

ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

Data-base: 31/05/2022

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	195.337.837,23	51,35%			1,14%	3,84%	4,18%	3,96%	4,58%	9,30%	16,39%	
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	128.816.292,56	33,86%										
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	128.816.292,56	33,86%	100%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%	
RF REFERENCIADO DI	66.521.544,67	17,49%										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	43.895.032,49	11,54%	ALFA	5,60%	1,10%	3,12%	5,74%	4,86%	8,79%	11,26%	16,41%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.217.805,08	0,32%	BRADESCO	5,79%	1,01%	2,77%	5,03%	4,27%	7,73%	9,99%	15,27%	
URCA FI MULT CRED PRIV	21.408.707,10	5,63%	SANTANDER	5,46%	1,12%	2,95%	5,58%	4,76%	8,13%	10,68%	15,86%	
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%	
Renda Variável	112.889.420,99	29,68%			2,69%	-0,83%	8,69%	6,23%	-12,88%	26,46%	19,19%	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				3,41%	-1,19%	11,05%	7,47%	-10,68%	34,48%	24,92%	
RV ATIVO	62.030.433,42	16,31%										
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	40.468.407,57	10,64%	SHARP	9,45%	4,04%	-0,18%	13,00%	10,77%	-8,07%	36,97%	29,64%	
FIA SAO CONRADO	2.541.440,39	0,67%	EQUITAS	9,45%	-1,95%	-10,45%	-2,62%	-4,07%	-34,05%	-8,26%	-17,85%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	14.668.973,74	3,86%	CONSTANCIA	9,45%	2,68%	6,32%	12,72%	9,23%	-7,41%	29,26%	32,08%	
FIA PIPA	2.510.904,82	0,66%	XP	9,45%	3,52%	5,49%	15,12%	12,72%	-8,90%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	1.840.706,88	0,48%	CONSTELLATION	9,45%	-0,19%	-7,96%	-9,45%	-7,89%	-33,49%	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA				3,22%	-1,58%	9,26%	6,23%	-11,78%	27,40%	14,76%	
CARTEIRA PRÓPRIA RV	23.368.570,44	6,14%										
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	23.368.570,44	6,14%	100%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX				3,23%	-1,68%	9,95%	6,61%	-12,43%	29,27%	17,73%	
RV VALOR	13.879.792,55	3,65%										
VINCI JOATINGA FIA	11.548.526,24	3,04%	VINCI	9,45%	2,34%	-3,22%	3,52%	3,24%	-14,72%	21,92%	24,94%	
FIA ITACOATIARA	2.331.266,31	0,61%	INDIE CAPITAL	9,45%	0,60%	-9,83%	-7,39%	-10,86%	-35,80%	-	-	
Benchmark:	IBOVESPA				3,22%	-1,58%	9,26%	6,23%	-11,78%	27,40%	14,76%	
RV SMALL CAP	12.797.811,07	3,36%										
GRUMARI FIA	12.797.811,07	3,36%	AZ QUEST	9,45%	-0,71%	-1,96%	1,83%	-0,36%	-19,04%	19,37%	21,80%	
Benchmark:	SMLL				-1,82%	-2,10%	-0,37%	-4,02%	-26,87%	15,36%	13,41%	
RV PASSIVO	812.813,52	0,21%										
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	812.813,52	0,21%	BLACKROCK	0,01%	3,66%	-1,58%	8,98%	6,33%	-11,60%	27,32%	14,62%	
Benchmark:	IBOVESPA				3,22%	-1,58%	9,26%	6,23%	-11,78%	27,40%	14,76%	
Estruturado	25.523.005,15	6,71%										
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				1,29%	5,72%	10,89%	9,13%	23,09%	47,39%	65,39%	
MM MACRO	17.006.827,43	4,47%										
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	5.000.941,67	1,31%	QUANTITAS	2,31%	2,34%	7,04%	10,83%	10,99%	13,14%	19,12%	29,47%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	1.737.078,20	0,46%	OCCAM	0,11%	1,07%	4,66%	5,68%	5,69%	7,51%	14,98%	30,44%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	6.876.902,96	1,81%	OCCAM	0,36%	1,07%	4,67%	5,70%	5,70%	7,53%	14,97%	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	1.569.235,99	0,41%	PACIFICO	0,99%	-0,60%	0,51%	2,66%	1,24%	-0,91%	1,49%	9,97%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	1.822.668,61	0,48%	ZEITGEIST	0,09%	1,45%	6,39%	8,90%	8,02%	16,61%	17,78%	44,11%	
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%	
MM LONG-SHORT	8.516.177,72	2,24%										
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	8.516.177,72	2,24%	KONDOR	1,79%	0,86%	2,15%	4,79%	3,98%	9,30%	12,86%	-	
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%	
Exterior	13.541.960,78	3,56%										
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-4,02%	-13,83%	-24,29%	-26,82%	-15,23%	13,24%	63,68%	
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	13.541.960,78	3,56%										
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	13.541.960,78	3,56%	BLACKROCK	0,39%	-4,28%	-12,63%	-23,54%	-26,93%	-9,87%	20,70%	85,43%	
Benchmark:	MSCIWORLD				-4,02%	-13,83%	-24,29%	-26,82%	-15,23%	13,24%	63,68%	
Operações com Participantes **	11.868.655,85	3,12%										
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				1,18%	5,40%	10,22%	8,59%	21,61%	43,88%	59,52%	
Imobiliário **	21.237.232,68	5,58%										
Benchmark:	INPC				0,45%	3,23%	5,73%	4,96%	11,90%	21,85%	24,35%	
Total	380.398.112,68	100%			3,00%	1,33%	1,82%	4,56%	3,36%	-1,87%	15,73%	26,88%
Benchmark:	INPC + 4.8% a.a.				0,86%	4,45%	8,24%	6,99%	17,27%	33,81%	43,08%	

