

ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

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	165.591.408,18	54,09%			-0,38%	1,17%	3,57%	3,57%	2,65%	7,34%	24,27%	
Benchmark:	CDI				1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	102.752.611,06	33,56%										
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	102.752.611,06	33,56%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				1,01%	2,91%	5,40%	5,40%	8,66%	11,12%	16,25%	
RF REFERENCIADO DI	62.838.797,12	20,52%										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	40.727.726,62	13,30%	ALFA	5,44%	1,08%	3,02%	5,99%	5,99%	9,60%	12,17%	17,12%	
BRASESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.190.640,97	0,39%	BRASESCO	5,60%	1,00%	2,87%	5,32%	5,32%	8,49%	10,86%	15,89%	
URCA FI MULT CRED PRIV	20.920.429,53	6,83%	SANTANDER	5,29%	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	75.421.769,54	24,63%			-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	41.703.894,91	13,62%										
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	27.316.376,82	8,92%	SHARP	7,09%	-10,02%	-14,06%	-0,33%	-0,33%	-18,00%	12,07%	11,65%	
FIA SAO CONRADO	1.613.821,54	0,53%	EQUITAS	7,09%	-15,35%	-26,66%	-18,80%	-18,80%	-46,39%	-27,59%	-33,43%	
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	9.798.473,29	3,20%	CONSTANCIA	7,09%	-10,96%	-11,98%	-2,73%	-2,73%	-17,05%	7,43%	11,67%	
FIA PIPA	1.745.582,75	0,57%	XP	7,09%	-7,33%	-7,35%	4,46%	4,46%	-17,95%	-	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	1.229.640,51	0,40%	CONSTELLATION	7,09%	-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	16.288.873,52	5,32%										
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	16.288.873,52	5,32%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX				-11,56%	-17,94%	-5,72%	-5,72%	-23,04%	4,91%	0,02%	
RV VALOR	9.176.514,85	3,00%										
VINCI JOATINGA FIA	7.666.334,48	2,50%	VINCI	7,09%	-11,51%	-17,79%	-8,64%	-8,64%	-24,02%	-1,33%	4,22%	
FIA ITACOATIARA	1.510.180,37	0,49%	INDIE CAPITAL	7,09%	-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	7.896.452,10	2,58%										
GRUMARI FIA	7.896.452,10	2,58%	AZ QUEST	7,09%	-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	356.034,16	0,12%										
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	356.034,16	0,12%	BLACKROCK	0,00%	-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	20.988.303,88	6,86%			1,95%	5,10%	8,05%	8,05%	10,28%	13,39%		
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				1,42%	4,55%	10,68%	10,68%	23,11%	47,86%	66,52%	
MM MACRO	14.607.481,79	4,77%										
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	3.571.600,09	1,17%	QUANTITAS	1,68%	0,13%	3,91%	11,14%	11,14%	12,72%	18,78%	29,44%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	1.250.902,60	0,41%	OCCAM	0,08%	0,97%	4,45%	6,71%	6,71%	8,34%	14,85%	29,35%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	4.952.069,73	1,62%	OCCAM	0,27%	0,96%	4,46%	6,72%	6,72%	8,36%	14,84%	-	
PACIFICO MACRO FC FI MULT	1.123.607,45	0,37%	PACIFICO	0,78%	0,39%	-0,39%	1,64%	1,64%	-0,29%	1,47%	8,52%	
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	3.709.301,92	1,21%	ZEITGEIST	0,18%	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	6.380.822,09	2,08%										
NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT	6.380.822,09	2,08%	NAVI CAPITAL	1,28%	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	11.034.457,41	3,60%			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	11.034.457,41	3,60%										
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	11.034.457,41	3,60%	BLACKROCK	0,33%	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 **	11.906.609,34	3,89%			1,58%	5,22%	7,56%	7,56%	18,23%	39,14%		
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				1,32%	4,24%	10,03%	10,03%	21,63%	44,34%	60,60%	
Imobiliário **	21.219.913,78	6,93%			0,75%	1,30%	2,43%	2,43%	7,65%	32,54%		
Benchmark:	INPC				0,62%	2,12%	5,61%	5,61%	11,92%	22,24%	25,11%	
Total	306.162.462,13	100%			2,41%	-3,19%	-4,20%	0,06%	0,06%	-5,51%	8,70%	21,33%
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

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 31/05/2022

* 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.

