

ELETROS - ELETROS PLANO BD

Data-base: 30/06/2023

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	870.524.292,37	55,31%				1,23%	1,86%	4,29%	4,29%	12,26%	17,55%	42,69%
Benchmark:	CDI					1,07%	3,15%	6,50%	6,50%	13,54%	23,37%	26,17%
Renda Fixa CDI	108.824.420,39	6,91%			0,03%							
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	72.610.191,45	4,61%	ALFA	7,84%	0,02%	1,15%	3,28%	6,61%	6,61%	14,15%	25,11%	28,04%
BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.932.167,38	0,12%	BRDESCO	8,02%		1,06%	3,10%	6,41%	6,41%	13,35%	22,97%	25,66%
URCA FI MULT CRED PRIV	34.282.061,57	2,18%	SANTANDER	7,60%	0,07%	1,27%	3,59%	6,96%	6,96%	14,46%	24,50%	27,39%
Benchmark:	CDI					1,07%	3,15%	6,50%	6,50%	13,54%	23,37%	26,17%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	761.699.871,98	48,39%										
ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF	761.699.871,98	48,39%		100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					1,07%	3,15%	6,50%	6,50%	13,54%	23,37%	26,17%
Renda Variável	375.858.522,21	23,88%				9,56%	17,16%	9,17%	9,17%	18,92%	-8,51%	23,02%
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					9,05%	15,51%	7,64%	7,64%	19,95%	-5,85%	30,92%
Renda Variável Ativa	375.858.522,21	23,88%			1,37%							
GRUMARI FIA	29.088.174,90	1,85%	AZ QUEST	42,22%	12,62%	9,00%	16,01%	9,76%	9,76%	13,98%	-18,78%	12,37%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	69.597.555,22	4,42%	CONSTANCIA	42,22%	8,56%	8,71%	18,79%	13,38%	13,38%	19,29%	-1,05%	28,15%
ELETROS ITAUNA FIA	58.038.462,28	3,69%	ELETROBRÁS	42,22%	7,67%	-	-	-	-	-	-	-
FIA SÃO CONRADO	12.384.735,62	0,79%	EQUITAS	42,22%	9,05%	9,36%	16,90%	26,96%	26,96%	28,88%	-30,91%	-6,68%
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	149.998.012,41	9,53%	SHARP	42,29%	6,89%	10,10%	15,93%	6,84%	6,84%	21,44%	-0,42%	36,10%
VINCI JOATINGA FIA	25.421.574,40	1,62%	VINCI	42,22%	8,25%	10,31%	19,25%	11,75%	11,75%	17,36%	-10,83%	15,80%
FIA PIPA	31.330.007,38	1,99%	XP	42,22%	7,24%	8,59%	17,78%	12,86%	12,86%	20,93%	-0,78%	-
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					9,05%	15,51%	7,64%	7,64%	19,95%	-5,85%	30,92%
Estruturado	60.330.063,52	3,83%				2,00%	2,25%	1,56%	1,56%	3,54%	13,63%	31,45%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,24%	3,64%	7,54%	7,54%	15,80%	28,34%	33,87%
Multimercados Estruturados	50.381.642,74	3,20%			1,94%							
NAVI LS ESTRUT FIC FI MULT	16.303.566,20	1,04%	NAVI CAPITAL	3,29%	2,46%	2,07%	1,99%	1,81%	1,81%	9,31%	22,94%	28,30%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	11.846.396,26	0,75%	OCCAM	1,10%	2,90%	1,46%	-1,36%	-2,22%	-2,22%	2,34%	10,90%	17,53%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	2.992.449,57	0,19%	OCCAM	0,28%	2,90%	1,46%	-1,36%	-2,22%	-2,22%	2,34%	10,88%	17,54%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	9.956.302,41	0,63%	QUANTITAS	4,41%		2,34%	5,65%	7,33%	7,33%	19,26%	34,42%	41,65%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	9.282.928,30	0,59%	ZEITGEIST	0,66%	3,23%	5,64%	8,00%	6,42%	6,42%	7,07%	23,29%	26,59%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,24%	3,64%	7,54%	7,54%	15,80%	28,34%	33,87%
FIP	9.948.420,78	0,63%										
SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES	9.948.420,78	0,63%	SIGNAL CAPITAL	10,28%		-0,80%	-0,08%	-2,55%	-2,62%	-15,42%	-12,10%	1,45%
Benchmark:	IPCA					-0,08%	0,76%	2,87%	2,87%	3,16%	15,42%	25,06%
Exterior	46.592.312,12	2,96%				0,86%	2,39%	4,56%	4,56%	8,71%	1,11%	23,58%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					0,18%	0,82%	5,28%	5,28%	7,20%	-5,27%	18,58%
Exterior - RV	46.592.312,12	2,96%			3,02%							
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	46.592.312,12	2,96%	BLACKROCK	1,68%	4,68%	0,86%	2,39%	4,56%	4,56%	8,56%	1,18%	28,92%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					0,18%	0,82%	5,28%	5,28%	7,20%	-5,27%	18,58%
Operações com Participantes	60.831.407,93	3,86%				1,42%	4,63%	9,34%	9,34%	14,43%	38,25%	58,78%
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.					0,82%	3,50%	8,39%	8,39%	14,90%	43,51%	74,85%
Imobiliário	159.813.366,32	10,15%				0,45%	1,10%	2,31%	2,31%	5,62%	13,71%	39,99%
Benchmark:	INPC					-0,10%	0,79%	2,69%	2,69%	3,00%	15,28%	25,91%
Total	1.573.938.206,15	100%				2,64%	3,12%	5,46%	5,46%	13,12%	10,08%	37,28%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,32%	2,04%	5,28%	5,28%	8,33%	27,55%	46,53%

