

ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 31/05/2023

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	834.679.674,34	54,07%			-0,30%	2,28%	2,06%	3,02%	11,26%	17,50%	44,20%
Benchmark:	CDI				1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
Renda Fixa CDI	83.211.900,96	5,39%		0,05%							
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	54.981.847,13	3,56%	ALFA	6,19%	1,18%	3,31%	6,65%	5,40%	14,06%	24,10%	26,90%
BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.509.219,58	0,10%	BRDESCO	6,33%	1,10%	3,21%	6,47%	5,30%	13,29%	22,05%	24,60%
URCA FI MULT CRED PRIV	26.720.834,24	1,73%	SANTANDER	5,99%	1,30%	3,66%	6,86%	5,61%	14,10%	23,37%	26,29%
Benchmark:	CDI				1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	751.467.773,38	48,68%									
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	751.467.773,38	48,68%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
Renda Variável	379.179.607,09	24,56%			4,57%	3,37%	-3,08%	-0,35%	-3,35%	-15,80%	22,20%
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				3,77%	2,86%	-3,72%	-1,29%	-2,56%	-12,97%	31,04%
Renda Variável Ativa	319.265.486,43	20,68%		1,32%							
GRUMARI FIA	27.273.505,12	1,77%	AZ QUEST	43,14%	13,17%	4,57%	3,22%	-1,15%	0,70%	-6,43%	-24,25%
ISHARES IBOV FUNDO DE ÍNDICE	4.093.454,73	0,27%	BLACKROCK	0,03%	8,87%	3,90%	3,65%	-3,44%	-1,05%	-2,18%	-13,53%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	65.427.778,77	4,24%	CONSTANCIA	43,14%	8,86%	5,97%	6,55%	1,35%	4,30%	-2,29%	-9,53%
FIA SÃO CONRADO	11.573.730,96	0,75%	EQUITAS	43,14%	11,30%	6,93%	6,21%	7,91%	16,10%	-0,24%	-34,20%
SHARP ARPOADOR IBrX ATIVO FIA	151.039.275,00	9,78%	SHARP	43,22%	8,18%	2,99%	1,19%	-5,33%	-2,96%	-0,75%	-8,76%
VINCI JOATINGA FIA	30.372.967,28	1,97%	VINCI	43,14%	9,56%	6,17%	4,64%	-3,56%	1,31%	-5,85%	-19,71%
FIA PIPA	29.484.774,57	1,91%	XP	43,14%	9,92%	5,22%	6,46%	2,32%	3,94%	3,20%	-5,99%
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				3,77%	2,86%	-3,72%	-1,29%	-2,56%	-12,97%	31,04%
CARTEIRA PRÓPRIA RV	59.914.120,66	3,88%									
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV	59.914.120,66	3,88%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				3,59%	2,36%	-4,66%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%
Estruturado	59.144.651,12	3,83%			0,00%	-1,28%	-2,75%	-0,44%	2,57%	12,69%	31,64%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,30%	3,76%	7,60%	6,23%	15,74%	27,37%	32,74%
Multimercados Estruturados	49.114.236,79	3,18%		1,16%							
NAVI LS ESTRUT FIC FI MULT	15.973.010,89	1,03%	NAVI CAPITAL	3,29%	2,03%	0,60%	-1,04%	-0,73%	-0,25%	12,51%	22,97%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	11.675.494,51	0,76%	OCCAM	1,00%	1,22%	-2,71%	-4,59%	-3,40%	-3,63%	1,84%	9,51%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	2.949.279,00	0,19%	OCCAM	0,25%	1,22%	-2,71%	-4,59%	-3,40%	-3,63%	1,84%	9,50%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	9.728.827,13	0,63%	QUANTITAS	4,37%	1,38%	3,23%	6,59%	4,88%	16,69%	32,02%	39,00%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	8.787.625,26	0,57%	ZEITGEIST	0,62%	1,36%	0,77%	0,25%	0,08%	0,74%	1,74%	18,64%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,30%	3,76%	7,60%	6,23%	15,74%	27,37%	32,74%
FIP	10.030.414,33	0,65%									
SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES	10.030.414,33	0,65%	SIGNAL CAPITAL	10,28%	1,12%	-2,17%	-13,90%	-1,83%	-20,25%	-45,76%	-45,87%
Benchmark:	IPCA				0,23%	1,56%	3,59%	2,95%	3,94%	16,13%	25,48%
Exterior	48.839.886,92	3,16%			1,52%	1,72%	0,01%	3,67%	8,89%	-2,02%	22,53%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				0,63%	0,95%	-0,93%	5,09%	8,13%	-8,34%	22,45%
Exterior - RV	48.839.886,92	3,16%		2,47%							
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	48.839.886,92	3,16%	BLACKROCK	1,72%	3,85%	1,52%	1,72%	0,00%	3,67%	8,74%	-2,00%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				0,63%	0,95%	-0,93%	5,09%	8,13%	-8,34%	22,45%
Operações com Participantes	61.417.204,28	3,98%			1,50%	4,49%	9,07%	7,81%	14,91%	37,53%	56,84%
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.				1,33%	4,36%	9,29%	7,51%	15,72%	44,51%	75,55%
Imobiliário	159.851.185,36	10,36%			0,29%	1,36%	2,24%	1,86%	5,94%	14,03%	40,30%
Benchmark:	INPC				0,36%	1,54%	3,50%	2,79%	3,74%	16,08%	26,41%
Total	1.543.674.407,71	100%			3,36%	0,97%	2,43%	0,97%	2,27%	7,05%	7,82%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,81%	2,83%	6,13%	4,94%	9,11%	28,44%	47,12%

