

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

Data-base: 31/01/2022

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	ALOCÇÃO (R\$)		GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
						1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	475.544.987,48	63,64%				-0,43%	1,87%	-0,01%	-0,43%	0,37%	5,92%	13,91%
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	301.790.824,64	40,39%										
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RF	301.790.824,64	40,39%		100%	3,23%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
RF REFERENCIADO DI	173.754.162,83	23,25%										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	109.886.330,06	14,71%	ALFA	16,20%	0,03%	0,80%	2,37%	3,82%	0,80%	5,40%	7,98%	14,19%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	3.445.840,06	0,46%	BRADESCO	16,96%	0,01%	0,72%	2,04%	3,39%	0,72%	4,88%	7,45%	13,60%
URCA FI MULT CRED PRIV	60.421.992,71	8,09%	SANTANDER	15,96%	0,04%	0,94%	2,49%	3,48%	0,94%	4,90%	7,56%	14,04%
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
Renda Variável	199.690.708,11	26,72%				6,19%	7,35%	-9,88%	6,19%	-2,73%	-4,35%	19,29%
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.					7,04%	8,90%	-8,23%	7,04%	-0,15%	3,49%	25,59%
RV ATIVO	96.817.846,73	12,96%										
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	61.949.978,76	8,29%	SHARP	14,90%	7,12%	7,56%	8,15%	-8,06%	7,56%	-2,06%	3,81%	27,87%
FIA SAO CONRADO	4.540.174,25	0,61%	EQUITAS	14,90%	10,79%	8,69%	1,84%	-23,51%	8,69%	-18,02%	-27,70%	-9,64%
FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS	23.442.438,86	3,14%	CONSTANCIA	14,90%	5,85%	3,70%	6,68%	-7,88%	3,70%	3,35%	-9,01%	-
FIA PIPA	3.717.640,67	0,50%	XP	14,90%	5,84%	5,86%	8,42%	-12,77%	5,86%	-4,00%	-	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	3.167.614,19	0,42%	CONSTELLATION	14,90%	7,94%	0,54%	-7,78%	-26,66%	0,54%	-25,93%	-	-
Benchmark:	IBOVESPA					6,98%	8,35%	-7,93%	6,98%	-2,54%	-1,42%	15,14%
CARTEIRA PRÓPRIA RV	54.351.611,81	7,27%										
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RV	54.351.611,81	7,27%		100%	7,13%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX					6,87%	8,36%	-9,14%	6,87%	-2,11%	-0,51%	18,37%
RV VALOR	26.245.872,45	3,51%										
VINCI JOATINGA FIA	21.956.867,03	2,94%	VINCI	14,90%	7,70%	7,36%	11,59%	-6,89%	7,36%	-2,58%	-4,04%	-
FIA ITACOATIARA	4.289.005,42	0,57%	INDIE CAPITAL	14,90%	9,94%	4,03%	1,66%	-24,18%	4,03%	-19,29%	-	-
Benchmark:	IBOVESPA					6,98%	8,35%	-7,93%	6,98%	-2,54%	-1,42%	15,14%
RV SMALL CAP	22.275.377,12	2,98%										
GRUMARI FIA	22.275.377,12	2,98%	AZ QUEST	14,90%	8,62%	2,66%	0,49%	-14,13%	2,66%	-4,98%	-13,44%	26,66%
Benchmark:	SMLL					3,42%	4,89%	-17,43%	3,42%	-10,25%	-14,29%	24,49%
Estruturado	43.229.109,77	5,78%										
Benchmark:	INPC + 10% a.a.					1,47%	4,76%	10,80%	1,47%	21,66%	41,07%	61,92%
MM MACRO	28.572.935,79	3,82%										
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	8.291.091,27	1,11%	QUANTITAS	3,50%		3,90%	5,28%	4,46%	3,90%	6,85%	16,37%	24,78%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT	2.931.114,78	0,39%	OCCAM	0,17%	1,19%	0,70%	-0,17%	2,16%	0,70%	4,22%	11,77%	26,34%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT	11.602.467,37	1,55%	OCCAM	0,53%	1,19%	0,70%	-0,18%	2,16%	0,70%	4,19%	11,72%	-
PACIFICO MACRO FC FI MULT	2.749.276,99	0,37%	PACIFICO	1,21%	1,86%	0,15%	1,92%	-0,65%	0,15%	-0,32%	0,72%	8,71%
GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT	2.998.985,37	0,40%	ZEITGEIST	0,15%	6,80%	0,36%	-0,05%	6,07%	0,36%	11,49%	15,76%	27,79%
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
MM LONG-SHORT	14.656.173,98	1,96%										
NAVILS ESTRUT FC DE FI MULT	14.656.173,98	1,96%	KONDOR	3,27%	1,62%	1,04%	4,00%	4,09%	1,04%	8,24%	10,81%	-
Benchmark:	CDI					0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%
Exterior	15.700.472,25	2,10%										
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					-9,13%	-8,52%	4,26%	-9,13%	12,44%	63,87%	121,23%
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	15.700.472,25	2,10%										
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	15.700.472,25	2,10%	BLACKROCK	0,00%	6,69%	-11,30%	-7,99%	4,01%	-11,30%	18,36%	76,41%	148,53%
Benchmark:	MSCIWBRLL					-9,13%	-8,52%	4,26%	-9,13%	12,44%	63,87%	121,23%
Operações com Participantes	13.097.456,36	1,75%										
Benchmark:	INPC + 8,68% a.a.					1,37%	4,44%	10,13%	1,37%	20,20%	37,72%	56,17%
Total	747.262.733,97	100%				2,68%	1,14%	3,03%	-2,33%	1,14%	0,67%	5,01%
Benchmark:	INPC + 4,8% a.a.					1,06%	3,48%	8,13%	1,06%	15,91%	28,12%	40,08%