- Rentabilidades de Carteiras, Segmentos e Planos foram informados pela (o) ELETROS

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 29/04/2022

* 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.

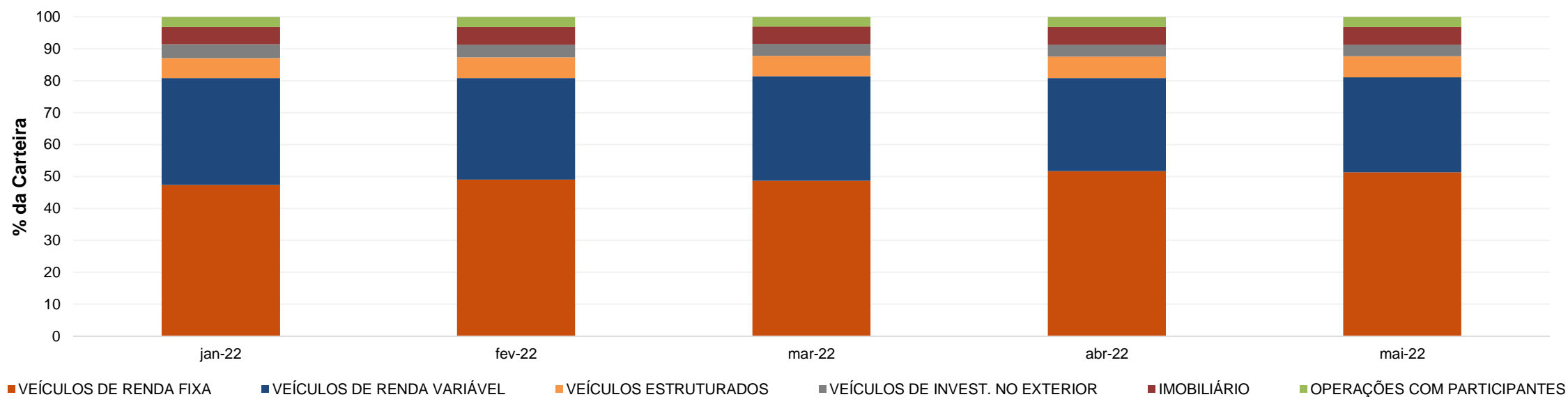
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

