

## ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>1.215.051.873,58</b>	<b>75,57%</b>				<b>2,20%</b>	<b>6,73%</b>	<b>10,46%</b>	<b>10,46%</b>	<b>14,61%</b>	<b>19,59%</b>	<b>24,47%</b>
Benchmark:	CDI					1,07%	3,15%	6,50%	6,50%	13,54%	23,37%	26,17%
<b>Renda Fixa CDI</b>	<b>557.566.275,45</b>	<b>34,68%</b>			<b>0,03%</b>							
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	372.021.223,35	23,14%	ALFA	40,19%	0,02%	1,15%	3,28%	6,61%	6,61%	14,15%	25,11%	28,04%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	9.899.536,92	0,62%	BRADESCO	41,10%		1,06%	3,10%	6,41%	6,41%	13,35%	22,97%	25,66%
URCA FI MULT CRED PRIV	175.645.515,17	10,92%	SANTANDER	38,93%	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%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>657.485.598,13</b>	<b>40,89%</b>										
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	657.485.598,13	40,89%		100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					1,07%	3,15%	6,50%	6,50%	13,54%	23,37%	26,17%
<b>Renda Variável</b>	<b>224.336.798,30</b>	<b>13,95%</b>				<b>9,56%</b>	<b>17,16%</b>	<b>9,17%</b>	<b>9,17%</b>	<b>18,92%</b>	<b>-8,51%</b>	<b>23,02%</b>
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					9,05%	15,51%	7,64%	7,64%	19,95%	-5,85%	30,92%
<b>Renda Variável Ativa</b>	<b>224.336.798,30</b>	<b>13,95%</b>			<b>1,37%</b>							
GRUMARI FIA	17.361.713,62	1,08%	AZ QUEST	25,20%	12,62%	9,00%	16,01%	9,76%	9,76%	13,98%	-18,78%	12,37%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	41.540.345,06	2,58%	CONSTANCIA	25,20%	8,56%	8,71%	18,79%	13,38%	13,38%	19,29%	-1,05%	28,15%
ELETROS ITAUNA FIA	34.641.127,01	2,15%	ELETROBRÁS	25,20%	7,67%	-	-	-	-	-	-	-
FIA SÃO CONRADO	7.392.015,27	0,46%	EQUITAS	25,20%	9,05%	9,36%	16,90%	26,96%	26,96%	28,88%	-30,91%	-6,68%
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	89.528.564,25	5,57%	SHARP	25,24%	6,89%	10,10%	15,93%	6,84%	6,84%	21,44%	-0,42%	36,10%
VINCI JOATINGA FIA	15.173.248,10	0,94%	VINCI	25,20%	8,25%	10,31%	19,25%	11,75%	11,75%	17,36%	-10,83%	15,80%
FIA PIPA	18.699.784,98	1,16%	XP	25,20%	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%
<b>Estruturado</b>	<b>89.837.068,38</b>	<b>5,59%</b>				<b>2,58%</b>	<b>2,72%</b>	<b>2,43%</b>	<b>2,43%</b>	<b>8,37%</b>	<b>19,51%</b>	<b>22,88%</b>
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,24%	3,64%	7,54%	7,54%	15,80%	28,34%	33,87%
<b>Multimercados Estruturados</b>	<b>89.837.068,38</b>	<b>5,59%</b>			<b>1,94%</b>							
NAVI LS ESTRUT FIC FI MULT	29.071.394,11	1,81%	NAVI CAPITAL	5,87%	2,46%	2,07%	1,99%	1,81%	1,81%	9,31%	22,94%	28,30%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	5.335.929,56	0,33%	OCCAM	0,50%	2,90%	1,46%	-1,36%	-2,22%	-2,22%	2,34%	10,88%	17,54%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	21.123.676,26	1,31%	OCCAM	1,96%	2,90%	1,46%	-1,36%	-2,22%	-2,22%	2,34%	10,90%	17,53%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	17.753.391,35	1,10%	QUANTITAS	7,87%		2,34%	5,65%	7,33%	7,33%	19,26%	34,42%	41,65%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	16.552.677,11	1,03%	ZEITGEIST	1,17%	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%
<b>Exterior</b>	<b>54.319.158,71</b>	<b>3,38%</b>				<b>0,86%</b>	<b>2,39%</b>	<b>4,56%</b>	<b>4,56%</b>	<b>8,71%</b>	<b>1,11%</b>	<b>23,58%</b>
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					0,18%	0,82%	5,28%	5,28%	7,20%	-5,27%	18,58%
<b>Exterior - RV</b>	<b>54.319.158,71</b>	<b>3,38%</b>			<b>3,02%</b>							
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	54.319.158,71	3,38%	BLACKROCK	1,96%	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%
<b>Operações com Participantes</b>	<b>23.605.898,16</b>	<b>1,47%</b>				<b>0,94%</b>	<b>2,00%</b>	<b>4,94%</b>	<b>4,94%</b>	<b>5,81%</b>	<b>26,92%</b>	<b>46,51%</b>
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.					0,82%	3,50%	8,39%	8,39%	14,90%	43,51%	74,85%
<b>Imobiliário</b>	<b>705.931,21</b>	<b>0,04%</b>				<b>0,45%</b>	<b>1,10%</b>	<b>2,31%</b>	<b>2,31%</b>	<b>5,62%</b>	<b>13,71%</b>	<b>39,99%</b>
Benchmark:	INPC					-0,10%	0,79%	2,69%	2,69%	3,00%	15,28%	25,91%
<b>Total</b>	<b>1.607.846.174,93</b>	<b>100%</b>				<b>1,59%</b>	<b>3,12%</b>	<b>7,81%</b>	<b>9,35%</b>	<b>9,35%</b>	<b>14,78%</b>	<b>12,30%</b>
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.

