18.624.790,68	2,37%	VINCI	15,42%	0,72%	11,67%	-8,20%	2,03%	-3,02%	9,25%	9,66%
FIA ITACOATIARA	3.723.985,19	0,47%	INDIE CAPITAL	15,42%	-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	18.497.725,40	2,35%									
GRUMARI FIA	18.497.725,40	2,35%	AZ QUEST	15,42%	-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	6.882.834,12	0,88%									
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	6.882.834,12	0,88%	BLACKROCK	0,05%	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	45.658.057,01	5,81%			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	31.649.051,43	4,03%									
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	7.891.217,05	1,00%	QUANTITAS	3,62%	0,85%	5,44%	9,57%	17,19%	17,17%	26,90%	33,44%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.701.432,80	0,34%	OCCAM	0,18%	1,88%	3,07%	7,65%	9,98%	10,81%	15,08%	25,11%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	10.694.382,67	1,36%	OCCAM	0,62%	1,88%	3,07%	7,66%	9,99%	10,81%	15,07%	-
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.427.755,96	0,31%	PACIFICO	1,98%	0,52%	3,12%	2,72%	4,80%	5,78%	6,46%	8,84%
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	7.934.262,94	1,01%	ZEITGEIST	0,40%	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	14.009.005,58	1,78%									
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	14.009.005,58	1,78%	NAVI CAPITAL	2,68%	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	21.274.893,29	2,71%			-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	21.274.893,29	2,71%									
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	21.274.893,29	2,71%	BLACKROCK	0,77%	-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	12.276.675,07	1,56%			-0,04%	2,83%	8,05%	12,21%	17,39%	43,75%	53,77%
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				0,37%	0,92%	5,19%	11,04%	16,50%	40,21%	58,31%
Total	786.047.972,57	100%			3,09%	1,04%	5,14%	2,12%	6,61%	13,72%	16,19%
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.

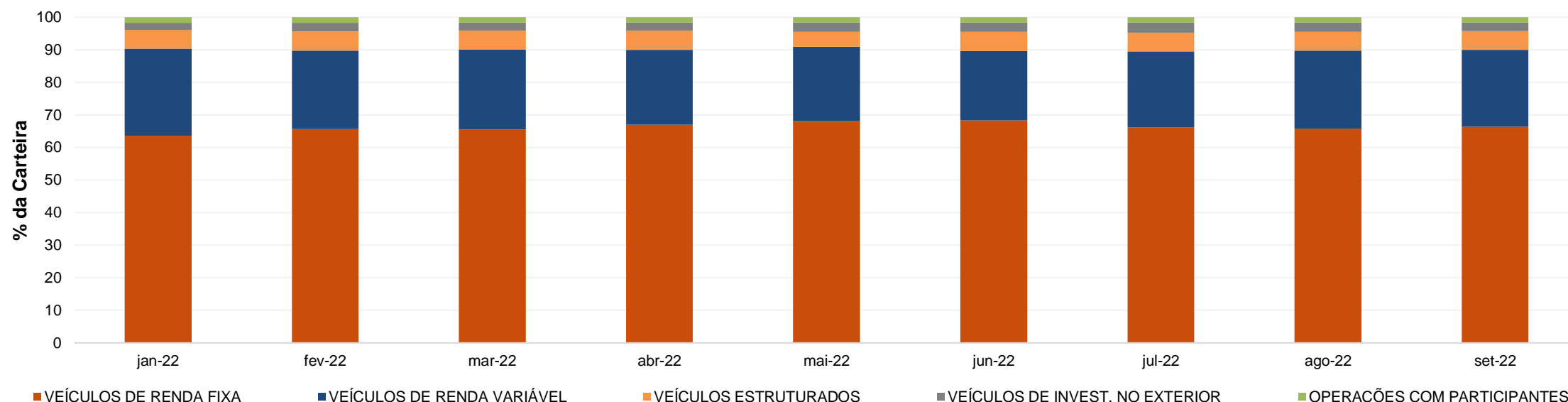
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