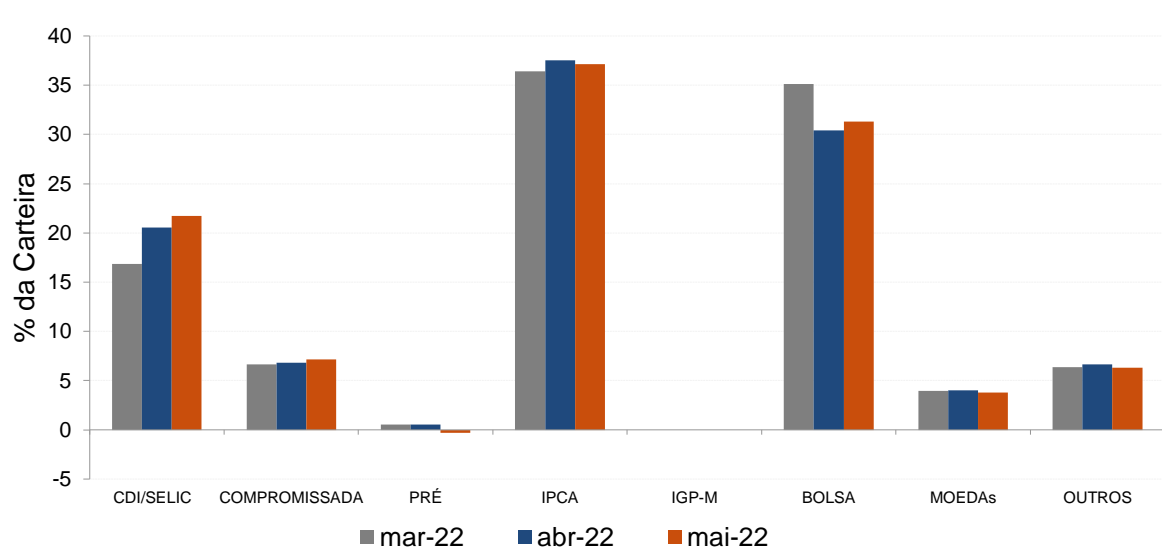
Distribuição da Carteira

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.

