

ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 28/04/2023

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	950.236.780,46	57,87%			0,92%	3,53%	0,99%	3,33%	12,54%	21,40%	46,87%	
Benchmark:	CDI				0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
Renda Fixa CDI	89.788.036,12	5,47%		0,12%								
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	56.616.484,09	3,45%	ALFA	7,35%	0,02%	0,91%	3,00%	6,51%	4,17%	13,98%	23,04%	25,80%
BRANCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.776.642,56	0,11%	BRANCO	7,54%	0,00%	0,91%	3,01%	6,37%	4,15%	13,19%	21,03%	23,53%
URCA FI MULT CRED PRIV	31.394.909,47	1,91%	SANTANDER	7,16%	0,20%	0,98%	3,14%	6,46%	4,26%	13,90%	22,20%	25,21%
Benchmark:	CDI					0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	860.448.744,34	52,40%										
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	860.448.744,34	52,40%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				0,92%	3,04%	6,44%	4,20%	13,37%	21,40%	24,00%	
Renda Variável	366.892.438,00	22,34%			2,26%	-8,25%	-12,77%	-4,71%	-5,09%	-15,31%	25,84%	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				2,08%	-8,27%	-9,96%	-4,88%	-2,90%	-11,02%	37,24%	
Renda Variável Ativa	314.426.053,91	19,15%		1,30%								
GRUMARI FIA	23.914.475,69	1,46%	AZ QUEST	39,56%	4,52%	1,79%	-6,22%	-14,84%	-3,70%	-11,16%	-24,11%	13,13%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	8.805.530,87	0,54%	BLACKROCK	0,07%	7,80%	2,45%	-8,14%	-10,03%	-4,77%	-2,42%	-11,80%	30,10%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	56.613.179,27	3,45%	CONSTANCIA	39,56%	6,31%	3,12%	-5,44%	-11,55%	-1,57%	-5,33%	-10,72%	26,12%
FIA SÃO CONRADO	9.924.834,13	0,60%	EQUITAS	39,56%	11,86%	-0,03%	-0,92%	-12,46%	8,58%	-8,52%	-34,46%	-9,21%
SHARP ARPOADOR IBrX ATIVO FIA	163.243.611,36	9,94%	SHARP	39,56%	8,14%	2,25%	-9,54%	-10,50%	-5,77%	0,27%	-7,47%	42,32%
VINCI JOATINGA FIA	26.231.438,52	1,60%	VINCI	39,56%	7,90%	1,83%	-7,57%	-17,22%	-4,57%	-9,24%	-20,60%	15,90%
FIA PIPA	25.692.984,08	1,56%	XP	39,56%	6,55%	3,07%	-4,56%	-12,61%	-1,22%	1,53%	-4,62%	-
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					2,08%	-8,27%	-9,96%	-4,88%	-2,90%	-11,02%	37,24%
CARTEIRA PRÓPRIA RV	52.466.384,09	3,20%										
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	52.466.384,09	3,20%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX				1,93%	-8,69%	-10,82%	-5,48%	-4,80%	-14,46%	29,37%	
Estruturado	58.884.207,82	3,59%			0,24%	-0,70%	-2,53%	-0,44%	3,65%	13,23%	29,56%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,06%	3,52%	7,48%	4,86%	15,63%	26,28%	31,55%	
Multimercados Estruturados	48.961.952,08	2,98%		1,44%								
NAVI LS ESTRUT FIC FI MULT	15.792.075,71	0,96%	NAVI CAPITAL	2,97%	3,14%	-0,67%	-0,72%	0,00%	-0,85%	12,79%	24,25%	25,93%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	11.936.526,09	0,73%	OCCAM	0,91%	1,35%	-0,08%	-1,04%	-1,14%	-0,94%	5,80%	12,54%	21,85%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	3.015.222,46	0,18%	OCCAM	0,24%	1,35%	-0,08%	-1,05%	-1,13%	-0,94%	5,80%	12,52%	21,82%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	9.544.582,89	0,58%	QUANTITAS	4,33%	1,83%	2,64%	6,79%	3,45%	17,79%	31,00%	37,90%	
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	8.673.544,93	0,53%	ZEITGEIST	0,60%	2,71%	1,46%	-0,75%	-1,43%	-0,03%	2,42%	19,94%	19,52%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,06%	3,52%	7,48%	4,86%	15,63%	26,28%	31,55%
FIP	9.922.255,74	0,60%										
SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES	9.922.255,74	0,60%	SIGNAL CAPITAL	10,28%		-0,39%	-3,15%	-18,81%	-2,92%	-20,62%	-46,54%	-47,31%
Benchmark:	IPCA					0,61%	2,18%	3,78%	2,72%	4,18%	16,82%	24,72%
Exterior	44.025.122,00	2,68%			0,00%	0,68%	4,46%	2,11%	2,76%	-7,29%	20,69%	
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				0,00%	-0,14%	5,89%	4,43%	3,12%	-10,69%	27,29%	
Exterior - RV	44.025.122,00	2,68%		3,88%								
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	44.025.122,00	2,68%	BLACKROCK	1,42%	5,90%	0,00%	0,68%	4,32%	2,11%	2,52%	-6,98%	35,46%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					0,00%	-0,14%	5,89%	4,43%	3,12%	-10,69%	27,29%
Operações com Participantes	61.563.852,07	3,75%			1,64%	4,78%	7,77%	6,22%	16,14%	37,15%	55,41%	
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.				1,32%	4,61%	9,22%	6,10%	15,83%	45,31%	74,33%	
Imobiliário	159.655.791,90	9,72%			0,35%	0,82%	2,37%	1,56%	5,79%	14,57%	40,84%	
Benchmark:	INPC				0,53%	1,95%	3,52%	2,42%	3,83%	16,78%	25,64%	
Total	1.642.049.634,74	100%			2,59%	1,15%	0,35%	-1,99%	1,29%	7,29%	10,26%	40,58%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,89%	3,17%	6,11%	4,10%	9,21%	29,19%	46,16%	

