

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 31/08/2023

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	1.219.661.350,74	73,67%				-0,01%	3,14%	10,33%	11,48%	13,97%	21,16%	24,33%	
Benchmark:	CDI					1,14%	3,32%	6,68%	8,87%	13,55%	25,14%	28,52%	
Renda Fixa CDI	582.079.281,63	35,16%			0,04%								
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	388.495.718,86	23,47%	ALFA	40,96%	0,01%	1,22%	3,56%	6,99%	9,15%	14,09%	27,00%	30,53%	
BRANCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	10.321.135,16	0,62%	BRANCO	41,93%	0,00%	1,14%	3,29%	6,60%	8,77%	13,39%	24,73%	28,00%	
URCA FI MULT CRED PRIV	183.262.427,61	11,07%	SANTANDER	39,71%	0,12%	1,16%	3,59%	7,38%	9,40%	14,30%	26,41%	29,67%	
Benchmark:	CDI					1,14%	3,32%	6,68%	8,87%	13,55%	25,14%	28,52%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	637.582.069,11	38,51%											
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	637.582.069,11	38,51%		100%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					1,14%	3,32%	6,68%	8,87%	13,55%	25,14%	28,52%	
Renda Variável	220.115.395,91	13,30%				-4,66%	7,96%	11,60%	7,58%	4,50%	-2,82%	15,29%	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					-4,83%	7,40%	10,47%	6,01%	6,23%	-0,51%	22,66%	
Renda Variável Ativa	220.115.395,91	13,30%			1,20%								
GRUMARI FIA	17.248.739,07	1,04%	AZ QUEST	25,62%	9,49%	-6,21%	6,51%	9,93%	7,25%	1,22%	-12,52%	-0,69%	
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	40.876.581,17	2,47%	CONSTANCIA	25,62%	6,75%	-4,77%	5,21%	12,11%	9,74%	2,79%	2,67%	21,07%	
ELETROS ITAUNA FIA	32.626.211,36	1,97%	ELETROBRÁS	25,62%	7,44%	-5,37%	-	-	-	-	-	-	
FIA SÃO CONRADO	7.315.203,64	0,44%	EQUITAS	25,62%	8,81%	-3,80%	6,44%	13,06%	23,58%	6,19%	-26,65%	-13,94%	
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	89.260.363,75	5,39%	SHARP	25,66%	6,83%	-4,21%	10,11%	11,42%	6,85%	7,53%	5,82%	29,06%	
VINCI JOATINGA FIA	14.435.616,64	0,87%	VINCI	25,62%	8,65%	-4,52%	9,41%	14,49%	10,84%	5,00%	-5,86%	10,66%	
FIA PIPA	18.352.680,29	1,11%	XP	25,62%	5,88%	-4,31%	4,82%	11,59%	8,95%	2,63%	9,19%	12,19%	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					-4,83%	7,40%	10,47%	6,01%	6,23%	-0,51%	22,66%	
Estruturado	90.889.084,37	5,49%				-0,30%	3,78%	2,64%	3,63%	6,93%	19,72%	24,75%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,32%	3,85%	7,76%	10,31%	15,81%	30,18%	36,36%	
Multimercados Estruturados	90.889.084,37	5,49%			1,84%								
NAVI LS ESTRUT FIC FI MULT	29.785.095,88	1,80%	NAVI CAPITAL	5,90%	2,20%	0,55%	4,58%	3,48%	4,31%	7,96%	23,77%	31,35%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	5.358.168,91	0,32%	OCCAM	0,62%	2,77%	-1,01%	1,89%	-2,79%	-1,81%	1,59%	10,38%	12,60%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	21.211.898,85	1,28%	OCCAM	2,23%	2,76%	-1,01%	1,89%	-2,79%	-1,81%	1,59%	10,40%	12,58%	
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	18.328.889,75	1,11%	QUANTITAS	7,87%		1,48%	5,66%	9,07%	10,81%	17,76%	37,32%	47,05%	
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	16.205.030,98	0,98%	ZEITGEIST	1,27%	2,16%	-2,58%	3,42%	3,68%	4,18%	4,00%	18,90%	23,25%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,32%	3,85%	7,76%	10,31%	15,81%	30,18%	36,36%	
Exterior	57.182.363,70	3,45%				3,26%	6,17%	8,00%	10,07%	9,73%	-2,57%	18,89%	
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					1,15%	2,98%	3,96%	8,22%	8,01%	-9,04%	9,39%	
Exterior - RV	57.182.363,70	3,45%			5,20%								
ISHARES S&P 500 FIC FUNDO DE ÍNDICE - IE	57.182.363,70	3,45%	BLACKROCK	2,04%	6,76%	3,26%	6,17%	8,00%	10,07%	9,58%	-2,50%	19,55%	
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					1,15%	2,98%	3,96%	8,22%	8,01%	-9,04%	9,39%	
Operações com Participantes	22.681.618,34	1,37%				0,11%	2,52%	4,83%	6,59%	6,02%	25,51%	47,02%	
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.					1,21%	2,88%	7,37%	10,60%	16,08%	40,98%	73,65%	
Imobiliário	45.088.297,34	2,72%				0,43%	1,31%	2,68%	3,19%	4,93%	13,00%	38,48%	
Benchmark:	INPC					0,20%	0,01%	1,55%	2,80%	4,06%	13,24%	25,04%	
Total	1.655.606.376,52	100%				1,86%	-0,54%	3,90%	9,82%	10,18%	11,56%	15,22%	23,96%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.					0,66%	1,33%	4,20%	6,33%	9,45%	25,30%	45,52%	

