

ELETROS - ELETROS PLANO CD ELETROBRAS

Data-base: 31/01/2023

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	1.282.921.567,88	69,31%			-0,07%	-1,12%	4,94%	-0,07%	9,57%	11,81%	22,75%	
Benchmark:	CDI				1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
Renda Fixa CDI	572.501.346,02	30,93%		0,06%								
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	372.622.590,56	20,13%	ALFA	45,55%	0,01%	1,14%	3,42%	7,01%	1,14%	13,86%	20,01%	22,95%
BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	10.718.128,49	0,58%	BRDESCO	46,84%	0,00%	1,11%	3,27%	6,63%	1,11%	12,62%	18,11%	21,01%
URCA FI MULT CRED PRIV	189.160.626,97	10,22%	SANTANDER	44,45%	0,17%	1,09%	3,22%	7,02%	1,09%	13,35%	18,90%	21,91%
Benchmark:	CDI				1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	710.420.221,86	38,38%										
ELETROS PLANO CD ELETROBRAS CARTEIRA PROF	710.420.221,86	38,38%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
Renda Variável	314.621.245,96	17,00%			3,85%	-4,93%	7,78%	3,85%	0,73%	-2,00%	-3,64%	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				3,69%	-1,85%	10,50%	3,69%	2,77%	2,61%	6,35%	
Renda Variável Ativa	262.895.121,54	14,20%		1,20%								
GRUMARI FIA	24.628.231,01	1,33%	AZ QUEST	30,76%	5,62%	2,68%	-9,19%	2,74%	2,68%	-7,40%	-12,02%	-19,85%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	46.550.973,82	2,52%	CONSTANCIA	30,76%	7,31%	4,08%	-6,46%	4,39%	4,08%	2,71%	6,14%	-6,54%
CONSTELLATION RESERVA FIA	5.827.899,51	0,31%	CONSTELLATION	30,76%	9,84%	3,98%	-11,22%	1,32%	3,98%	-10,89%	-34,00%	-
FIA SÃO CONRADO	7.788.904,29	0,42%	EQUITAS	30,76%	13,61%	9,59%	-11,64%	4,21%	9,59%	-16,90%	-31,87%	-39,92%
FIA ITACOATIARA	7.321.865,96	0,40%	INDIE CAPITAL	30,76%	11,18%	3,57%	-9,54%	7,22%	3,57%	-17,30%	-33,26%	-
SHARP ARPOADOR IBrX ATIVO FIA	140.311.913,65	7,58%	SHARP	30,76%	7,43%	4,16%	-1,07%	12,22%	4,16%	9,72%	7,46%	13,90%
VINCI JOATINGA FIA	22.067.568,77	1,19%	VINCI	30,76%	8,40%	3,24%	-10,44%	3,61%	3,24%	-7,73%	-10,11%	-11,46%
FIA PIPA	8.397.764,52	0,45%	XP	30,76%	8,04%	3,49%	-8,44%	4,28%	3,49%	9,43%	5,05%	-
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				3,69%	-1,85%	10,50%	3,69%	2,77%	2,61%	6,35%	
CARTEIRA PRÓPRIA RV	51.726.124,42	2,79%										
ELETROS PLANO CD ELETROBRAS CARTEIRA PROF	51.726.124,42	2,79%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX				3,51%	-2,34%	9,39%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	
Estruturado	99.320.901,28	5,37%										
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,30%	3,82%	7,79%	1,30%	15,07%	23,24%	28,86%	
Multimercados Estruturados	99.320.901,28	5,37%		1,23%								
NAVI LS ESTRUTURADO FIC FI MULT	32.205.501,86	1,74%	NAVI CAPITAL	6,02%	1,73%	-0,13%	0,72%	7,41%	-0,13%	15,91%	25,46%	28,45%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	24.423.180,16	1,32%	OCCAM	1,57%	2,64%	0,11%	-0,09%	4,74%	0,11%	11,04%	15,69%	24,06%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	6.169.609,76	0,33%	OCCAM	0,45%	2,64%	0,11%	-0,08%	4,74%	0,11%	11,03%	15,72%	24,10%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	18.828.253,81	1,02%	QUANTITAS	8,21%	8,21%	0,79%	4,05%	10,22%	0,79%	19,79%	27,99%	39,40%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	17.694.355,70	0,96%	ZEITGEIST	1,02%	1,61%	0,73%	-0,69%	2,15%	0,73%	9,49%	22,08%	26,75%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,30%	3,82%	7,79%	1,30%	15,07%	23,24%	28,86%	
Exterior	63.819.569,73	3,45%										
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				4,58%	6,03%	-0,33%	4,58%	-13,34%	-2,56%	42,00%	
Exterior - RV	63.819.569,73	3,45%		4,09%								
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	63.819.569,73	3,15%	BLACKROCK	1,99%	7,31%	1,42%	3,61%	-2,69%	1,42%	-12,37%	3,73%	54,60%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				4,58%	6,03%	-0,33%	4,58%	-13,34%	-2,56%	42,00%	
Operações com Participantes	32.992.170,74	1,78%			1,07%	2,11%	4,35%	1,07%	14,48%	36,44%	54,44%	
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.				1,43%	4,41%	7,18%	1,43%	17,97%	45,61%	71,27%	
Imobiliário	62.317.446,71	3,37%										
Benchmark:	INPC				0,46%	1,54%	1,37%	0,46%	5,71%	16,92%	23,38%	
Total	1.850.922.971,08	100%			2,34%	0,84%	-1,60%	5,29%	0,84%	7,06%	8,45%	17,40%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				0,91%	2,85%	4,02%	0,91%	11,21%	29,39%	43,56%	