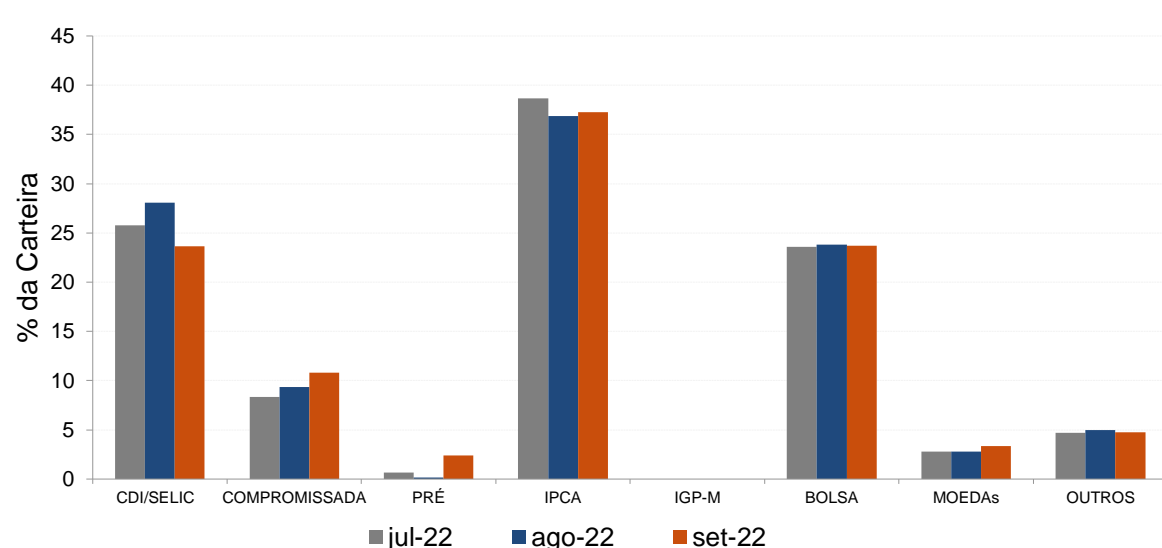
Distribuição da Carteira

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.

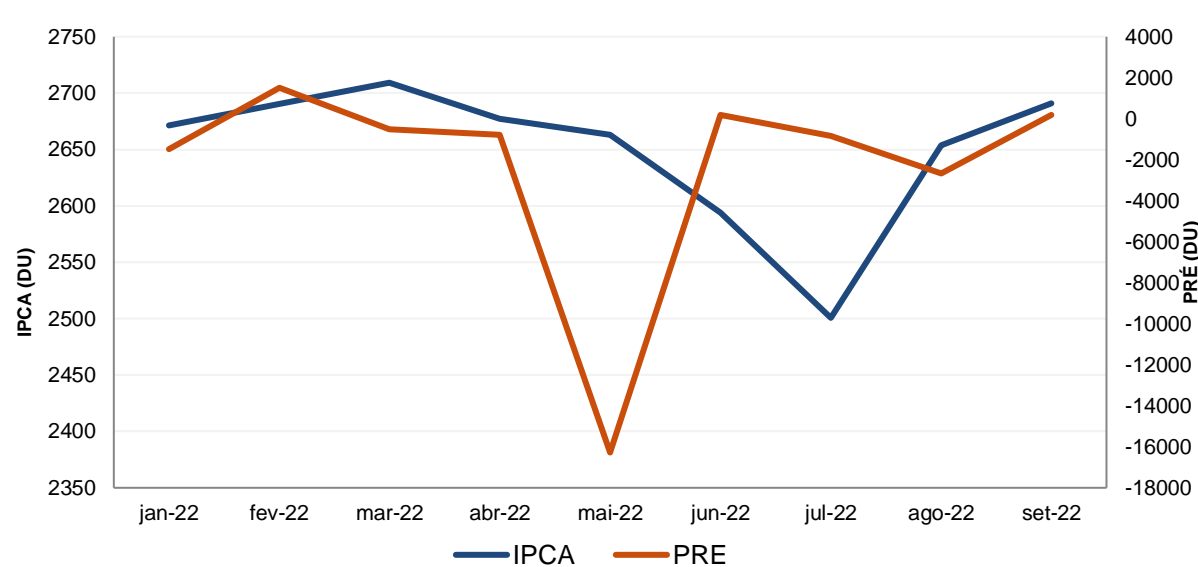
Evolução do Patrimônio Líquido



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	16.112,53	8,90	16.572,93	8,80
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	11.899,54	6,57	18.506,75	9,83
ITSA4	Intermediários Financeiros	8.990,80	4,96	7.400,81	3,93
ELET3	Energia Elétrica	8.548,54	4,72	7.610,04	4,04
EQTL3	Energia Elétrica	7.904,53	4,36	7.476,08	3,97
ITUB4	Intermediários Financeiros	7.190,94	3,97	7.951,37	4,22
RENT3	Diversos	6.813,66	3,76	6.869,98	3,65
BPAC11	Intermediários Financeiros	6.650,70	3,67	8.029,26	4,26
BBDC4	Intermediários Financeiros	5.105,53	2,82	5.257,81	2,79
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	5.091,73	2,81	4.579,50	2,43

