

ELETROS - ELETROS PLANO CD ELETROBRAS

Data-base: 31/07/2023

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	1.443.482.810,20	72,67%			1,13%	4,69%	9,83%	9,76%	15,26%	19,84%	29,06%
Benchmark:	CDI				1,07%	3,30%	6,44%	7,64%	13,58%	24,25%	27,27%
Renda Fixa CDI	654.057.985,41	32,93%		0,03%							
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	438.544.513,09	22,08%	ALFA	46,17%	1,15%	3,52%	6,62%	7,84%	14,10%	26,03%	29,16%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	11.492.466,20	0,58%	BRADESCO	47,22%	1,06%	3,26%	6,36%	7,54%	13,41%	23,85%	26,76%
URCA FI MULT CRED PRIV	204.021.006,12	10,27%	SANTANDER	44,75%	1,12%	3,74%	6,99%	8,15%	14,50%	25,49%	28,38%
Benchmark:	CDI				1,07%	3,30%	6,44%	7,64%	13,58%	24,25%	27,27%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	789.424.824,79	39,74%									
ELETROS PLANO CD ELETROBRAS CARTEIRA PROF	789.424.824,79	39,74%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,07%	3,30%	6,44%	7,64%	13,58%	24,25%	27,27%
Renda Variável	280.741.740,98	14,13%			3,36%	18,41%	8,64%	12,83%	17,10%	-1,34%	16,49%
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				3,49%	17,11%	7,43%	11,40%	18,71%	1,32%	24,74%
Renda Variável Ativa	280.741.740,98	14,13%		1,36%							
GRUMARI FIA	22.239.720,45	1,12%	AZ QUEST	30,98%	9,45%	4,19%	18,75%	11,37%	14,36%	14,42%	-11,45%
ISHARES IBOV FUNDO DE ÍNDICE	132.200,37	0,01%	BLACKROCK	0,00%	6,91%	3,31%	16,90%	7,38%	11,33%	18,78%	0,72%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	51.904.548,98	2,61%	CONSTANCIA	30,98%	7,78%	1,63%	17,08%	10,71%	15,23%	15,57%	4,74%
ELETROS ITAUNA FIA	43.125.519,18	2,17%	ELETROBRÁS	30,98%	6,94%	3,83%	-	-	-	-	-
FIA SÃO CONRADO	9.195.454,56	0,46%	EQUITAS	30,98%	8,04%	1,18%	18,31%	17,22%	28,46%	22,15%	-25,49%
SHARP ARPOADOR IBrX ATIVO FIA	112.669.491,32	5,67%	SHARP	31,03%	6,66%	4,40%	18,38%	7,09%	11,54%	20,17%	8,02%
VINCI JOATINGA FIA	18.282.235,65	0,92%	VINCI	30,98%	6,76%	3,88%	21,65%	12,44%	16,09%	16,51%	-3,40%
FIA PIPA	23.192.570,48	1,17%	XP	30,98%	6,48%	0,88%	15,27%	10,02%	13,86%	14,73%	5,02%
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				3,49%	17,11%	7,43%	11,40%	18,71%	1,32%	24,74%
Estruturado	102.631.365,74	5,17%									
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,24%	3,82%	7,48%	8,87%	15,85%	29,25%	35,02%
Multimercados Estruturados	102.631.365,74	5,17%		2,03%							
NAVI LS ESTRUT FIC FI MULT	33.350.925,52	1,68%	NAVI CAPITAL	6,64%	2,68%	1,90%	4,63%	3,88%	3,75%	11,58%	25,33%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	24.123.932,90	1,21%	OCCAM	2,39%	2,48%	1,44%	0,13%	-0,92%	-0,81%	3,78%	12,39%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	6.093.781,75	0,31%	OCCAM	0,67%	2,48%	1,44%	0,13%	-0,92%	-0,82%	3,78%	12,38%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	20.335.078,60	1,02%	QUANTITAS	8,86%		1,74%	5,56%	8,34%	9,20%	19,42%	35,56%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	18.727.646,96	0,94%	ZEITGEIST	1,36%	3,60%	0,49%	6,97%	6,17%	6,94%	8,45%	23,31%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,24%	3,82%	7,48%	8,87%	15,85%	29,25%	35,02%
Exterior	68.013.240,79	3,42%									
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				1,62%	2,45%	2,31%	6,99%	1,97%	-7,57%	21,14%
Exterior - RV	68.013.240,79	3,42%		2,40%							
ISHARES S&P 500 FIC FUNDO DE ÍNDICE - IE	68.013.240,79	3,42%	BLACKROCK	2,31%	3,03%	1,94%	4,38%	5,09%	6,59%	2,27%	-4,21%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				1,62%	2,45%	2,31%	6,99%	1,97%	-7,57%	21,14%
Operações com Participantes	29.746.347,19	1,50%									
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.				0,83%	3,00%	7,75%	9,28%	15,49%	41,87%	73,78%
Imobiliário	61.873.207,60	3,11%									
Benchmark:	INPC				-0,09%	0,17%	2,13%	2,59%	3,53%	14,01%	25,24%
Total	1.986.475.994,16	100%			1,84%	1,52%	6,73%	8,56%	9,47%	14,30%	25,96%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,33%	1,47%	4,68%	5,63%	8,89%	26,12%	45,70%