* 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.

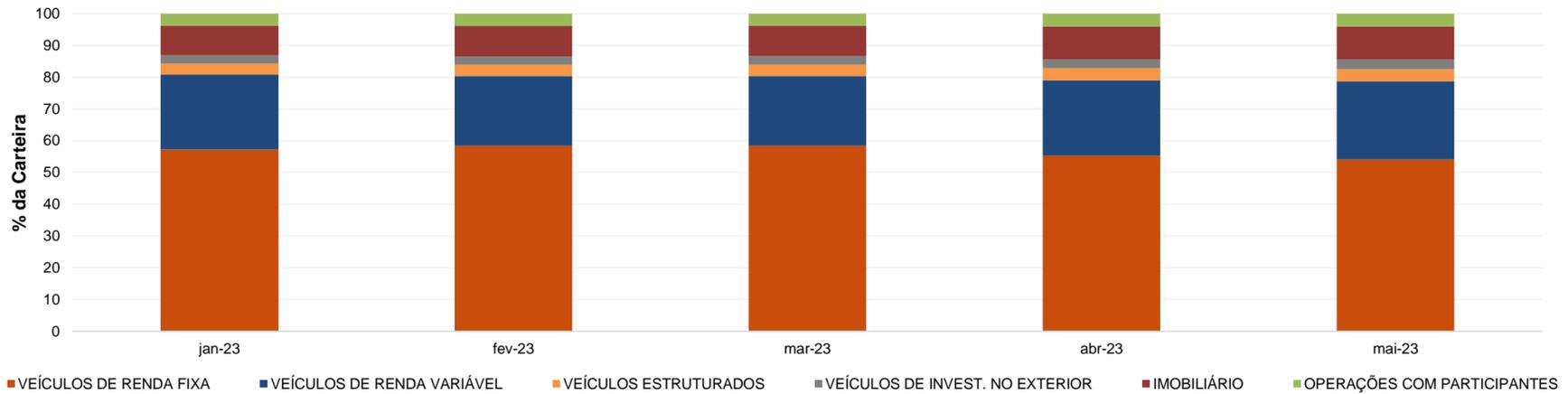
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

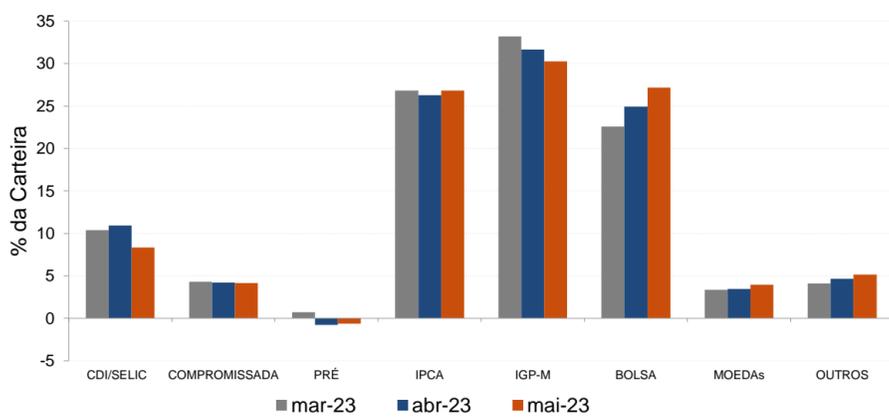
Distribuição da Carteira

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.

