

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

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	1.181.587.283,85	73,41%			2,26%	6,98%	7,87%	8,09%	11,87%	17,67%	22,83%
Benchmark:	CDI				1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
Renda Fixa CDI	543.913.576,17	33,79%		0,05%							
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	359.388.173,49	22,33%	ALFA	40,46%	1,18%	3,31%	6,65%	5,40%	14,06%	24,10%	26,90%
BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	9.864.995,41	0,61%	BRDESCO	41,39%	1,10%	3,21%	6,47%	5,30%	13,29%	22,05%	24,60%
URCA FI MULT CRED PRIV	174.660.407,28	10,85%	SANTANDER	39,18%	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	637.673.707,68	39,62%									
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	637.673.707,68	39,62%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,12%	3,25%	6,55%	5,37%	13,48%	22,43%	25,10%
Renda Variável	218.761.920,20	13,59%			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	184.195.377,98	11,44%		1,32%							
GRUMARI FIA	15.735.034,94	0,98%	AZ QUEST	24,89%	13,17%	4,57%	3,22%	-1,15%	0,70%	-6,43%	-24,25%
ISHARES IBOV FUNDO DE ÍNDICE	2.361.656,63	0,15%	BLACKROCK	0,02%	8,87%	3,90%	3,65%	-3,44%	-1,05%	-2,18%	-13,53%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	37.747.564,18	2,35%	CONSTANCIA	24,89%	8,86%	5,97%	6,55%	1,35%	4,30%	-2,29%	-9,53%
FIA SÃO CONRADO	6.677.288,46	0,41%	EQUITAS	24,89%	11,30%	6,93%	6,21%	7,91%	16,10%	-0,24%	-34,20%
SHARP ARPOADOR IBrX ATIVO FIA	87.139.817,88	5,41%	SHARP	24,93%	8,18%	2,99%	1,19%	-5,33%	-2,96%	-0,75%	-8,76%
VINCI JOATINGA FIA	17.523.222,60	1,09%	VINCI	24,89%	9,56%	6,17%	4,64%	-3,56%	1,31%	-5,85%	-19,71%
FIA PIPA	17.010.793,29	1,06%	XP	24,89%	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	34.566.542,22	2,15%									
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RV	34.566.542,22	2,15%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				3,59%	2,36%	-4,66%	-2,09%	-4,47%	-16,34%	23,50%
Estruturado	87.539.014,19	5,44%			-0,23%	-1,10%	-0,10%	-0,15%	7,71%	17,26%	19,79%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,30%	3,76%	7,60%	6,23%	15,74%	27,37%	32,74%
Multimercados Estruturados	87.539.014,19	5,44%		1,16%							
NAVI LS ESTRUT FIC FI MULT	28.469.578,65	1,77%	NAVI CAPITAL	5,86%	2,03%	0,60%	-1,04%	-0,73%	-0,25%	12,51%	22,97%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	5.256.662,69	0,33%	OCCAM	0,45%	1,22%	-2,71%	-4,59%	-3,40%	-3,63%	1,84%	9,50%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	20.809.878,08	1,29%	OCCAM	1,78%	1,22%	-2,71%	-4,59%	-3,40%	-3,63%	1,84%	9,51%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	17.340.225,40	1,08%	QUANTITAS	7,79%	1,38%	3,23%	6,59%	4,88%	16,69%	32,02%	39,00%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	15.662.669,37	0,97%	ZEITGEIST	1,10%	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%
Exterior	52.125.481,28	3,24%			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	52.125.481,28	3,24%		2,47%							
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE ÍNDICE IE	52.125.481,28	3,24%	BLACKROCK	1,83%	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	24.038.130,32	1,49%			1,32%	2,26%	4,64%	3,97%	6,36%	26,80%	45,98%
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.				1,33%	4,36%	9,29%	7,51%	15,72%	44,51%	75,55%
Imobiliário	45.119.132,90	2,80%			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	1.609.491.740,48	100%			2,07%	2,61%	5,69%	5,28%	6,04%	8,92%	24,92%
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.