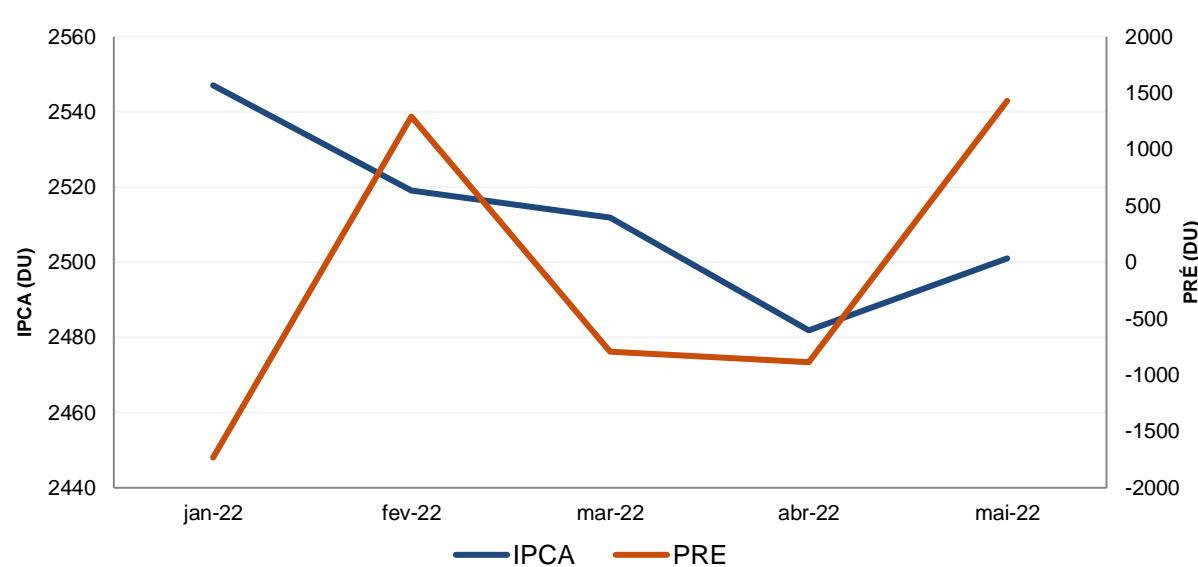
Evolução do Patrimônio Líquido



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*	%
VALE3	Mineração	13.570,35	12,23	13.145,27	12,24
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	9.997,16	9,01	9.709,41	9,04
EQTL3	Energia Elétrica	4.978,70	4,49	5.492,00	5,11
BPAC11	Intermediários Financeiros	4.686,89	4,23	4.454,36	4,15
ITUB4	Intermediários Financeiros	4.354,29	3,93	3.792,04	3,53
ITSA4	Intermediários Financeiros	4.273,64	3,85	4.036,02	3,76
BBAS3	Intermediários Financeiros	3.053,40	2,75	2.342,56	2,18
VBBR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	2.743,44	2,47	2.787,13	2,59
BBDC4	Intermediários Financeiros	2.587,42	2,33	2.162,80	2,01
LREN3	Comércio	2.461,97	2,22	2.143,12	1,99

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

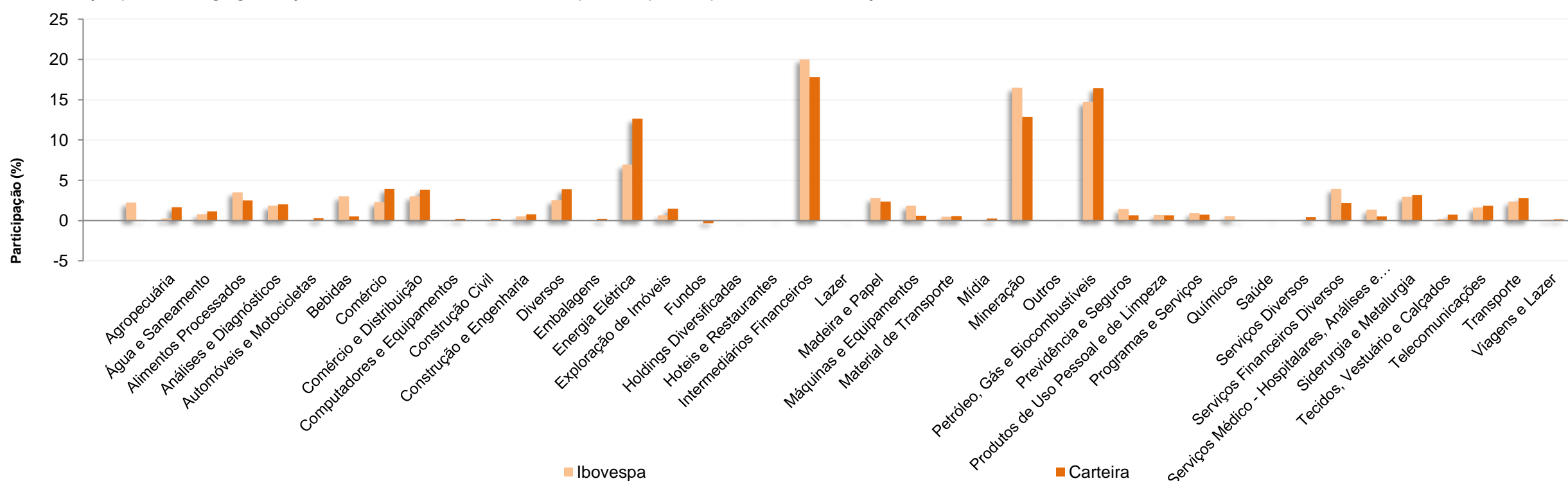
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	20,37	0,02	0,02	44
HBRE3	137,59	0,12	0,08	4
MTSA4	82,31	0,07	0,06	4
SCAR3	51,35	0,05	0,01	3
LAND3	206,53	0,19	0,02	2
EALT4	24,18	0,02	0,03	2
VALE3	13.570,35	12,23	0,00	1
PETR4	9.997,16	9,01	0,01	1
EQTL3	4.978,70	4,49	0,02	1
BPAC11	4.686,89	4,23	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: 31/05/2022

