

ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

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	216.849.638,44	68,60%				0,89%	6,75%	13,33%	12,88%	18,52%	21,22%	24,14%
Benchmark:	CDI					1,07%	3,30%	6,44%	7,64%	13,58%	24,25%	27,27%
Renda Fixa CDI	89.864.799,55	28,43%			0,03%							
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	60.254.160,40	19,06%	ALFA	6,34%	0,01%	1,15%	3,52%	6,62%	7,84%	14,10%	26,03%	29,16%
BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.579.016,23	0,50%	BRDESCO	6,49%		1,06%	3,26%	6,36%	7,54%	13,41%	23,85%	26,76%
URCA FI MULT CRED PRIV	28.031.622,93	8,87%	SANTANDER	6,15%	0,08%	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	126.984.838,89	40,17%										
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	126.984.838,89	40,17%		100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					1,07%	3,30%	6,44%	7,64%	13,58%	24,25%	27,27%
Renda Variável	51.910.334,14	16,42%				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	51.910.334,14	16,42%			1,36%							
GRUMARI FIA	4.112.218,28	1,30%	AZ QUEST	5,73%	9,45%	4,19%	18,75%	11,37%	14,36%	14,42%	-11,45%	2,53%
ISHARES IBOV FUNDO DE ÍNDICE	24.444,40	0,01%	BLACKROCK	0,00%	6,91%	3,31%	16,90%	7,38%	11,33%	18,78%	0,72%	18,79%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	9.597.370,42	3,04%	CONSTANCIA	5,73%	7,78%	1,63%	17,08%	10,71%	15,23%	15,57%	4,74%	19,78%
ELETROS ITAUNA FIA	7.974.090,72	2,52%	ELETROBRÁS	5,73%	6,94%	3,83%	-	-	-	-	-	-
FIA SÃO CONRADO	1.700.278,40	0,54%	EQUITAS	5,73%	8,04%	1,18%	18,31%	17,22%	28,46%	22,15%	-25,49%	-12,11%
SHARP ARPOADOR IBrX ATIVO FIA	20.833.065,01	6,59%	SHARP	5,74%	6,66%	4,40%	18,38%	7,09%	11,54%	20,17%	8,02%	30,02%
VINCI JOATINGA FIA	3.380.462,62	1,07%	VINCI	5,73%	6,76%	3,88%	21,65%	12,44%	16,09%	16,51%	-3,40%	10,25%
FIA PIPA	4.288.404,28	1,36%	XP	5,73%	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	11.472.628,85	3,63%				1,47%	3,85%	3,66%	3,93%	9,82%	20,98%	24,69%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,24%	3,82%	7,48%	8,87%	15,85%	29,25%	35,02%
Multimercados Estruturados	11.472.628,85	3,63%			2,03%							
NAVI LS ESTRUT FIC FI MULT	3.728.127,24	1,18%	NAVI CAPITAL	0,74%	2,68%	1,90%	4,63%	3,88%	3,75%	11,58%	25,33%	29,46%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	681.192,30	0,22%	OCCAM	0,08%	2,48%	1,44%	0,13%	-0,92%	-0,82%	3,78%	12,38%	16,42%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	2.696.689,52	0,85%	OCCAM	0,27%	2,48%	1,44%	0,13%	-0,92%	-0,81%	3,78%	12,39%	16,41%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	2.273.153,12	0,72%	QUANTITAS	0,99%		1,74%	5,56%	8,34%	9,20%	19,42%	35,56%	44,80%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	2.093.466,66	0,66%	ZEITGEIST	0,15%	3,60%	0,49%	6,97%	6,17%	6,94%	8,45%	23,31%	25,98%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,24%	3,82%	7,48%	8,87%	15,85%	29,25%	35,02%
Exterior	12.638.863,66	4,00%				1,94%	4,38%	5,09%	6,59%	2,41%	-4,28%	25,98%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					1,62%	2,45%	2,31%	6,99%	1,97%	-7,57%	21,14%
Exterior - RV	12.638.863,66	4,00%			2,40%							
ISHARES S&P 500 FIC FUNDO DE ÍNDICE - IE	12.638.863,66	4,00%	BLACKROCK	0,43%	3,03%	1,94%	4,38%	5,09%	6,59%	2,27%	-4,21%	30,56%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					1,62%	2,45%	2,31%	6,99%	1,97%	-7,57%	21,14%
Operações com Participantes	6.462.777,48	2,04%				2,16%	2,23%	6,35%	7,63%	14,93%	33,78%	59,33%
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.					0,83%	3,00%	7,75%	9,28%	15,49%	41,87%	73,78%
Imobiliário	16.775.892,67	5,31%				0,42%	1,17%	1,99%	2,75%	5,39%	13,53%	39,66%
Benchmark:	INPC					-0,09%	0,17%	2,13%	2,59%	3,53%	14,01%	25,24%
Total	316.108.104,41	100%				2,15%	1,35%	7,98%	11,21%	11,80%	16,81%	23,81%
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.