* 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.

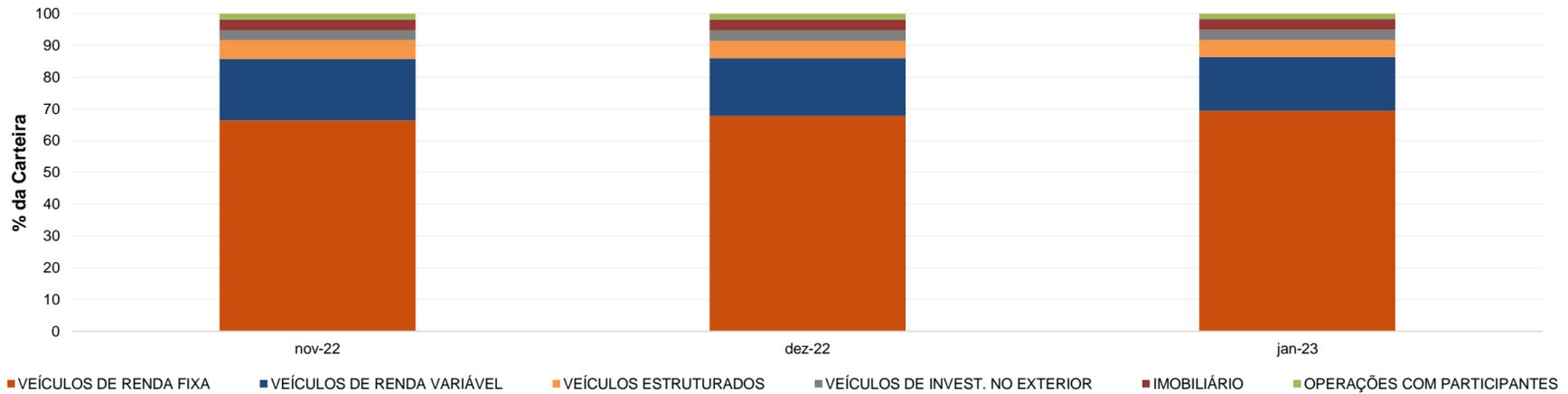
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