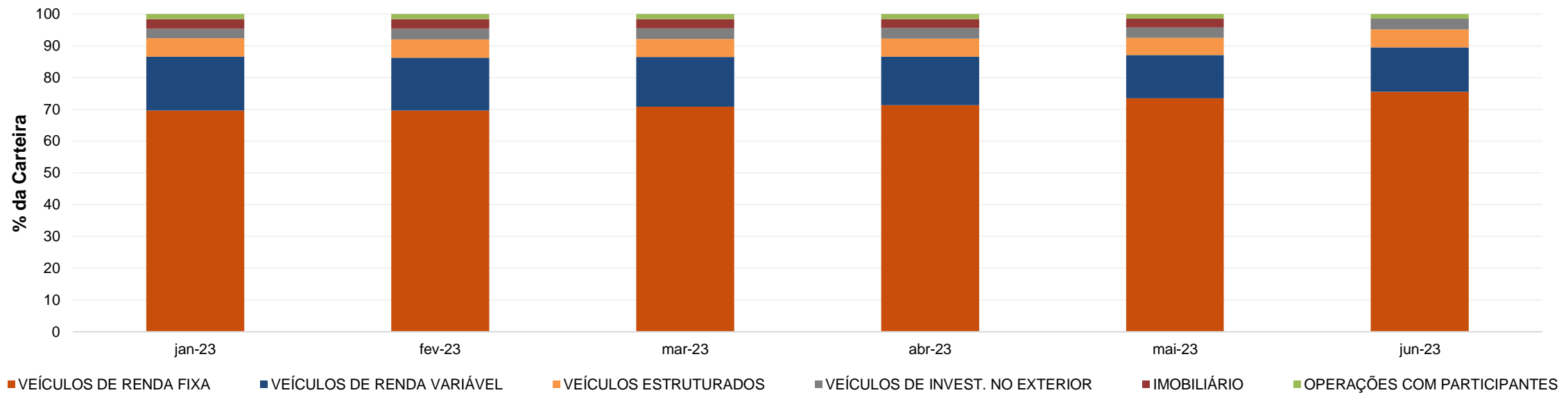
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