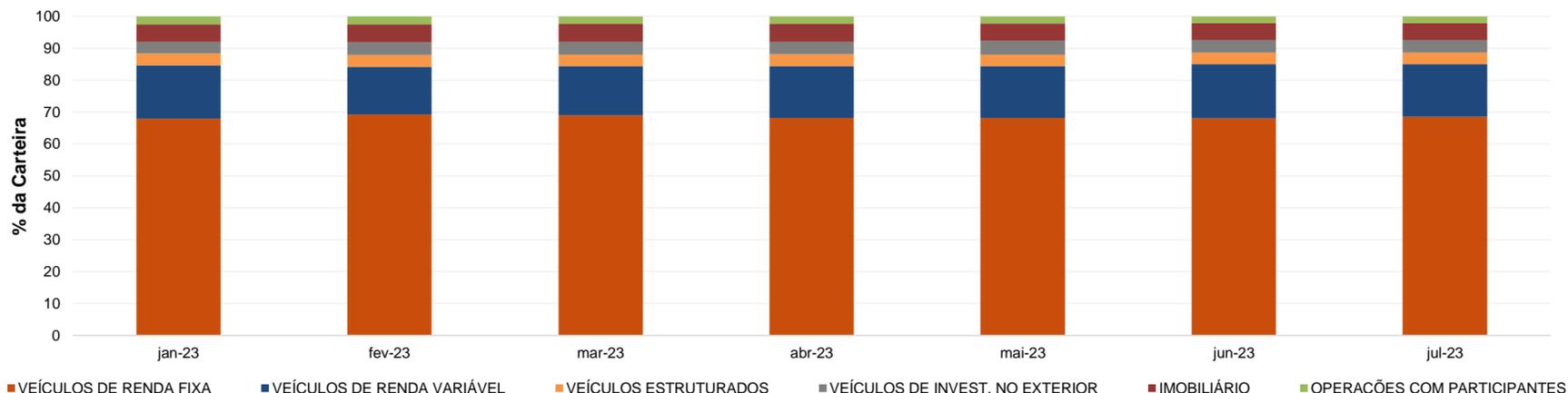
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

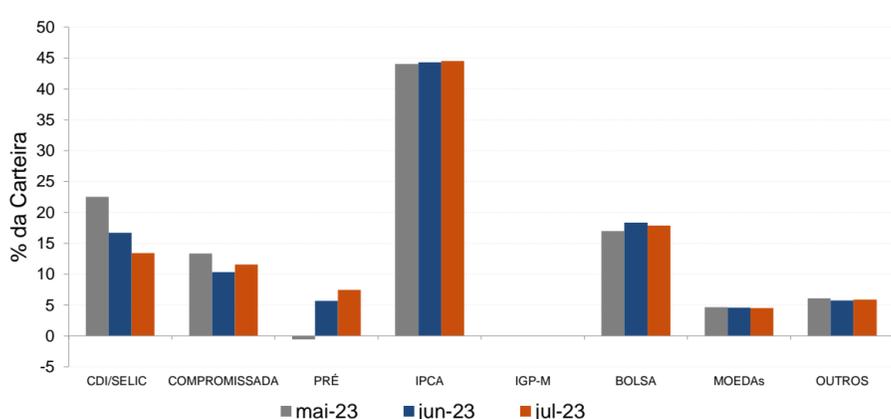
Distribuição da Carteira

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.