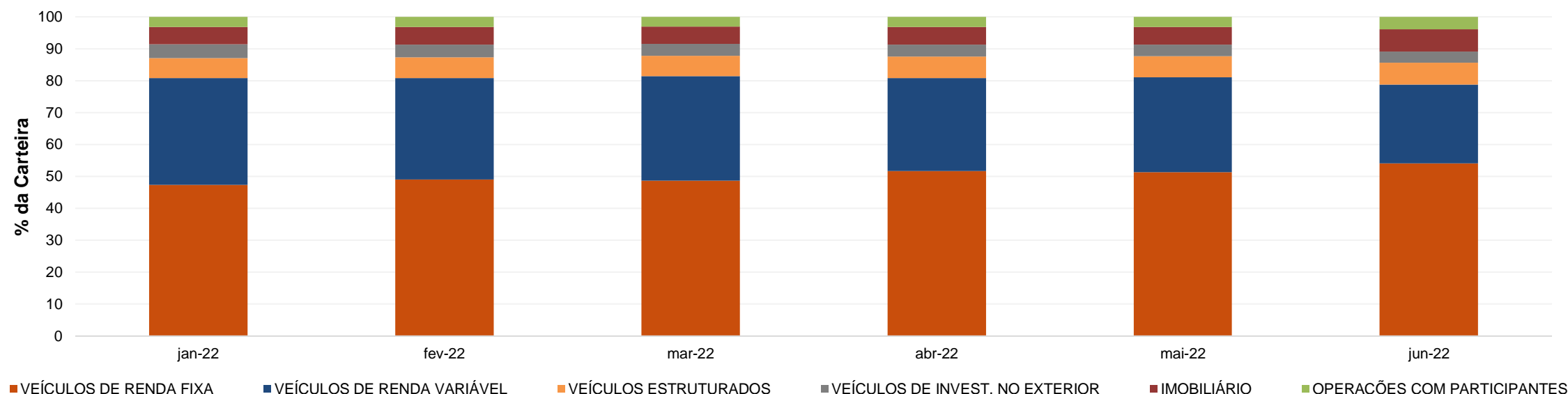
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

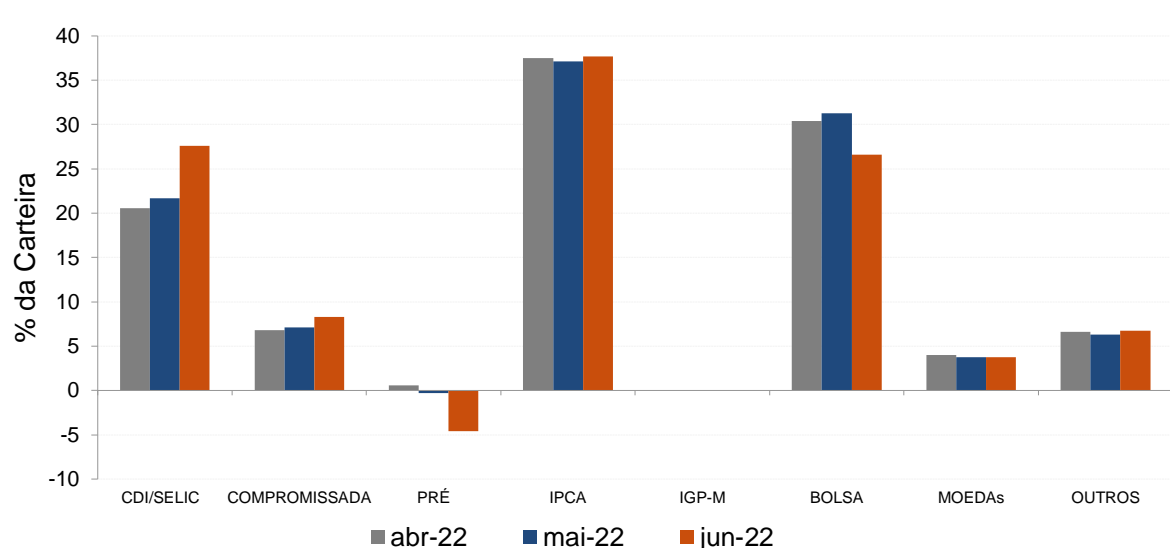
Distribuição da Carteira

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.