* 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.

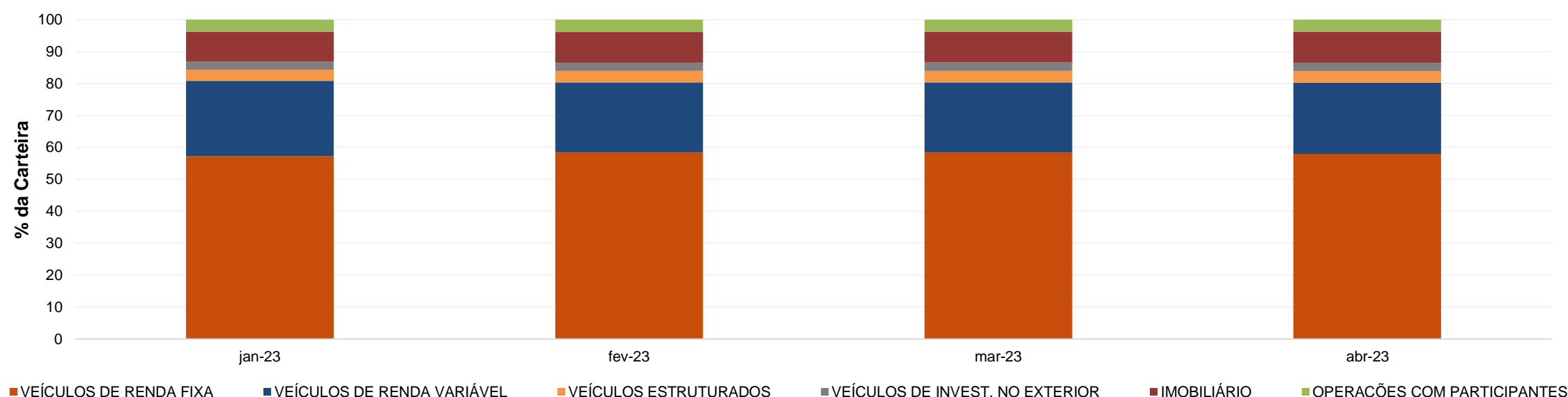
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