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

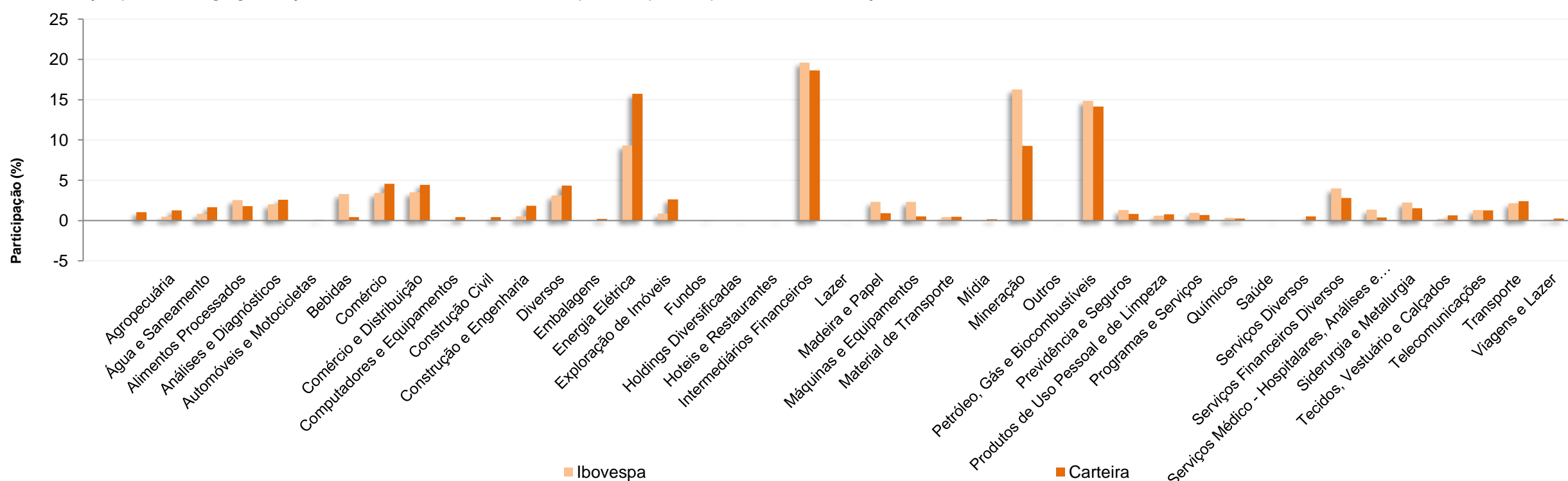
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
MTSA4	143,63	0,08	0,10	14
CRIV4	35,79	0,02	0,03	10
HBRE3	196,61	0,11	0,15	5
SCAR3	61,96	0,03	0,01	5
COCE5	236,95	0,13	0,03	3
ELMD3	329,06	0,18	0,06	2
LAND3	307,61	0,17	0,04	2
EALT4	46,84	0,03	0,04	2
EQPA3	4,57	0,00	0,00	2
VALE3	16.112,53	8,90	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 CV ONS

Data-base: 30/09/2022

Análises de Contrapartes

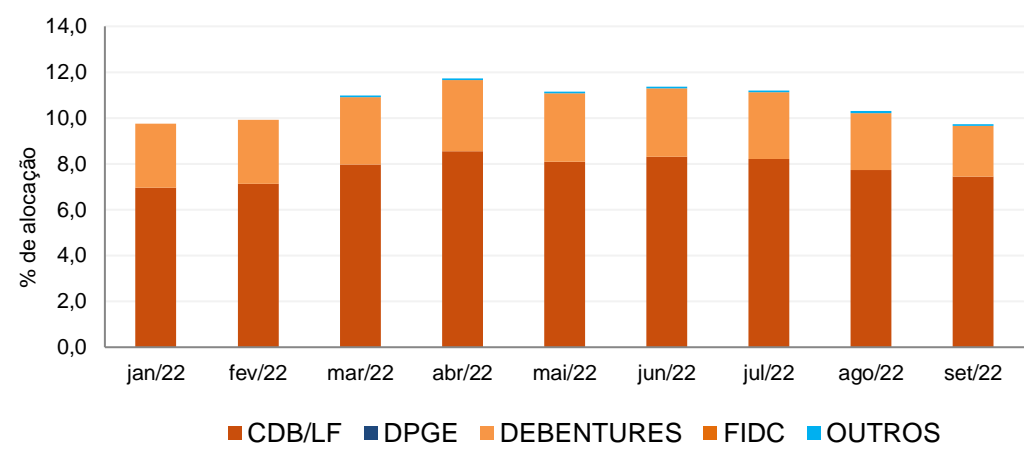
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	34.613,45	4,49	Faixa 1
VALE SA	16.112,53	2,09	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	11.791,98	1,53	Faixa 2
BCO SAFRA SA	11.126,77	1,44	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	9.631,72	1,25	Faixa 2
ITAUSA SA	9.503,61	1,23	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	8.893,03	1,15	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	7.904,53	1,03	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	7.190,62	0,93	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	6.817,49	0,88	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: 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	452.627	0,06%	Selic	06-set-22	0,01%	0,01%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	3.602.288	0,47%	Selic	01-set-22	5,00%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	1.112.580	0,14%	Selic	29-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	304.105	0,04%	Selic	29-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	86.534	0,01%	Selic	23-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	2.590.913	0,34%	Selic	22-set-22	0,09%	0,09%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	1.233.768	0,16%	Selic	05-set-22	0,10%	0,10%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2028-03-01	01-mar-28	301.787	0,04%	Selic	23-set-22	0,17%	0,17%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