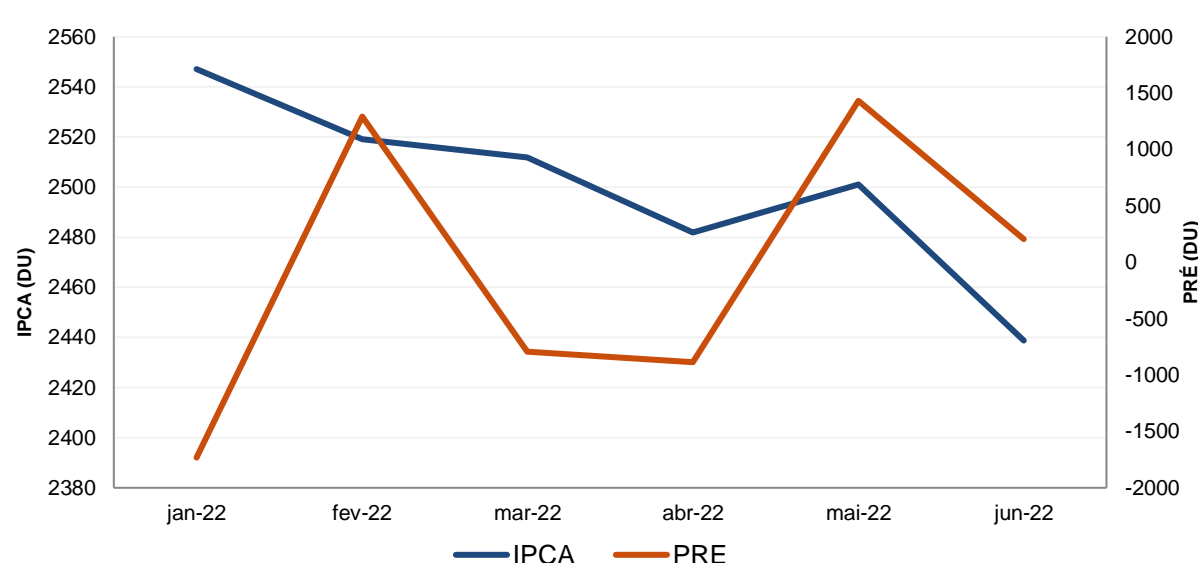
Evolução do Patrimônio Líquido



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	9.270,46	12,61	13.570,35	12,23
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	6.310,10	8,58	9.997,16	9,01
ELET3	Energia Elétrica	4.043,66	5,50	919,57	0,83
EQTL3	Energia Elétrica	3.181,99	4,33	4.978,70	4,49
BPAC11	Intermediários Financeiros	2.925,83	3,98	4.686,89	4,23
ITSA4	Intermediários Financeiros	2.781,84	3,78	4.273,64	3,85
ITUB4	Intermediários Financeiros	2.723,09	3,70	4.354,29	3,93
BBDC4	Intermediários Financeiros	1.967,71	2,68	2.587,42	2,33
VBBR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	1.668,92	2,27	2.743,44	2,47
BBAS3	Intermediários Financeiros	1.548,82	2,11	3.053,40	2,75