* 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.

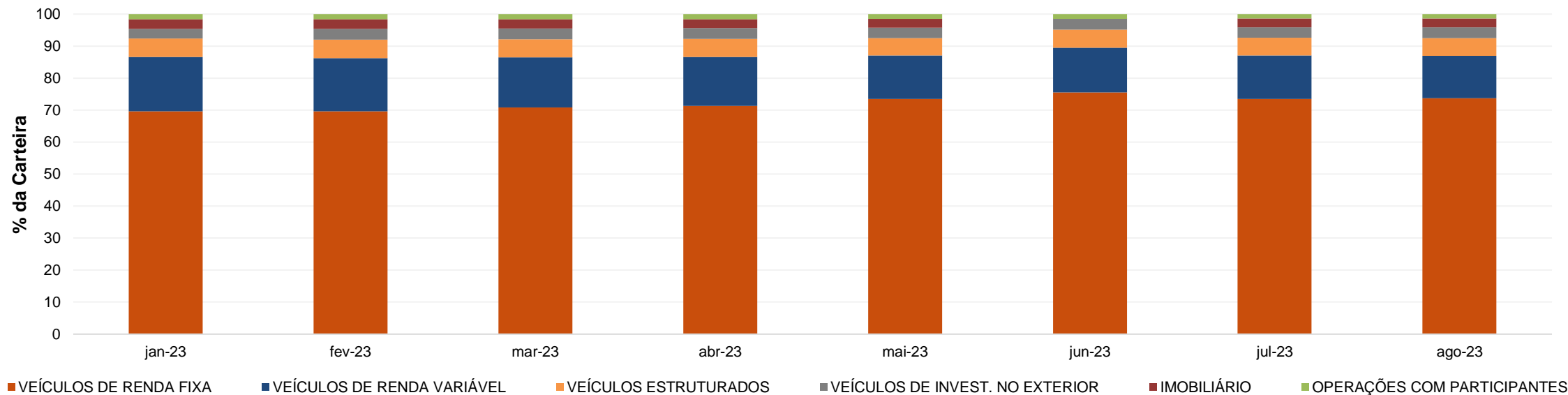
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

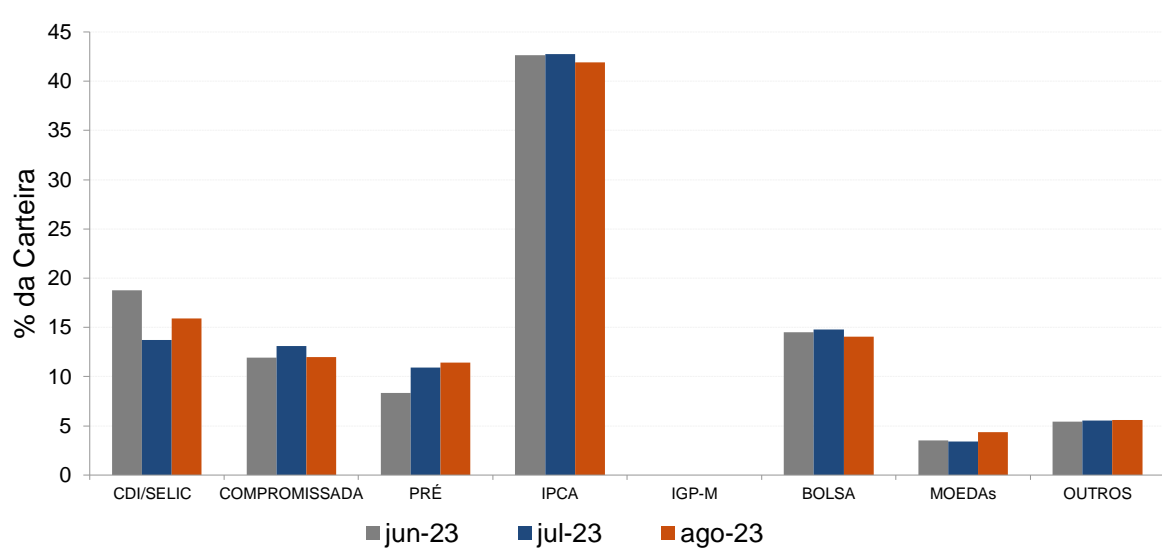
Distribuição da Carteira

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.