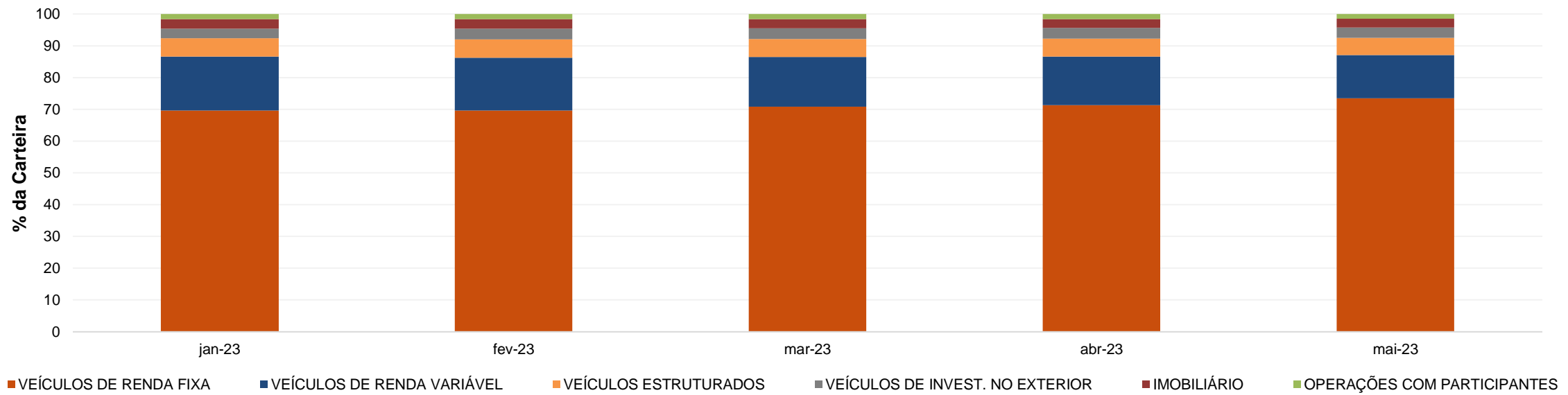
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

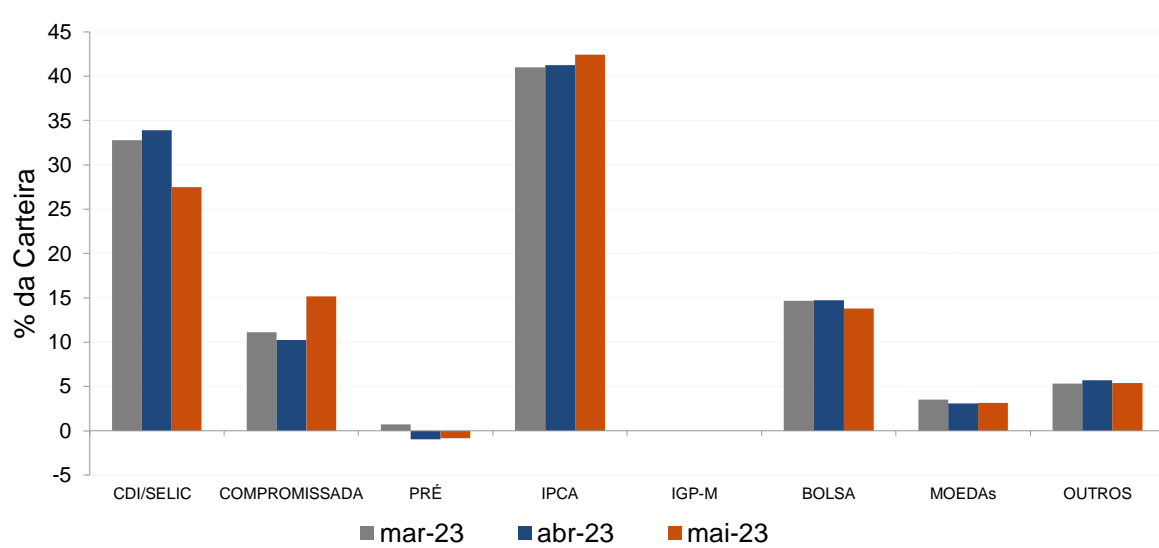
Distribuição da Carteira

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.