* 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.

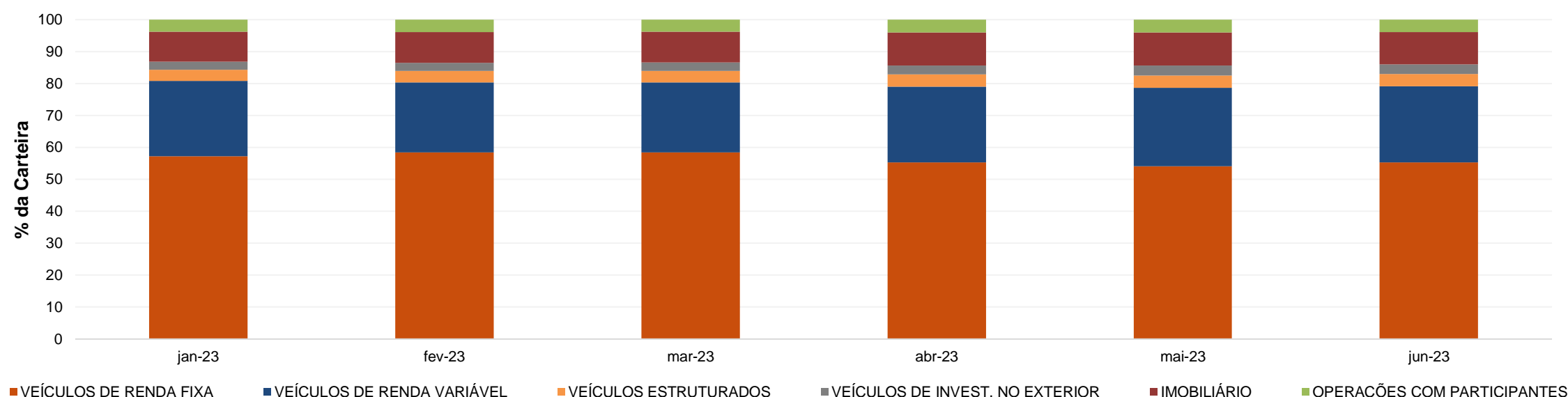
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

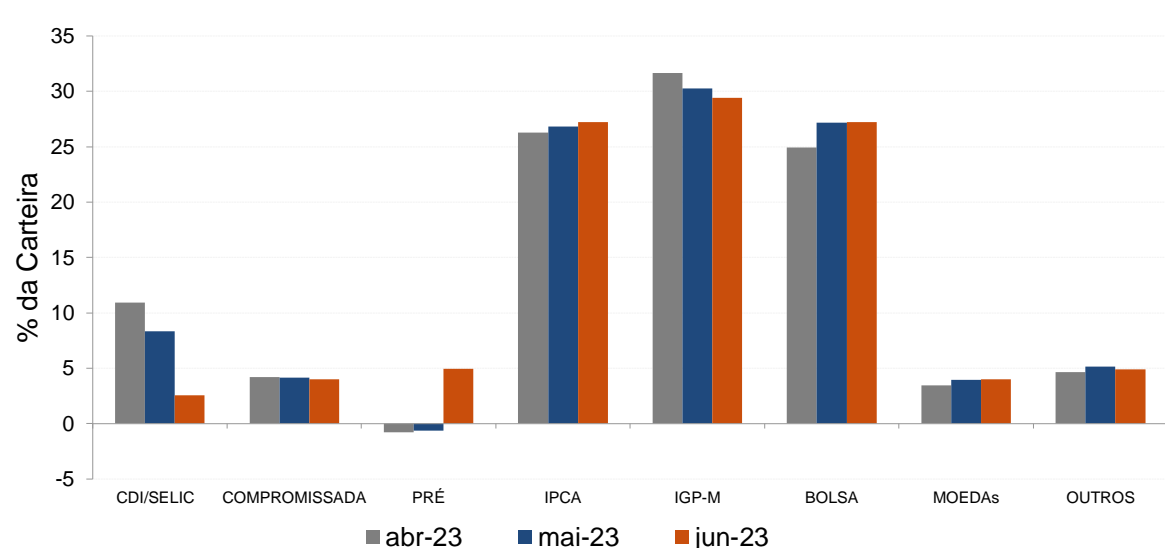
Distribuição da Carteira

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.