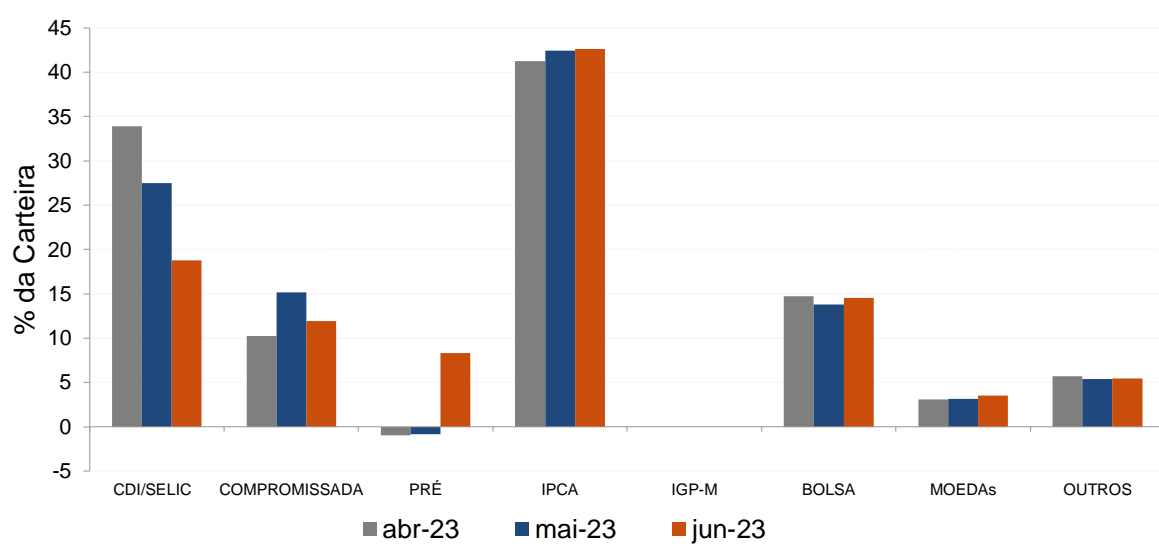
## Distribuição da Carteira

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.

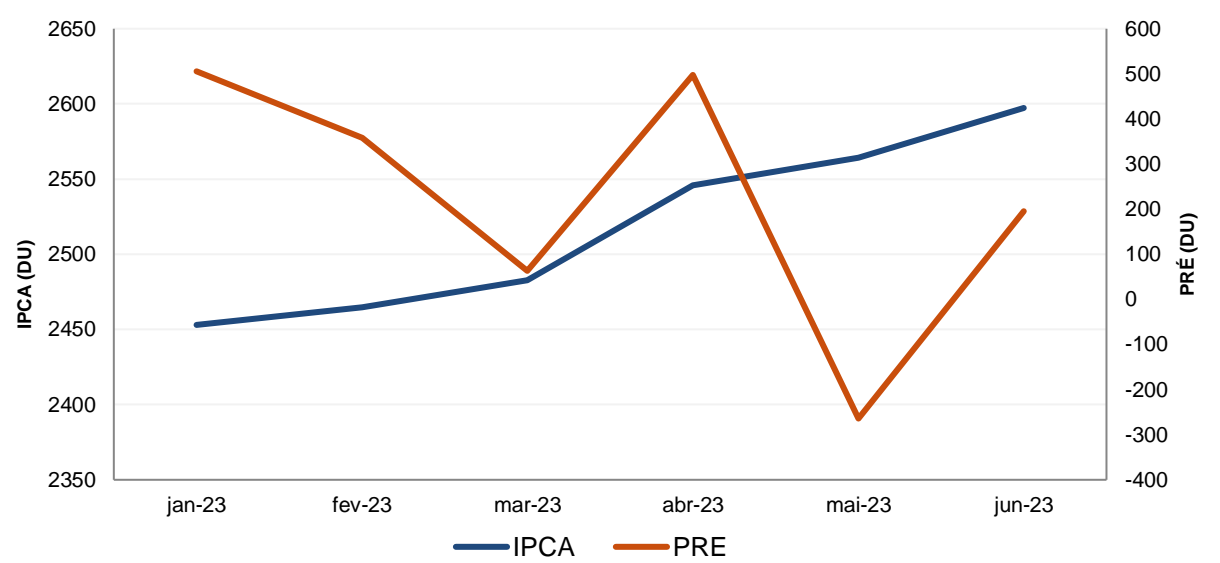
### Evolução do Patrimônio Líquido



### 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	18.021,10	7,73	17.406,16	7,60
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	15.973,66	6,85	15.501,31	6,76
EQTL3	Energia Elétrica	11.025,18	4,73	10.667,32	4,65
ELET3	Energia Elétrica	10.283,94	4,41	9.998,67	4,36
ITSA4	Intermediários Financeiros	10.243,74	4,39	10.344,54	4,51
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	8.752,63	3,75	9.496,20	4,14
ITUB4	Intermediários Financeiros	8.710,95	3,74	10.134,86	4,42
RENT3	Diversos	7.752,74	3,33	7.876,07	3,44
BBAS3	Intermediários Financeiros	7.073,16	3,03	6.495,00	2,83
BPAC11	Intermediários Financeiros	6.695,04	2,87	5.948,71	2,60