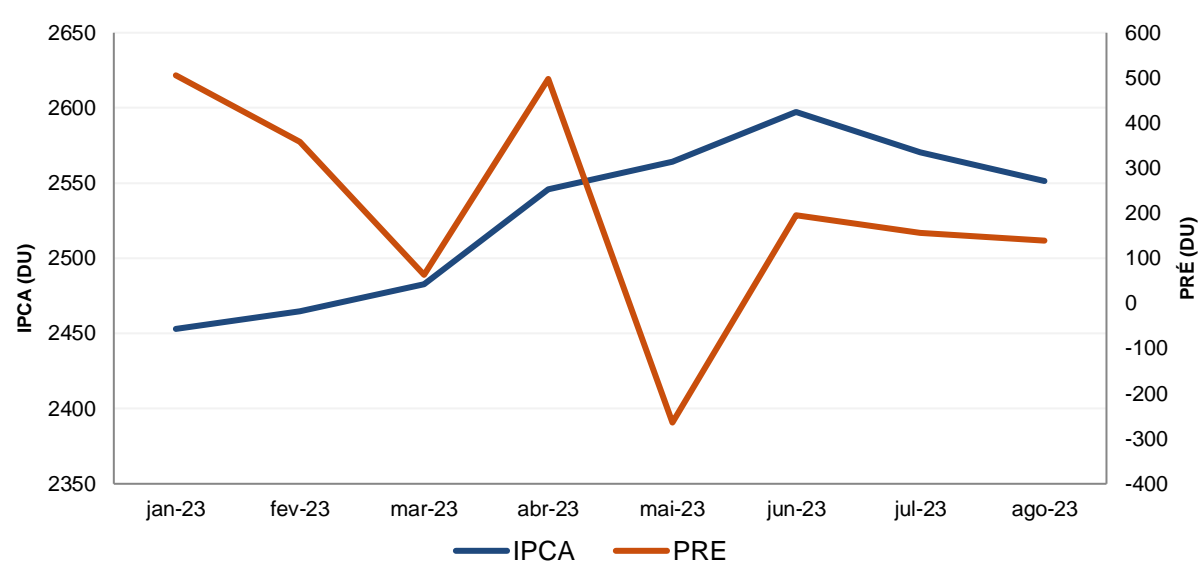
Evolução do Patrimônio Líquido



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	19.987,27	8,74	17.847,37	7,49
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	18.232,33	7,97	15.143,73	6,36
EQTL3	Energia Elétrica	11.326,89	4,95	12.279,48	5,15
ITUB4	Intermediários Financeiros	9.118,37	3,99	9.436,49	3,96
ITSA4	Intermediários Financeiros	8.898,51	3,89	9.482,60	3,98
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	8.756,13	3,83	8.719,74	3,66
ELET3	Energia Elétrica	8.628,60	3,77	9.917,27	4,16
RENT3	Diversos	7.341,99	3,21	7.876,58	3,31
BPAC11	Intermediários Financeiros	6.742,74	2,95	7.600,34	3,19
RAIL3	Transporte	6.602,81	2,89	5.659,22	2,38