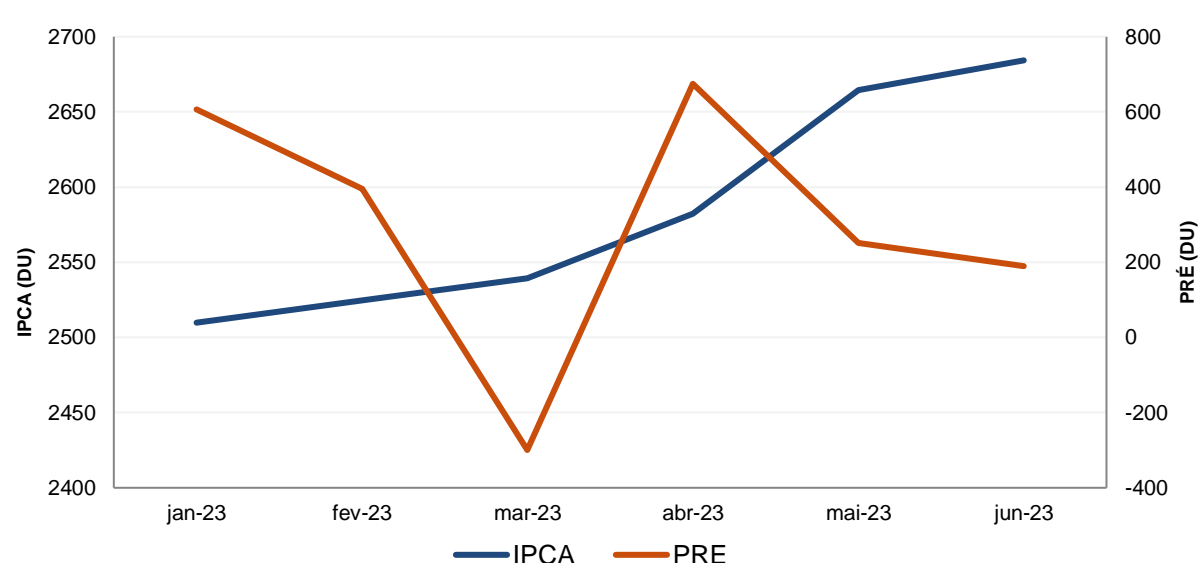
Evolução do Patrimônio Líquido



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	29.592,43	8,03	28.801,75	7,76
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	24.582,95	6,67	24.978,60	6,73
ITSA4	Intermediários Financeiros	15.571,06	4,22	16.309,05	4,39
ELET3	Energia Elétrica	15.349,04	4,16	15.290,14	4,12
EQTL3	Energia Elétrica	15.270,47	4,14	15.245,85	4,11
ITUB4	Intermediários Financeiros	13.381,35	3,63	15.130,82	4,07
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	13.237,61	3,59	15.379,32	4,14
RENT3	Diversos	11.917,57	3,23	12.900,03	3,47
BPAC11	Intermediários Financeiros	10.541,92	2,86	9.691,25	2,61
BBAS3	Intermediários Financeiros	10.443,32	2,83	10.270,18	2,77