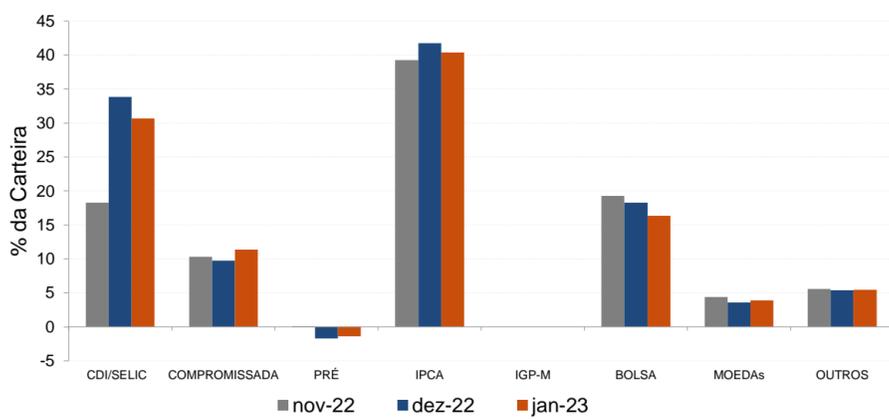
Distribuição da Carteira

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.

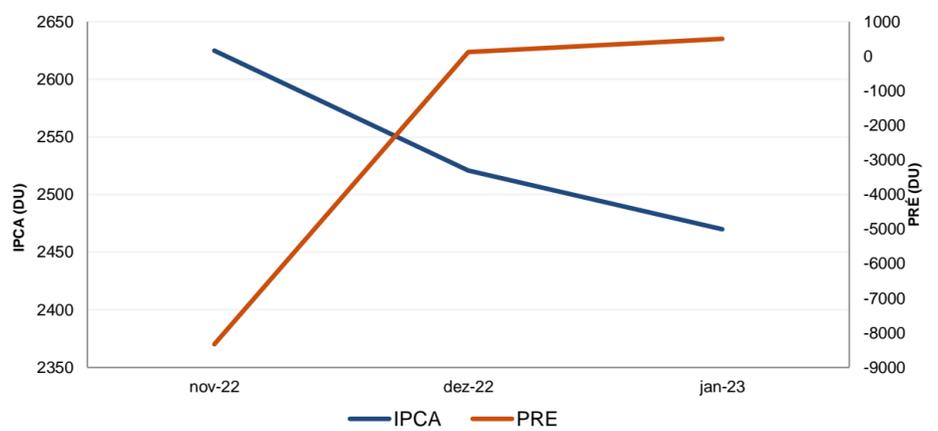
Evolução do Patrimônio Líquido



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	44.581,55	14,53	42.050,28	13,42
PETRA4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	18.807,56	6,13	18.403,32	5,87
ITSA4	Intermediários Financeiros	14.657,82	4,78	15.904,97	5,07
EQTL3	Energia Elétrica	14.478,70	4,72	14.380,25	4,59
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	13.471,21	4,39	12.473,63	3,98
ELET3	Energia Elétrica	12.004,78	3,91	13.606,32	4,34
ITUB4	Intermediários Financeiros	10.555,69	3,44	12.886,22	4,11
RENT3	Diversos	10.028,86	3,27	9.568,82	3,05
ASAI3	Comércio e Distribuição	8.267,94	2,70	7.868,79	2,51
BPAC11	Intermediários Financeiros	7.997,57	2,61	9.882,27	3,15