\* em mil R\$

### Liquidez da Carteira de Ações

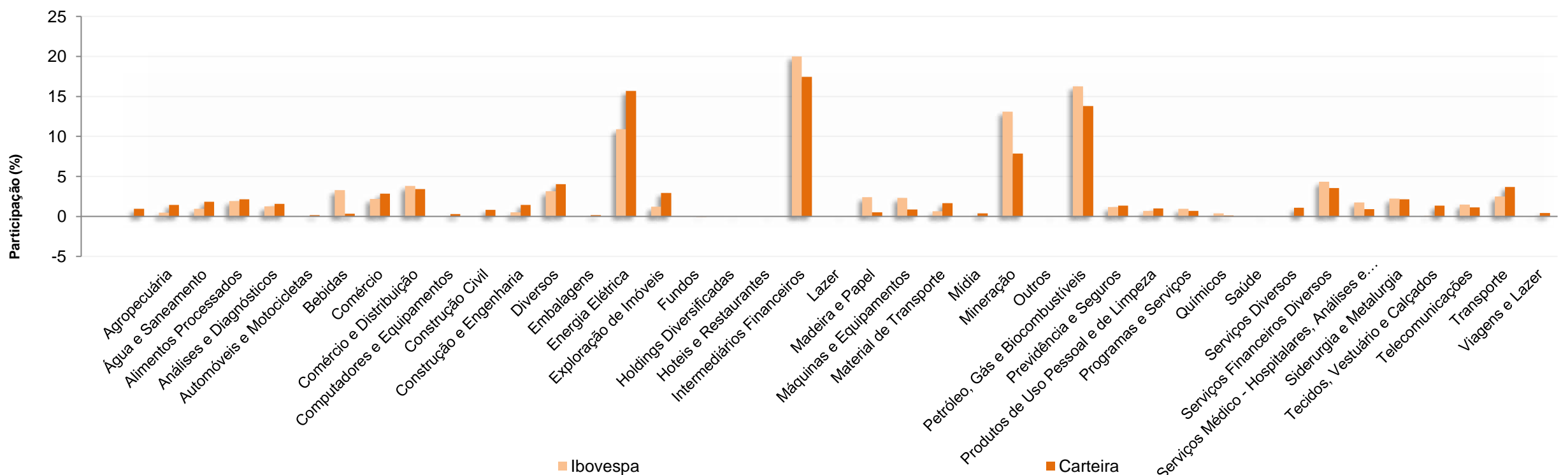
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	58,70	0,03	0,07	114
MTSA4	229,16	0,10	0,22	8
SCAR3	81,00	0,03	0,03	5
ELMD3	884,63	0,38	0,15	4
EALT4	61,57	0,03	0,11	3
AGXY3	184,75	0,08	0,04	2
ALLD3	161,65	0,07	0,14	2
OFSA3	36,88	0,02	0,02	2
VALE3	18.021,10	7,73	0,01	1
PETRA4	15.973,66	6,85	0,01	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.



ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 30/06/2023

## Análises de Contrapartes

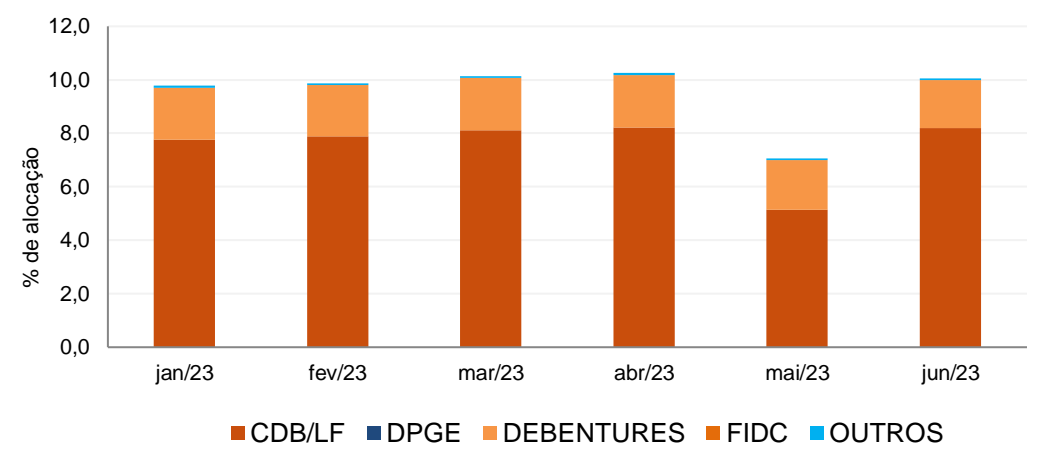
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	61.215,20	3,90	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	37.945,38	2,42	Faixa 2
BCO SAFRA SA	18.502,78	1,18	Faixa 1
VALE SA	18.021,10	1,15	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	15.747,57	1,00	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	12.516,15	0,80	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	11.258,74	0,72	Faixa 1
ITAUSA SA	11.031,23	0,70	Faixa 2
BCO ITAU SA	9.830,08	0,63	Faixa 1
PRIO S.A.	8.752,63	0,56	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 CD PURO

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	30.457.769	1,94%	CDI	BCO BRADESCO SA	05-jun-23	0,97%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LF CDI Mensal	05-jun-25	20.295.368	1,29%	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	7.843.666	0,50%	Selic		09-jun-23	0,02%	0,02%	URCA FI MULT CRED PRIV



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.