* 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.

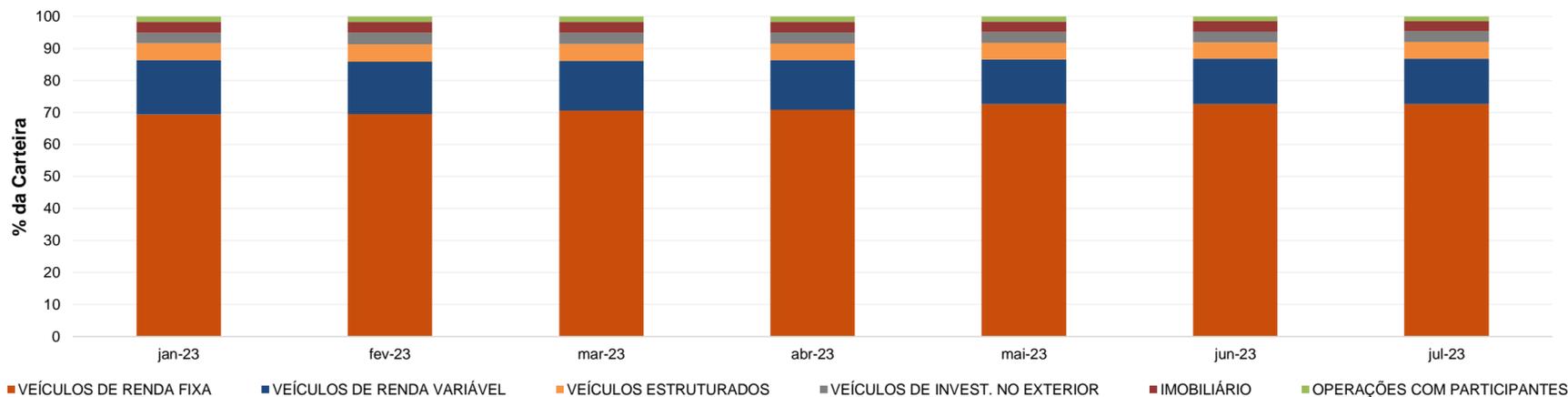
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

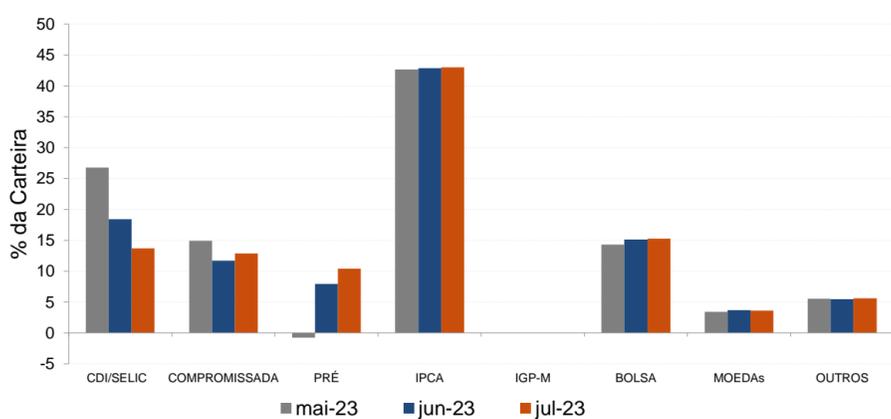
Distribuição da Carteira

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.