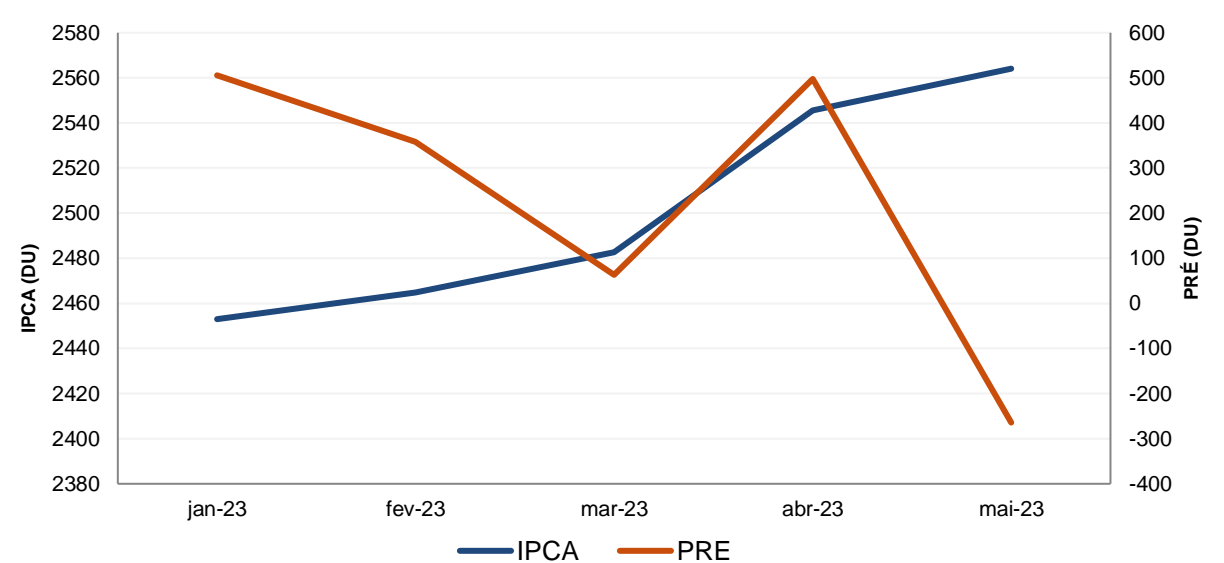
Evolução do Patrimônio Líquido



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	17.406,16	7,60	25.996,03	10,62
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	15.501,31	6,76	17.552,86	7,17
EQLT3	Energia Elétrica	10.667,32	4,65	14.095,56	5,76
ITSA4	Intermediários Financeiros	10.344,54	4,51	12.559,07	5,13
ITUB4	Intermediários Financeiros	10.134,86	4,42	11.601,68	4,74
ELET3	Energia Elétrica	9.998,67	4,36	9.870,01	4,03
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	9.496,20	4,14	10.683,39	4,37
RENT3	Diversos	7.876,07	3,44	8.726,41	3,57
BBAS3	Intermediários Financeiros	6.495,00	2,83	8.037,53	3,28
BBDC4	Intermediários Financeiros	6.411,13	2,80	6.552,54	2,68

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

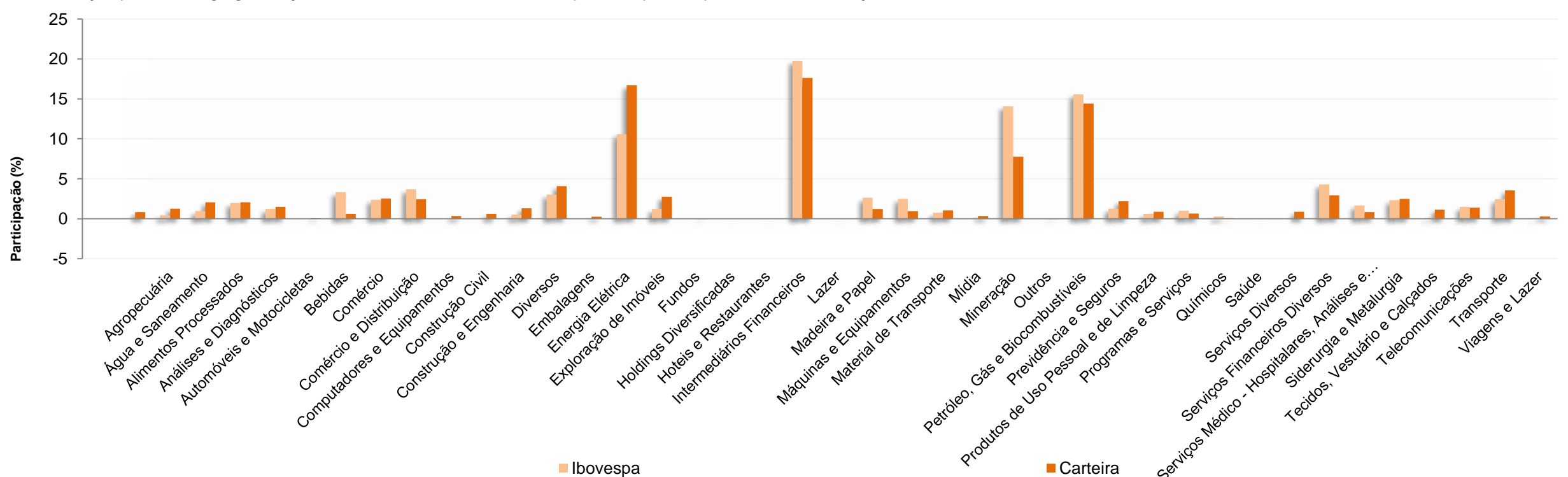
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
PARD3	-1,24	0,00	0,00	Sem Liquidez
CRIV4	61,83	0,03	0,07	97
MTSA4	206,32	0,09	0,22	14
ELMD3	814,85	0,36	0,15	3
WEST3	78,28	0,03	0,18	3
EALT4	61,66	0,03	0,11	3
MATD3	876,01	0,38	0,15	2
DESK3	226,63	0,10	0,08	2
AGXY3	176,23	0,08	0,04	2
ALLD3	146,93	0,06	0,14	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 CD PURO