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

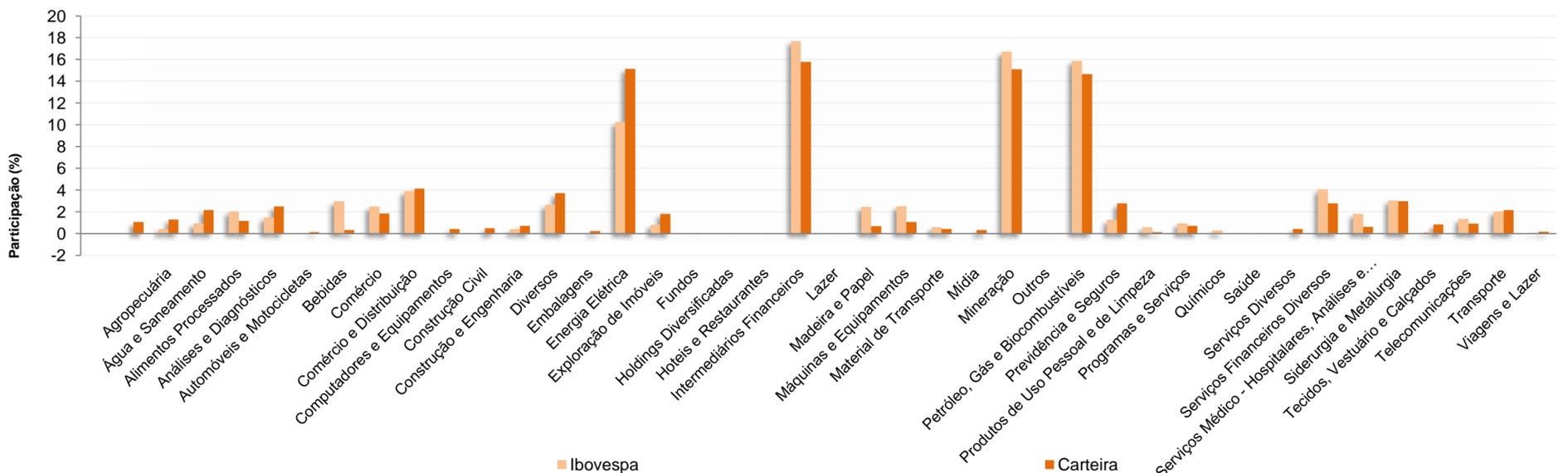
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
GETT11	0,17	0,00	0,00	Sem Liquidez
MTSA4	293,75	0,10	0,27	24
CRIV4	65,94	0,02	0,08	10
ALLD3	145,05	0,05	0,16	4
LAND3	676,87	0,22	0,09	3
HBRE3	305,01	0,10	0,27	3
SCAR3	76,31	0,02	0,04	3
ELMD3	1.026,77	0,33	0,19	2
MATD3	886,15	0,29	0,17	2
AGXY3	153,96	0,05	0,02	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 ELETROBRAS

Data-base: 31/01/2023

Análises de Contrapartes

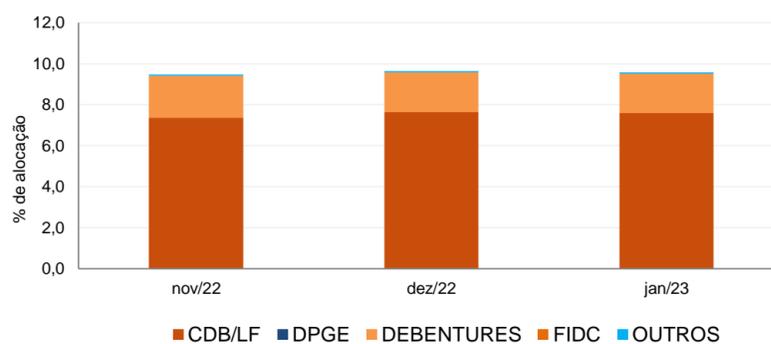
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	79.781,79	4,57	Faixa 1
VALE SA	44.581,55	2,56	Faixa 1
BCO SAFRA SA	20.994,27	1,20	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	20.003,66	1,15	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	18.973,83	1,09	Faixa 2
ITAUSA SA	15.511,54	0,89	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	14.740,26	0,85	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	14.478,70	0,83	Faixa 1
PETRO RIO SA	13.471,21	0,77	Faixa 2
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	11.383,80	0,65	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: 31/01/2023

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
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	101.234	0,01%	IPCA	26-jan-23	6,18%	6,21%	ELETROS PLANO CD ELETROBRAS CAF
NTN-B 2060-08-15	15-ago-60	7.772	0,00%	IPCA	30-jan-23	6,45%	0,00%	ELETROS PLANO CD ELETROBRAS CAF