* - 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.

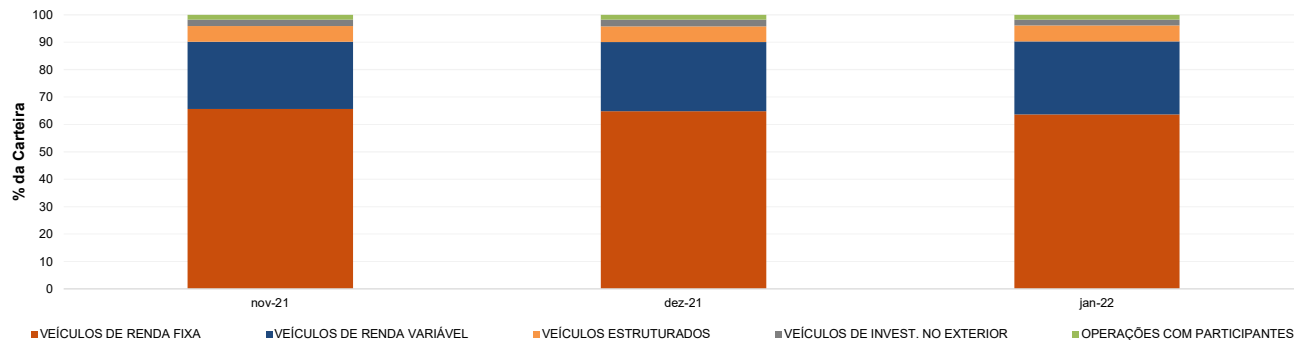
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

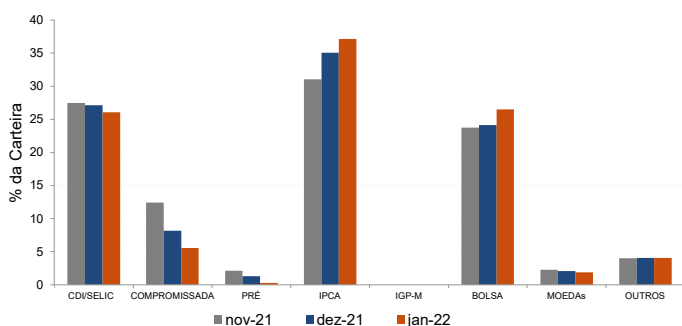
Distribuição da Carteira

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.

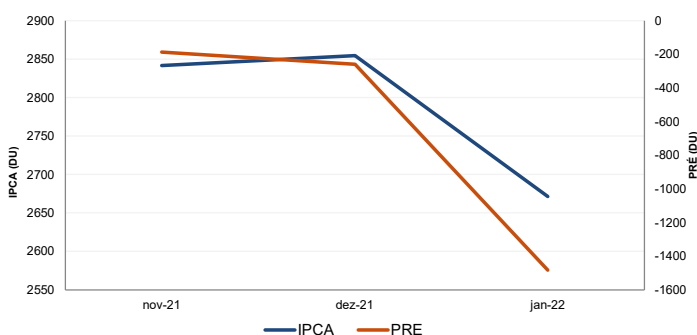
Evolução do Patrimônio Líquido



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	Sector	Atual*	%	Anterior*	%
VALE3	Mineração	21.565,55	10,74	19.980,24	10,80
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	18.257,60	9,09	16.520,02	8,93
ITSA4	Intermediários Financeiros	7.149,10	3,56	6.148,47	3,32
ITUB4	Intermediários Financeiros	7.039,18	3,51	5.311,77	2,87
BPAC11	Intermediários Financeiros	6.905,31	3,44	5.390,69	2,91
EQTL3	Energia Elétrica	6.528,49	3,25	6.484,15	3,50
GNDI3	Análises e Diagnósticos	6.281,89	3,13	5.577,10	3,01
VBBR3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	5.408,92	2,69	4.923,02	2,66
BBDC4	Intermediários Financeiros	5.075,38	2,53	4.832,36	2,61
RENT3	Diversos	4.808,97	2,39	3.308,94	1,79