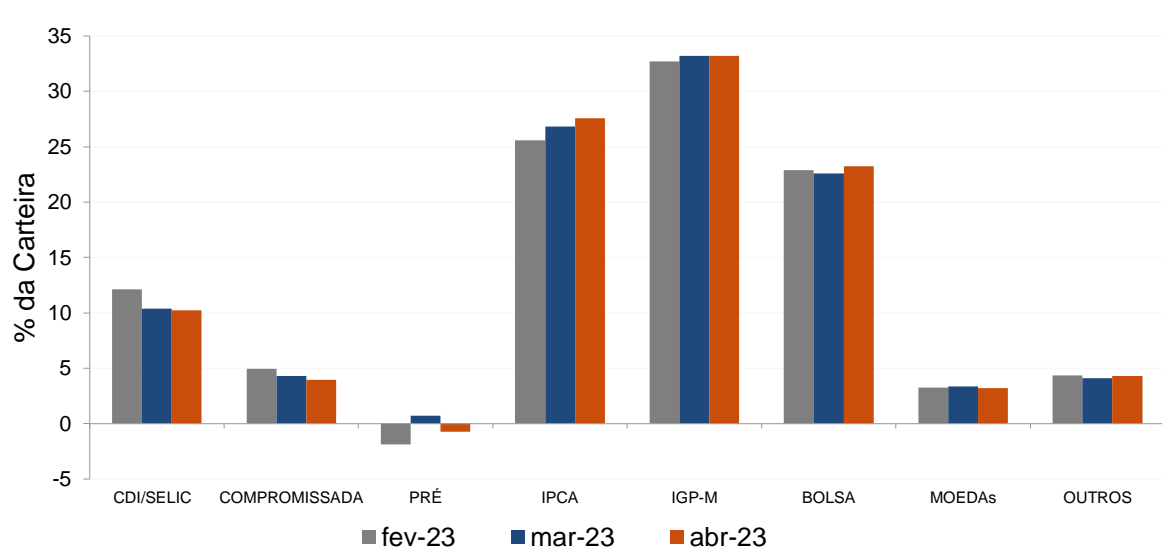
Distribuição da Carteira

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.

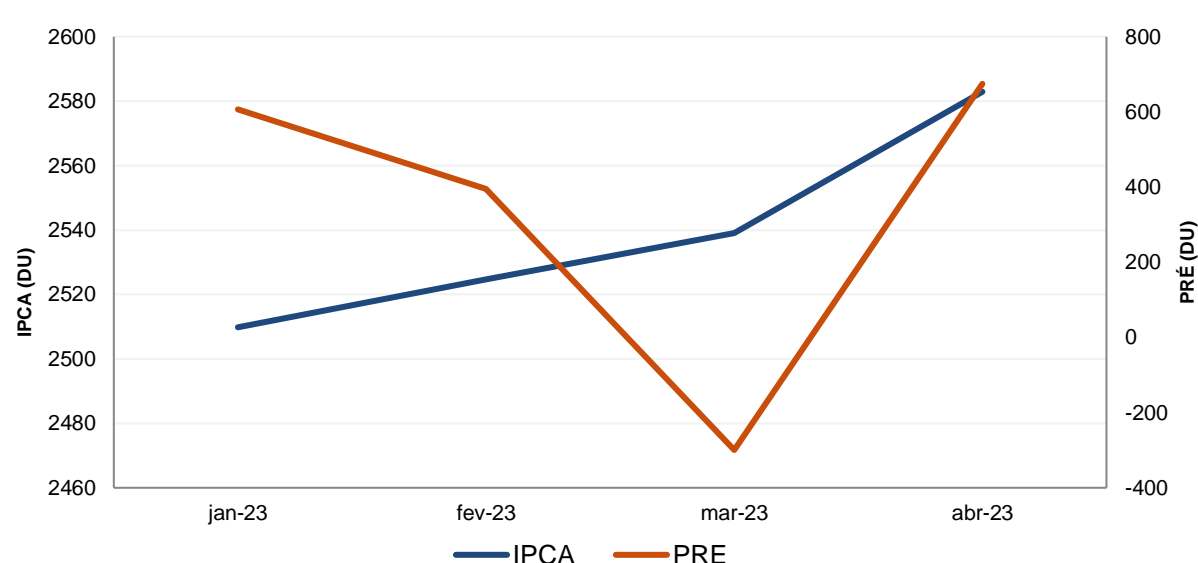
Evolução do Patrimônio Líquido



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	37.165,66	10,64	48.547,64	14,08
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	22.870,93	6,55	19.777,59	5,74
EQTL3	Energia Elétrica	18.881,48	5,41	17.545,23	5,09
ITSA4	Intermediários Financeiros	17.715,82	5,07	16.758,04	4,86
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	15.545,57	4,45	14.584,82	4,23
ITUB4	Intermediários Financeiros	15.232,28	4,36	14.305,24	4,15
ELET3	Energia Elétrica	13.310,82	3,81	12.952,27	3,76
RENT3	Diversos	12.839,55	3,68	11.258,37	3,26
BBAS3	Intermediários Financeiros	11.144,97	3,19	10.590,53	3,07
BBDC4	Intermediários Financeiros	10.065,10	2,88	9.402,72	2,73