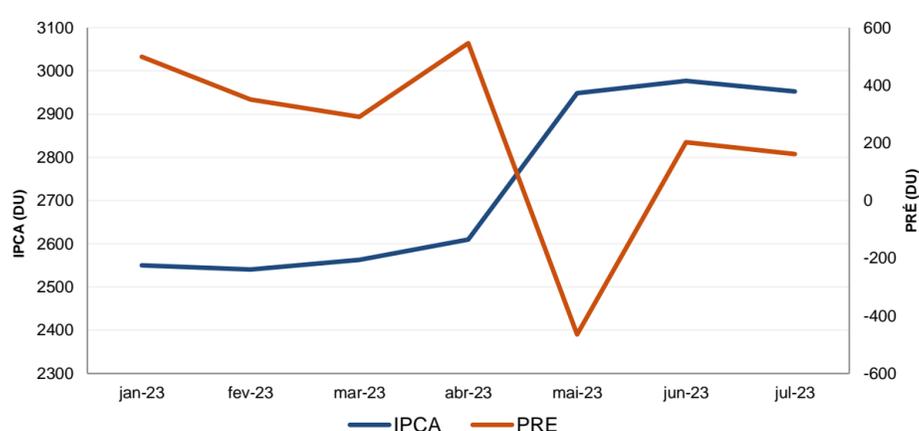
Evolução do Patrimônio Líquido



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	3.984,61	7,68	4.225,34	7,94
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	3.258,36	6,28	3.579,81	6,72
EQTL3	Energia Elétrica	2.450,76	4,72	2.300,37	4,32
ELET3	Energia Elétrica	2.094,83	4,04	2.256,73	4,24
ITSA4	Intermediários Financeiros	2.051,61	3,95	2.276,23	4,28
ITUB4	Intermediários Financeiros	1.982,60	3,82	1.949,72	3,66
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	1.804,28	3,48	1.938,18	3,64
RENT3	Diversos	1.662,77	3,20	1.736,07	3,26
BPAC11	Intermediários Financeiros	1.626,52	3,13	1.524,36	2,86
BBAS3	Intermediários Financeiros	1.327,20	2,56	1.540,74	2,89

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

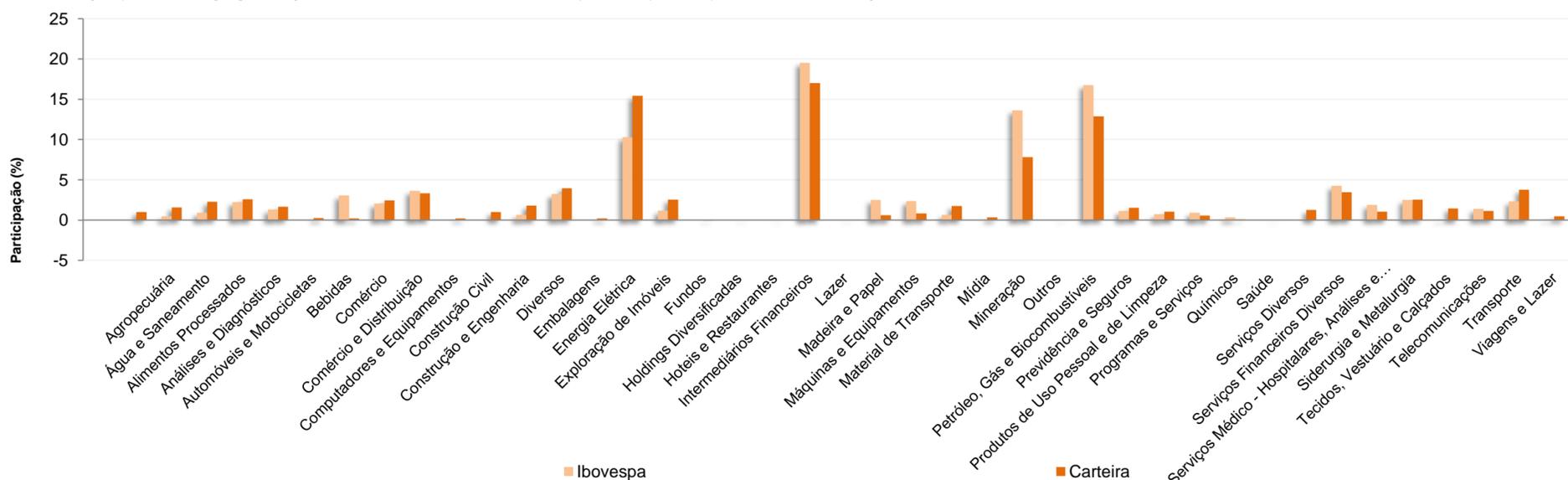
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	13,22	0,03	0,02	14
MTSA4	55,06	0,11	0,05	3
VALE3	3.984,61	7,68	0,00	1
PETR4	3.258,36	6,28	0,00	1
EQTL3	2.450,76	4,72	0,01	1
ELET3	2.094,83	4,04	0,01	1
ITSA4	2.051,61	3,95	0,00	1
ITUB4	1.982,60	3,82	0,00	1
PRI03	1.804,28	3,48	0,01	1
RENT3	1.662,77	3,20	0,00	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.