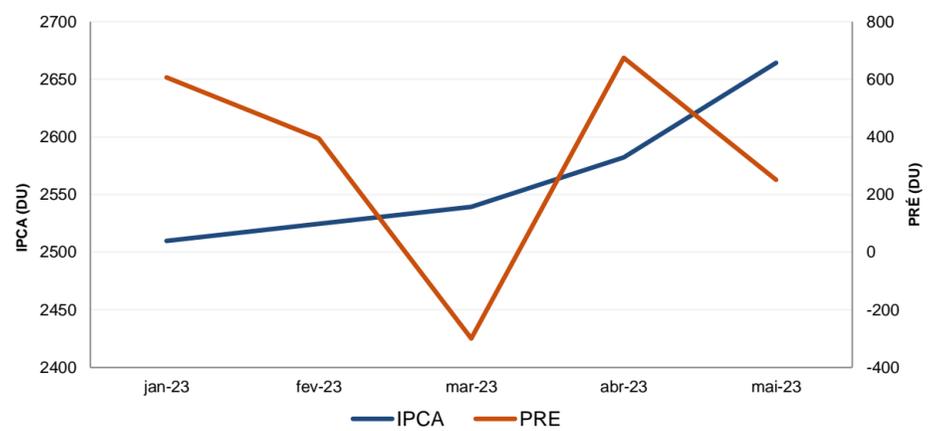
Evolução do Patrimônio Líquido



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	28.801,75	7,76	37.165,66	10,64
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	24.978,60	6,73	22.870,93	6,55
ITSA4	Intermediários Financeiros	16.309,05	4,39	17.715,82	5,07
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	15.379,32	4,14	15.545,57	4,45
ELET3	Energia Elétrica	15.290,14	4,12	13.310,82	3,81
EQTL3	Energia Elétrica	15.245,85	4,11	18.881,48	5,41
ITUB4	Intermediários Financeiros	15.130,82	4,07	15.232,28	4,36
RENT3	Diversos	12.900,03	3,47	12.839,55	3,68
BBDC4	Intermediários Financeiros	10.645,39	2,87	10.065,10	2,88
BBAS3	Intermediários Financeiros	10.270,18	2,77	11.144,97	3,19

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

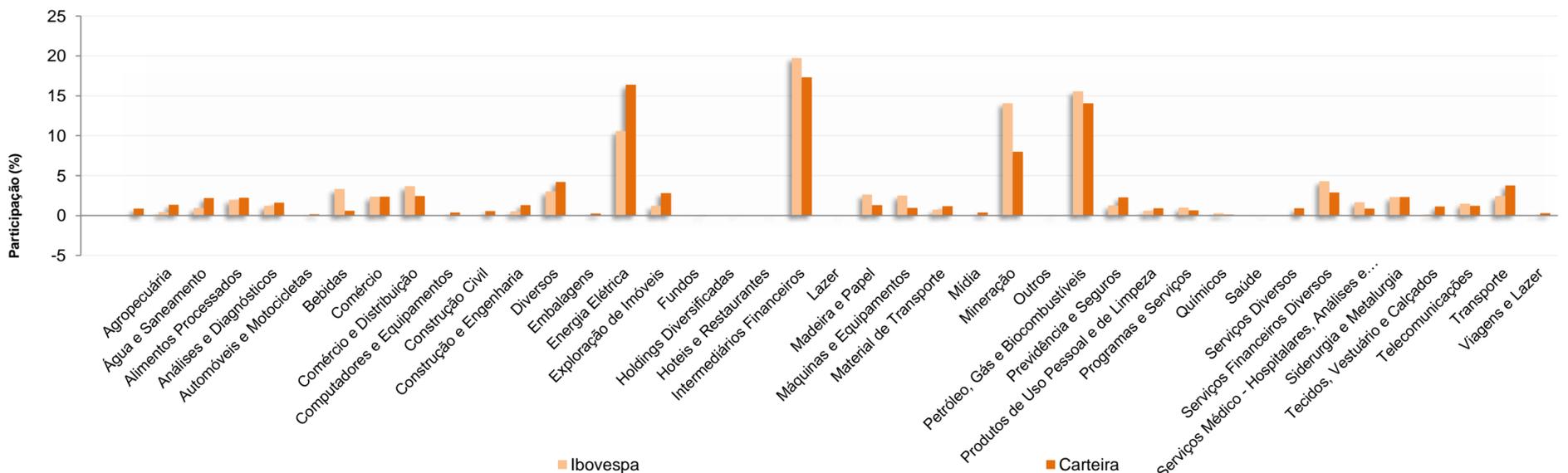
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PARD3	-0,70	0,00	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	107,17	0,03	0,12	168
MTSA4	357,62	0,10	0,39	23
ELMD3	1.412,38	0,38	0,26	6
WEST3	135,69	0,04	0,30	5
EALT4	106,88	0,03	0,19	5
MATD3	1.521,34	0,41	0,27	3
AGXY3	305,45	0,08	0,07	3
EMAE4	80,63	0,02	0,02	3
MEGA3	2.847,58	0,77	0,00	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: 31/05/2023