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

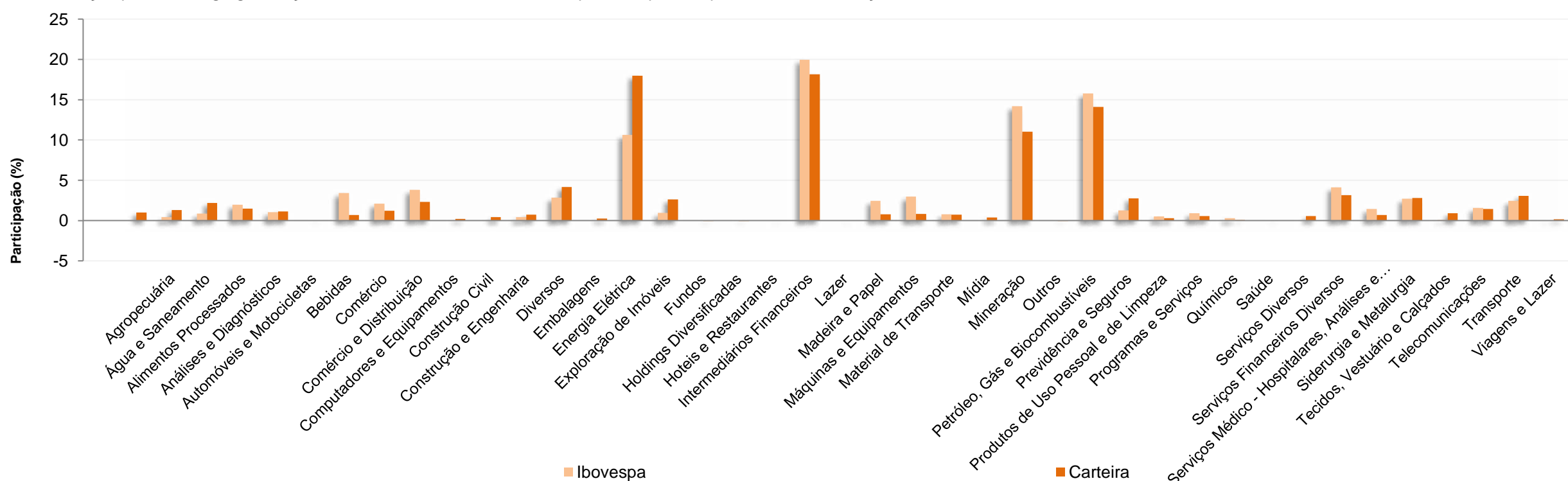
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	91,21	0,03	0,11	100
MTSA4	331,82	0,10	0,32	18
AGXY3	326,35	0,09	0,06	8
ALLD3	158,43	0,05	0,22	7
HBRE3	407,11	0,12	0,38	6
SCAR3	97,16	0,03	0,05	5
EALT4	98,24	0,03	0,19	4
MATD3	1.430,47	0,41	0,28	3
WEST3	133,12	0,04	0,20	3
TTEN3	2.388,03	0,68	193,52	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 BD

Data-base: 28/04/2023

Análises de Contrapartes

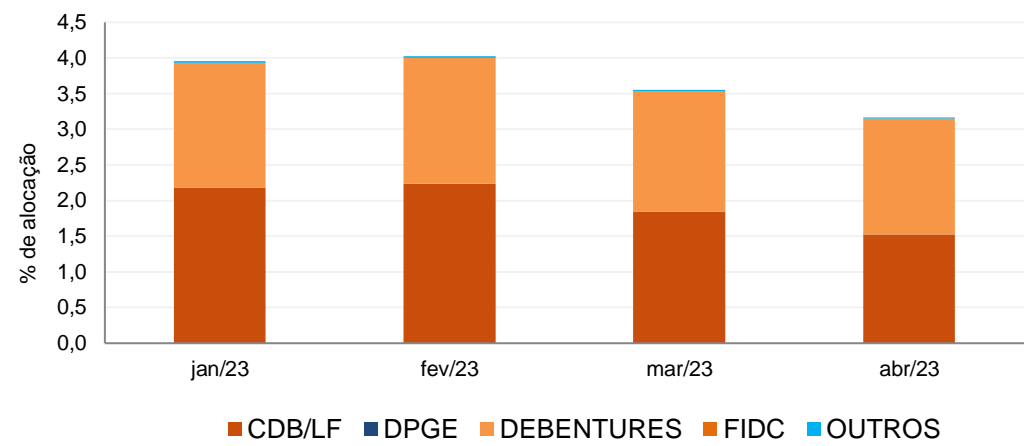
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
VALE SA	55.121,73	3,88	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	23.662,07	1,66	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	22.707,00	1,60	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	18.881,48	1,33	Faixa 1
ITAUSA SA	17.857,44	1,26	Faixa 2
PETRO RIO SA	15.545,57	1,09	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	15.234,60	1,07	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	14.311,32	1,01	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	12.849,18	0,90	Faixa 1
BCO BRASIL SA	11.144,97	0,78	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								



ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 28/04/2023

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 2024-09-01	01-set-24	1.797.071	0,13%	Selic	13-abr-23	0,02%	0,00%	URCA FI MULT CRED PRIV
LFT 2024-09-01	01-set-24	740.655	0,05%	Selic	06-abr-23	0,02%	0,00%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF