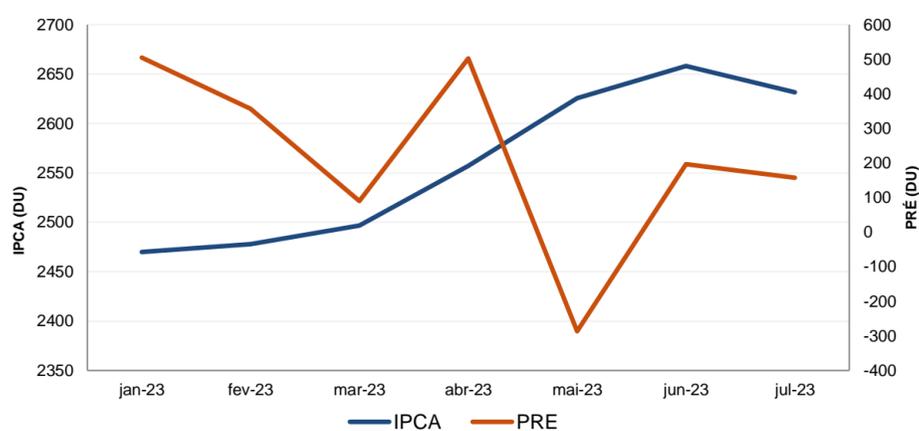
Evolução do Patrimônio Líquido



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	21.831,98	7,53	22.246,43	7,77
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	18.402,09	6,34	19.553,47	6,83
EQLT3	Energia Elétrica	14.730,24	5,08	13.325,55	4,65
ELET3	Energia Elétrica	12.012,10	4,14	12.540,67	4,38
ITSA4	Intermediários Financeiros	11.534,21	3,98	12.519,97	4,37
ITUB4	Intermediários Financeiros	11.419,08	3,94	10.660,67	3,72
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	10.524,03	3,63	10.690,81	3,73
RENT3	Diversos	9.539,35	3,29	9.488,81	3,31
BPAC11	Intermediários Financeiros	9.226,86	3,18	8.219,39	2,87
BBAS3	Intermediários Financeiros	7.752,72	2,67	8.613,91	3,01

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

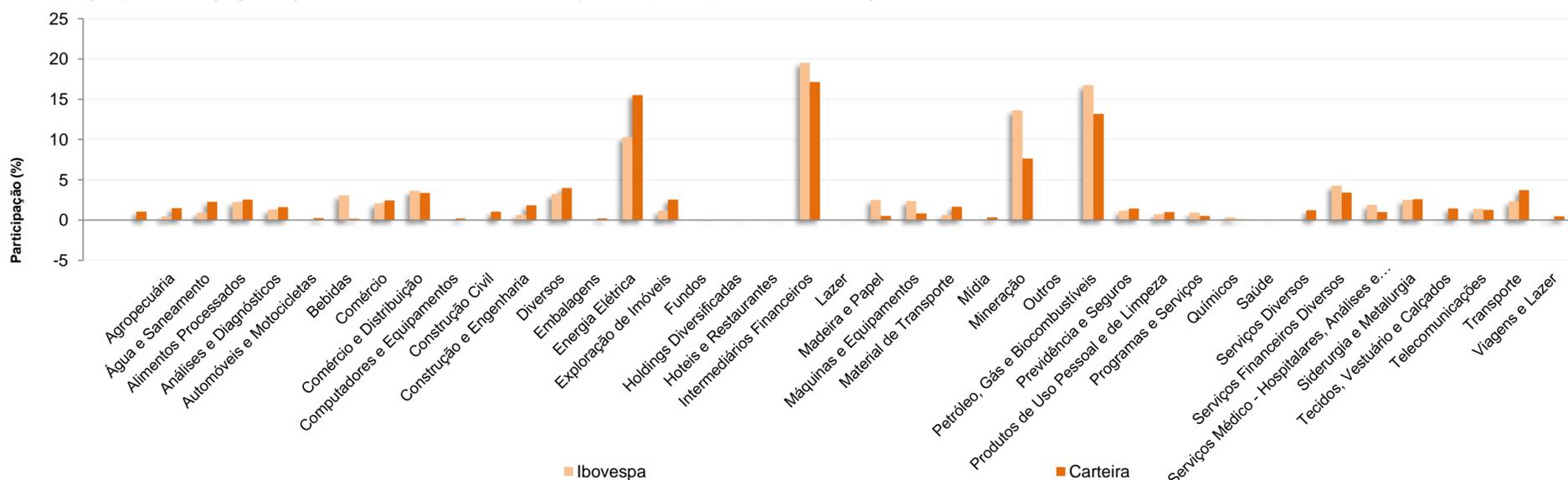
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	71,49	0,02	0,09	72
MTSA4	297,77	0,10	0,27	16
SCAR3	118,85	0,04	0,04	6
EALT4	78,00	0,03	0,13	6
ELMD3	1.003,38	0,35	0,19	4
ALLD3	190,96	0,07	0,18	4
AGXY3	202,94	0,07	0,05	3
MEGA3	2.228,95	0,77	0,00	2
MATD3	1.056,53	0,36	0,17	2
HBRE3	297,88	0,10	0,20	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 ELETROBRAS