Análises de Contrapartes

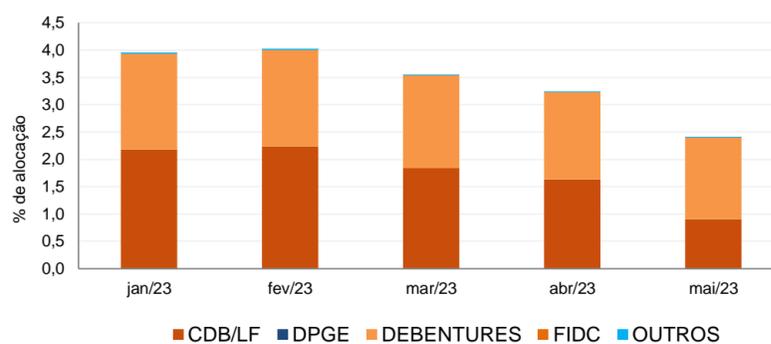
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
VALE SA	44.265,55	3,34	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	25.367,90	1,92	Faixa 2
ITAUSA SA	16.429,01	1,24	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	16.275,59	1,23	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	15.441,33	1,17	Faixa 1
PRIO S.A.	15.379,32	1,16	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	15.197,31	1,15	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	15.133,18	1,14	Faixa 1
LOCALIZA RENT A CAR SA	12.969,08	0,98	Faixa 1
BCO BRASIL SA	10.270,18	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: 31/05/2023

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 Privados	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Emissor	Data Compra	Tx de Compra	Faixa Atual	Veículo
CSBR11	10-dez-25	19.608	0,00%	CDI	CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÔE	08-mai-23	3,44%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2024-09-01	01-set-24	57.373	0,00%	Selic		15-mai-23	0,02%	0,00%	GRUMARI FIA
LFT 2025-03-01	01-mar-25	603.223	0,05%	Selic		16-mai-23	0,03%	0,03%	URCA FI MULT CRED PRIV
LFT 2025-03-01	01-mar-25	45.887	0,00%	Selic		15-mai-23	0,03%	0,03%	GRUMARI FIA
LFT 2025-03-01	01-mar-25	11.472	0,00%	Selic		22-mai-23	0,03%	0,03%	GRUMARI FIA
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	274.855	0,02%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	213.776	0,02%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	122.404	0,01%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	91.618	0,01%	IPCA		25-mai-23	6,23%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	91.618	0,01%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	61.079	0,00%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	61.079	0,00%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	30.539	0,00%	IPCA		25-mai-23	6,23%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	346.339	0,03%	IPCA		26-mai-23	5,56%	5,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	204.805	0,02%	IPCA		26-mai-23	5,56%	5,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	195.149	0,01%	IPCA		26-mai-23	5,56%	5,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	31.509	0,00%	IPCA		26-mai-23	5,56%	5,62%	URCA FI MULT CRED PRIV