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

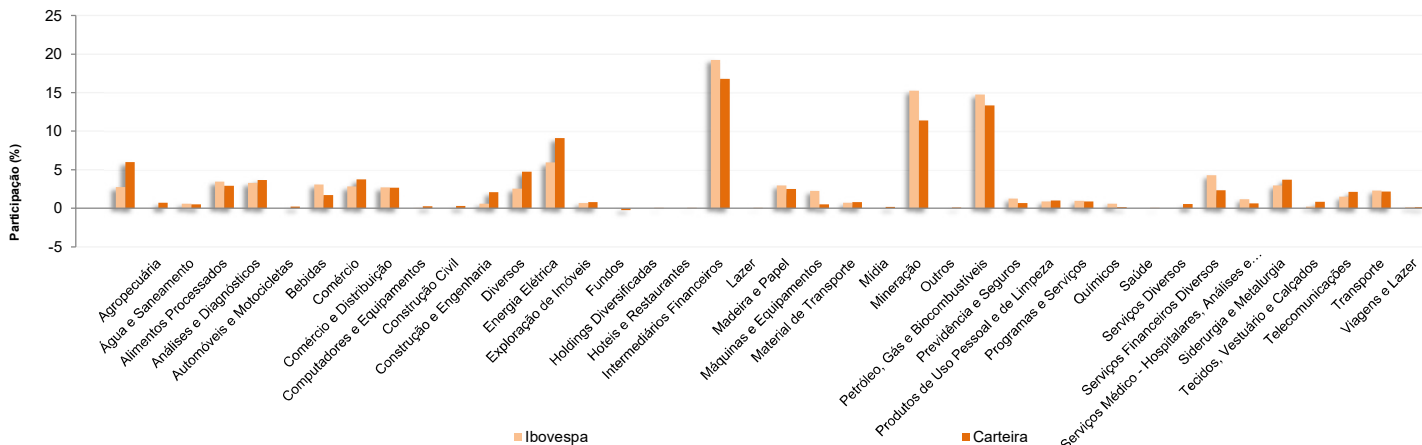
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	35,62	0,02	0,03	22
MTSA4	133,45	0,07	0,11	6
COCE5	232,07	0,12	0,02	3
SCAR3	103,93	0,05	0,01	3
ELMD3	365,07	0,18	0,05	2
LAND3	244,68	0,12	0,04	2
HBRE3	240,77	0,12	0,12	2
OFSA3	40,24	0,02	0,01	2
VALE3	21.565,55	10,74	0,01	1
PETR4	18.257,60	9,09	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.



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.

Análises de Contrapartes

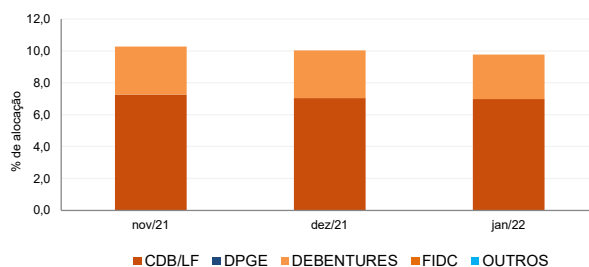
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	35.861,89	4,87	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	21.928,20	2,98	Faixa 2
VALE SA	21.565,55	2,93	Faixa 1
BCO SAFRA SA	8.980,05	1,22	Faixa 1
ITAUSA INVESTS ITAU SA	8.268,55	1,12	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	7.039,18	0,96	Faixa 1
BCO BTG PACTUAL SA	6.905,31	0,94	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	6.528,49	0,89	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	6.502,10	0,88	Faixa 2
NOTRE DAME INTERMEDICA PARTICIPACOES SA	6.281,89	0,85	Sem Faixa

* 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 CV ONS

Data-base: 31/01/2022

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	01-fev-24	926.629	0,13%	CDI	BCO ITAU SA	26-jan-22	0,65%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI	01-abr-24	927.669	0,13%	CDI	BCO ITAU SA	21-jan-22	0,66%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	11.252.336	1,53%	IPCA		18-jan-22	5,46%	5,47%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	7.314.019	0,99%	IPCA		06-jan-22	5,35%	5,39%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	1.575.327	0,21%	IPCA		06-jan-22	5,35%	5,39%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	1.378.897	0,19%	IPCA		05-jan-22	5,53%	5,56%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	1.172.063	0,16%	IPCA		06-jan-22	5,56%	5,61%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	132.144	0,02%	IPCA		05-jan-22	5,53%	5,56%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA F