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

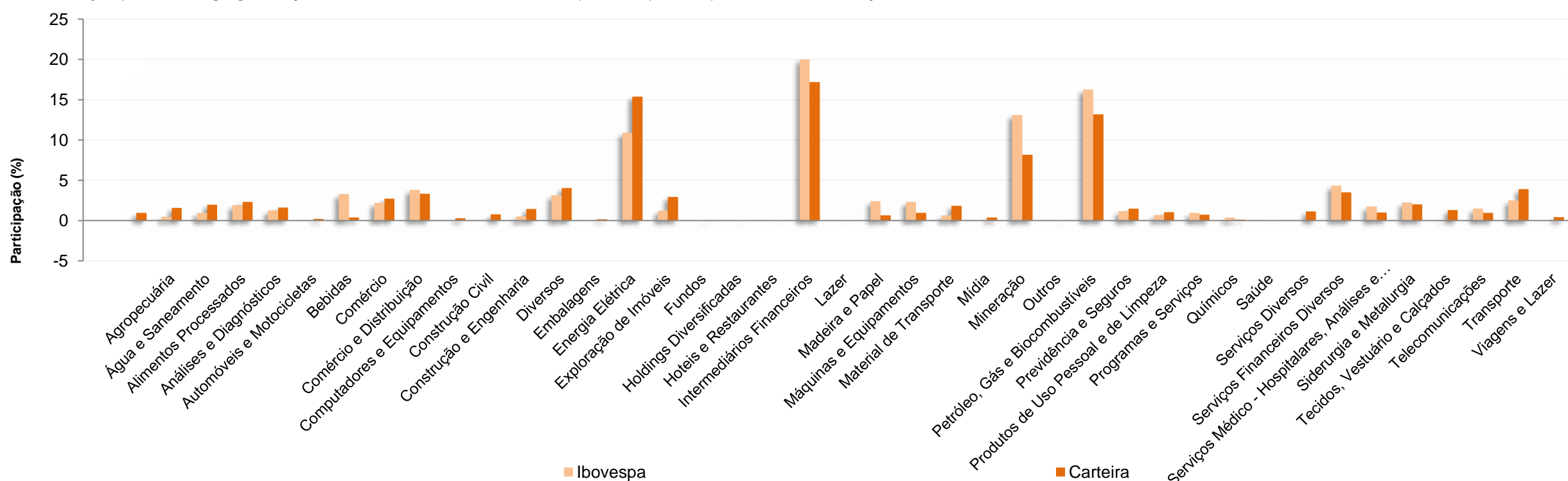
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	98,35	0,03	0,12	190
MTSA4	383,94	0,10	0,37	13
SCAR3	135,70	0,04	0,05	8
ELMD3	1.482,13	0,40	0,25	6
EALT4	103,16	0,03	0,18	5
AGXY3	309,54	0,08	0,07	4
ALLD3	270,84	0,07	0,24	3
TTEN3	3.348,14	0,91	0,23	2
MEGA3	2.992,24	0,81	0,00	2
MATD3	1.470,77	0,40	0,22	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: 30/06/2023

Análises de Contrapartes

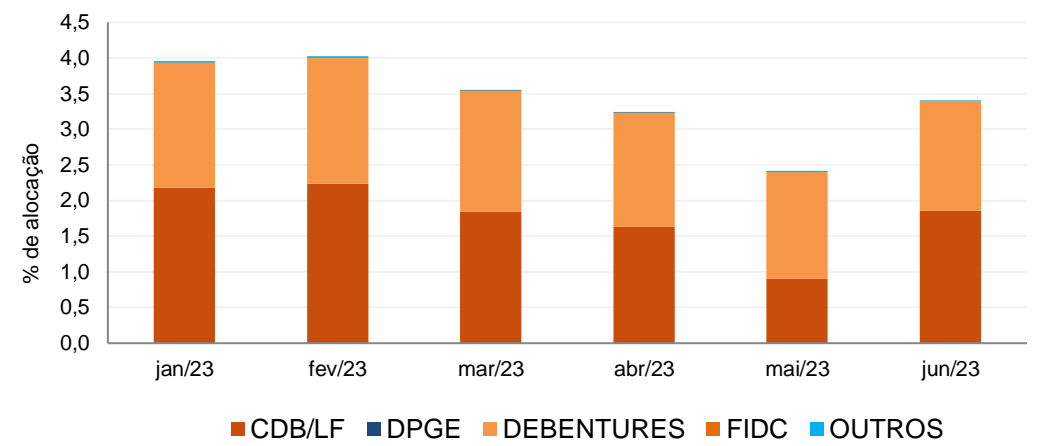
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
VALE SA	44.933,88	3,32	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	24.624,42	1,82	Faixa 2
BCO BRADESCO SA	21.097,76	1,56	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	16.418,85	1,21	Faixa 2
ITAUSA SA	15.724,76	1,16	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	15.605,64	1,15	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	13.382,83	0,99	Faixa 1
PRIO S.A.	13.237,61	0,98	Faixa 2
LOCALIZA RENT A CAR SA	11.917,57	0,88	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	10.541,93	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: 30/06/2023

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
LF CDI	23-dez-25	5.944.673	0,44%	CDI	BCO BRADESCO SA	05-jun-23	0,97%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LF CDI Mensal	05-jun-25	3.961.200	0,29%	CDI	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVE	05-jun-23	1,00%	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 2025-03-01	01-mar-25	1.530.907	0,11%	Selic		09-jun-23	0,02%	0,02%	URCA FI MULT CRED PRIV