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 SALDADO

Data-base: 31/07/2023

Análises de Contrapartes

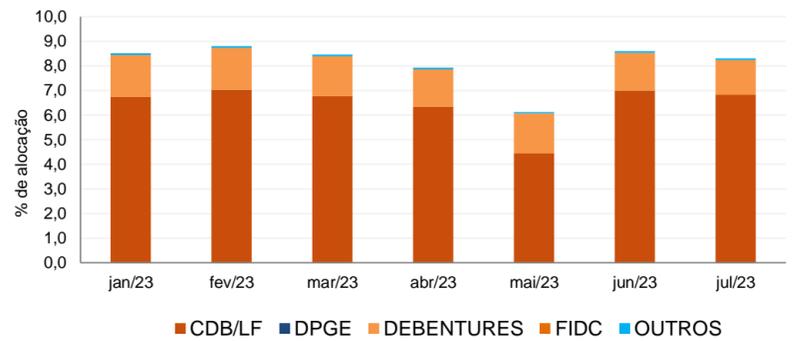
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	10.167,38	3,50	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	5.987,28	2,06	Faixa 2
VALE SA	3.984,61	1,37	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	3.289,25	1,13	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.919,71	1,01	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	2.450,76	0,84	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	2.443,14	0,84	Faixa 2
ITAUSA SA	2.174,94	0,75	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	1.983,08	0,68	Faixa 1
PRIOR S.A.	1.804,28	0,62	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 SALDADO

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	309.352	0,11%	CDI	MOVIDA PARTICIPACOES	10-jul-23	3,26%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
MOVI17	15-set-26	32.112	0,01%	CDI	MOVIDA PARTICIPACOES	12-jul-23	3,26%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
MOVI17	15-set-26	28.921	0,01%	CDI	MOVIDA PARTICIPACOES	12-jul-23	3,26%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
MOVI25	15-out-25	9.612	0,00%	CDI	MOVIDA PARTICIPACOES	12-jul-23	3,10%	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 2026-03-01	01-mar-26	833.824	0,29%	Selic		12-jul-23	6,00%	0,00%	URCA FI MULT CRED PRIV
LFT 2026-03-01	01-mar-26	619.531	0,21%	Selic		10-jul-23	7,00%	0,00%	URCA FI MULT CRED PRIV
LFT 2027-03-01	01-mar-27	1.209.694	0,42%	Selic		12-jul-23	0,13%	0,13%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	197.339	0,07%	IPCA		18-jul-23	5,51%	5,43%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	157.712	0,05%	IPCA		18-jul-23	5,49%	5,43%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	78.723	0,03%	IPCA		21-jul-23	5,46%	5,39%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	69.149	0,02%	IPCA		21-jul-23	5,45%	5,39%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	39.362	0,01%	IPCA		21-jul-23	5,46%	5,39%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	39.362	0,01%	IPCA		18-jul-23	5,49%	5,43%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	19.681	0,01%	IPCA		21-jul-23	5,47%	5,39%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	19.681	0,01%	IPCA		21-jul-23	5,46%	5,39%	URCA FI MULT CRED PRIV