Análises de Contrapartes

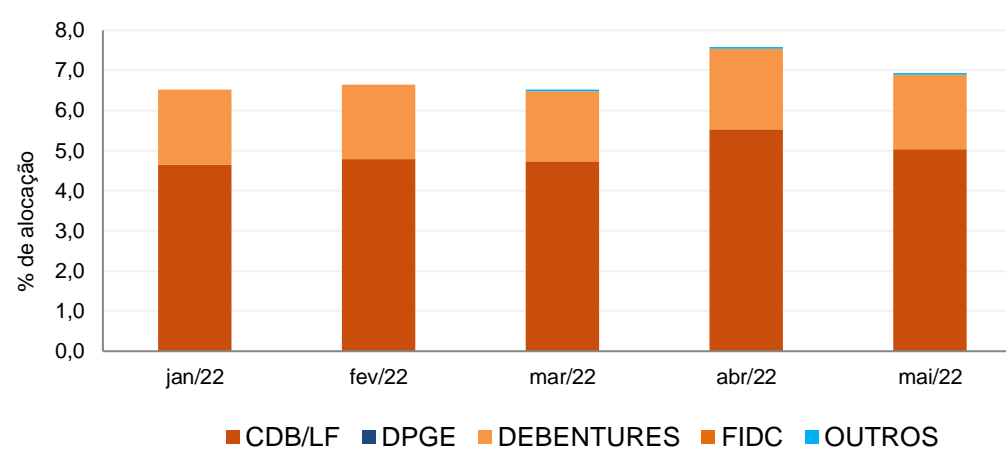
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
VALE SA	13.570,35	3,91	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	12.493,57	3,60	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	11.293,93	3,26	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	4.978,70	1,44	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	4.686,89	1,35	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4.354,51	1,26	Faixa 1
ITAUSA INVESTS ITAU SA	4.273,64	1,23	Faixa 2
BCO SAFRA SA	3.074,31	0,89	Faixa 1
BCO BRASIL SA	3.053,40	0,88	Faixa 2
VIBRA ENERGIA SA	2.743,44	0,79	Sem Faixa

* 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 CD SALDADO

Data-base: 31/05/2022

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
MRVEA8	24-ago-25	176.716	0,05%	CDI	MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES SA	11-mai-22	1,84%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	575.608	0,17%	Selic		24-mai-22	6,00%	0,06%	GRUMARI FIA
LFT 2023-09-01	01-set-23	553.469	0,16%	Selic		24-mai-22	6,00%	0,06%	GRUMARI FIA
LFT 2023-09-01	01-set-23	332.081	0,10%	Selic		24-mai-22	6,00%	0,06%	GRUMARI FIA
LFT 2023-09-01	01-set-23	99.624	0,03%	Selic		24-mai-22	6,00%	0,06%	GRUMARI FIA
LFT 2023-09-01	01-set-23	59.032	0,02%	Selic		13-mai-22	7,00%	0,07%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-03-01	01-mar-24	99.557	0,03%	Selic		24-mai-22	0,09%	0,00%	GRUMARI FIA
LFT 2024-09-01	01-set-24	281.609	0,08%	Selic		13-mai-22	0,12%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	16.988	0,00%	Selic		12-mai-22	0,15%	0,15%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