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

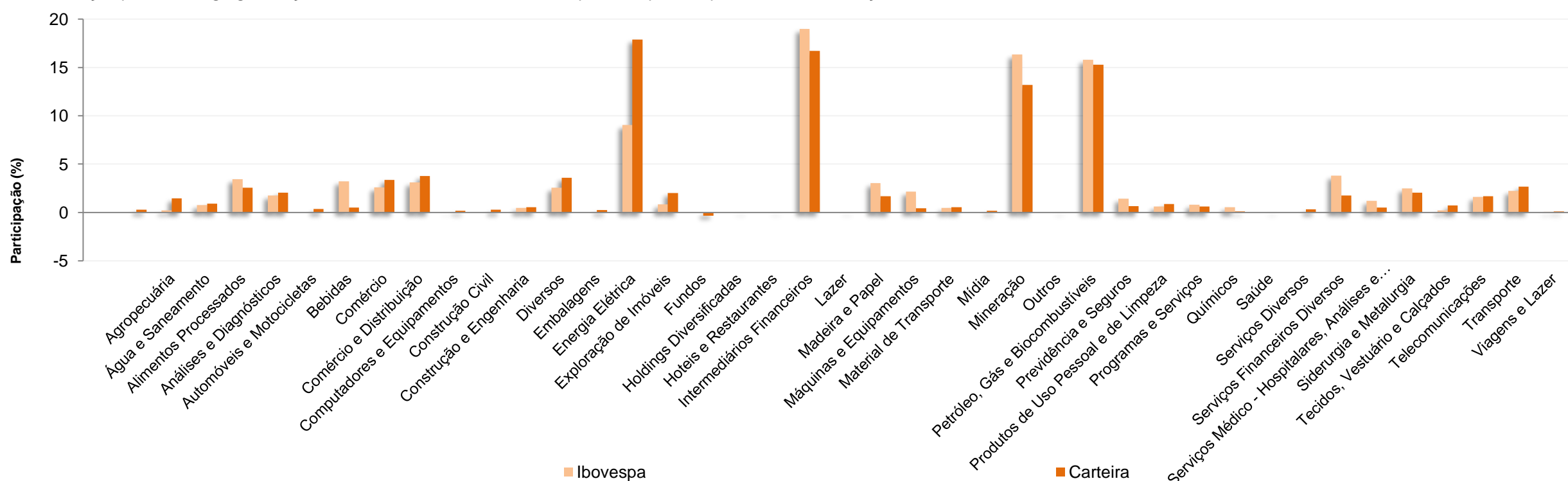
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	14,72	0,02	0,02	14
MTSA4	59,81	0,08	0,05	5
COCE5	109,76	0,15	0,01	2
HBRE3	71,88	0,10	0,07	2
SCAR3	33,32	0,05	0,01	2
VALE3	9.270,46	12,61	0,00	1
PETR4	6.310,10	8,58	0,00	1
ELET3	4.043,66	5,50	0,02	1
EQTL3	3.181,99	4,33	0,01	1
BPAC11	2.925,83	3,98	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: 30/06/2022

Análises de Contrapartes

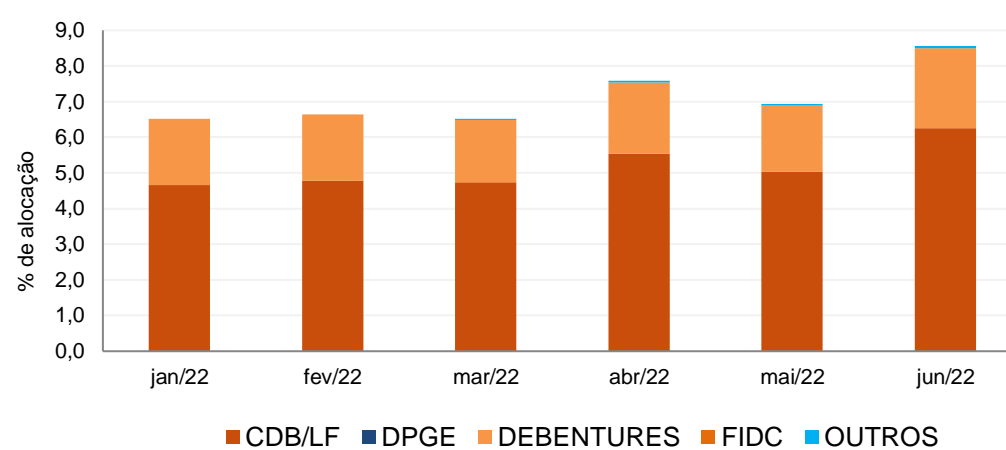
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	11.571,65	4,25	Faixa 1
VALE SA	9.270,46	3,40	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	7.353,85	2,70	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	4.535,53	1,66	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	3.181,99	1,17	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.987,53	1,10	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	2.925,83	1,07	Faixa 2
ITAUSA INVESTS ITAU SA	2.781,84	1,02	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	2.722,90	1,00	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	2.388,99	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
VSPT11	92,40	FERROVIA CENTRO ATLANTICA SA	Sem Faixa	Faixa 1	20-jun-26	CDI	1,19%	URCA FI MULT CRED PRIV



ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

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	95.268	0,03%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	10-jun-22	1,16%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
BSA325	24-mai-26	13.044	0,00%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	08-jun-22	1,18%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
BSA325	24-mai-26	12.933	0,00%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14-jun-22	1,16%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
BSA325	24-mai-26	390	0,00%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	14-jun-22	1,16%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
VSPT11	20-jun-26	92.398	0,03%	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	330.591	0,12%	Selic		07-jun-22	0,14%	0,14%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2028-03-01	01-mar-28	5.752	0,00%	Selic		27-jun-22	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