Data-base: 31/05/2023

Análises de Contrapartes

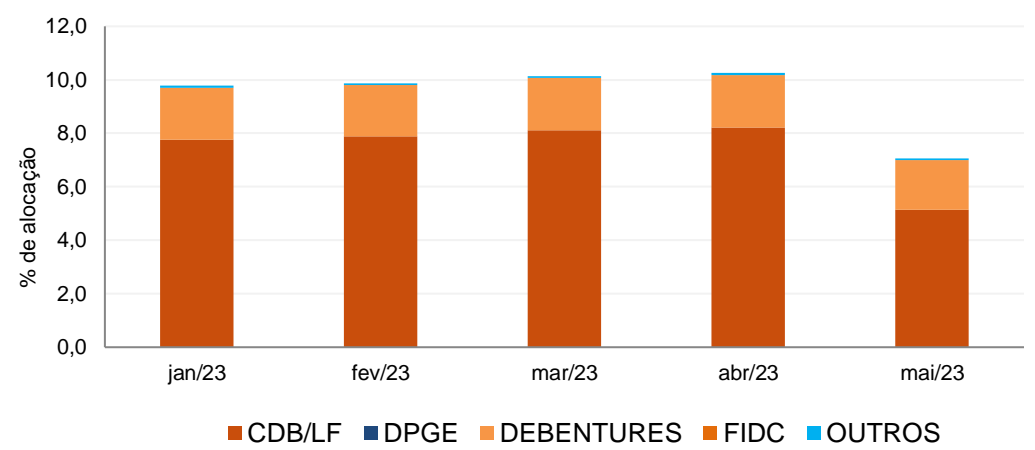
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	31.439,84	2,06	Faixa 1
BCO SAFRA SA	18.621,25	1,22	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	17.757,66	1,16	Faixa 2
VALE SA	17.406,16	1,14	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15.700,06	1,03	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	12.190,70	0,80	Faixa 2
ITAUSA SA	11.128,65	0,73	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	10.798,29	0,71	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	10.139,05	0,66	Faixa 1
BCO ITAU SA	9.834,79	0,64	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 CD PURO

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	128.165	0,01%	CDI	CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÕES	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	33.100	0,00%	Selic		15-mai-23	0,02%	0,00%	GRUMARI FIA
LFT 2025-03-01	01-mar-25	3.942.959	0,26%	Selic		16-mai-23	0,03%	0,03%	URCA FI MULT CRED PRIV
LFT 2025-03-01	01-mar-25	26.474	0,00%	Selic		15-mai-23	0,03%	0,03%	GRUMARI FIA
LFT 2025-03-01	01-mar-25	6.618	0,00%	Selic		22-mai-23	0,03%	0,03%	GRUMARI FIA
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.796.588	0,12%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	1.397.346	0,09%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	800.093	0,05%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	598.863	0,04%	IPCA		25-mai-23	6,23%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	598.863	0,04%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	399.242	0,03%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	399.242	0,03%	IPCA		25-mai-23	6,22%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	199.621	0,01%	IPCA		25-mai-23	6,23%	6,28%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	2.263.844	0,15%	IPCA		26-mai-23	5,56%	5,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.338.707	0,09%	IPCA		26-mai-23	5,56%	5,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.275.592	0,08%	IPCA		26-mai-23	5,56%	5,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	205.955	0,01%	IPCA		26-mai-23	5,56%	5,62%	URCA FI MULT CRED PRIV