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

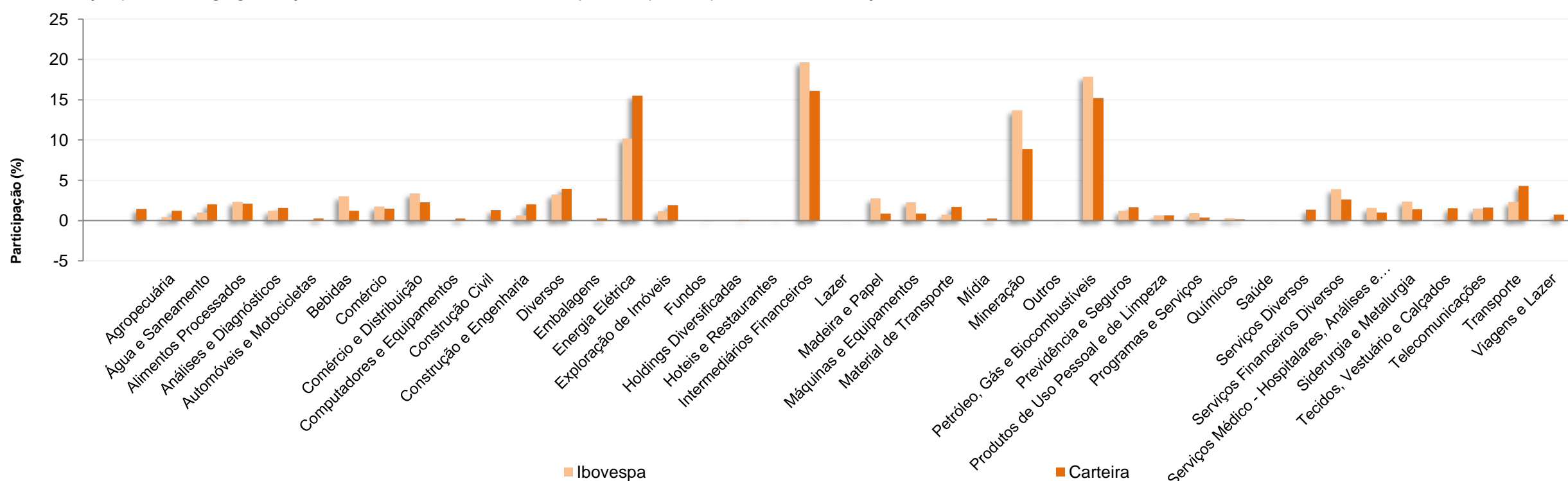
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	64,90	0,03	0,07	23
MTSA4	248,29	0,11	0,22	10
SCAR3	83,87	0,04	0,03	4
AGXY3	153,97	0,07	0,04	3
ALLD3	152,91	0,07	0,15	3
EALT4	64,86	0,03	0,11	3
MATD3	943,42	0,41	0,16	2
LAND3	339,95	0,15	0,06	2
BEES3	30,20	0,01	0,02	2
EQPA3	4,49	0,00	0,00	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.



ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 31/08/2023

Análises de Contrapartes

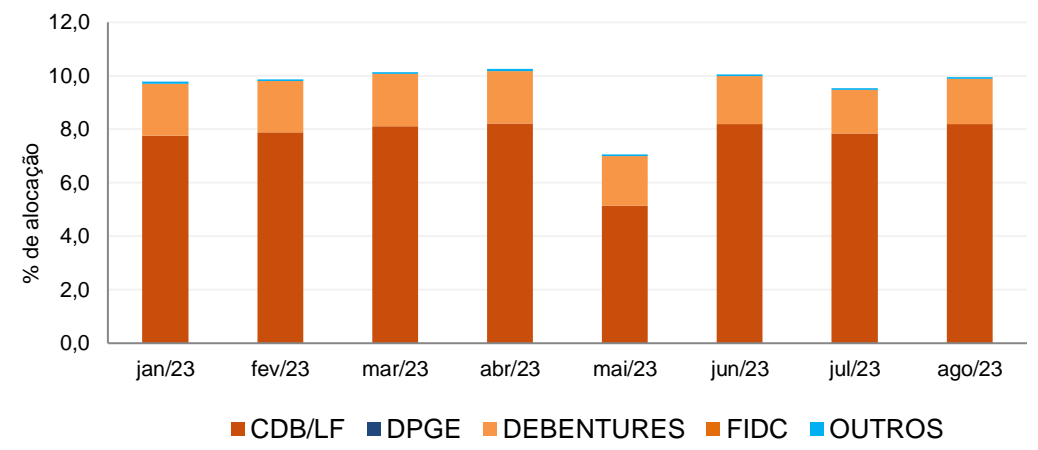
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	62.604,44	3,99	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	38.648,50	2,46	Faixa 2
VALE SA	19.987,27	1,27	Faixa 1
BCO SAFRA SA	18.858,54	1,20	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	18.419,20	1,17	Faixa 1
EQUATORIAL ENERGIA SA	11.326,89	0,72	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	10.889,41	0,69	Faixa 2
BCO ITAU SA	10.161,18	0,65	Faixa 1
ITAUSA SA	9.639,32	0,61	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	9.121,02	0,58	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: 31/08/2023

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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	6.393.410	0,41%	Selic	22-ago-23	6,00%	0,05%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LFT 2026-03-01	01-mar-26	10.903.338	0,69%	Selic	01-ago-23	0,08%	0,00%	URCA FI MULT CRED PRIV
LFT 2027-03-01	01-mar-27	28.030.261	1,79%	Selic	23-ago-23	0,12%	0,13%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	4.291.920	0,27%	IPCA	08-ago-23	5,54%	5,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	329.243	0,02%	IPCA	28-ago-23	5,60%	5,56%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	196.610	0,01%	IPCA	28-ago-23	5,07%	5,05%	URCA FI MULT CRED PRIV