Data-base: 31/07/2023

Análises de Contrapartes

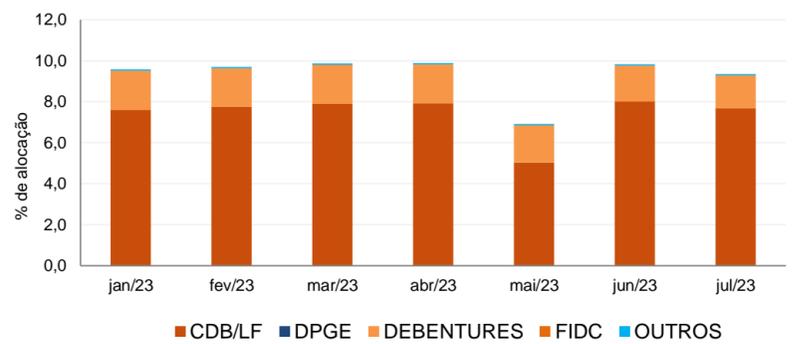
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	71.311,88	3,80	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	43.576,86	2,32	Faixa 2
VALE SA	21.831,98	1,16	Faixa 1
BCO SAFRA SA	21.250,35	1,13	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	18.543,59	0,99	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	14.730,24	0,79	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	14.547,79	0,78	Faixa 2
ITAUSA SA	12.431,80	0,66	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	11.423,43	0,61	Faixa 1
BCO ITAU SA	11.371,32	0,61	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 ELETROBRAS

Data-base: 31/07/2023

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
MOVI17	15-set-26	2.251.539	0,12%	CDI	MOVIDA PARTICIPACOES	10-jul-23	3,26%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - II
MOVI17	15-set-26	233.719	0,01%	CDI	MOVIDA PARTICIPACOES	12-jul-23	3,26%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - II
MOVI17	15-set-26	210.492	0,01%	CDI	MOVIDA PARTICIPACOES	12-jul-23	3,26%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - II
MOVI25	15-out-25	69.956	0,00%	CDI	MOVIDA PARTICIPACOES	12-jul-23	3,10%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - II

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2026-03-01	01-mar-26	6.068.773	0,32%	Selic		12-jul-23	6,00%	0,00%	URCA FI MULT CRED PRIV
LFT 2026-03-01	01-mar-26	4.509.099	0,24%	Selic		10-jul-23	7,00%	0,00%	URCA FI MULT CRED PRIV
LFT 2027-03-01	01-mar-27	8.804.447	0,47%	Selic		12-jul-23	0,13%	0,13%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - II
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.436.285	0,08%	IPCA		18-jul-23	5,51%	5,43%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.147.866	0,06%	IPCA		18-jul-23	5,49%	5,43%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	572.965	0,03%	IPCA		21-jul-23	5,46%	5,39%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	503.280	0,03%	IPCA		21-jul-23	5,45%	5,39%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	286.483	0,02%	IPCA		21-jul-23	5,46%	5,39%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	286.483	0,02%	IPCA		18-jul-23	5,49%	5,43%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	143.241	0,01%	IPCA		21-jul-23	5,47%	5,39%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	143.241	0,01%	IPCA		21-jul-23	5,46%	5,39%	URCA FI MULT CRED PRIV

