

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

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	1.079.900.303,92	69,57%				-0,04%	-0,57%	4,18%	-0,04%	8,02%	9,00%	15,32%	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
Renda Fixa CDI	492.890.868,48	31,75%			0,06%								
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	320.806.708,24	20,67%	ALFA	39,21%	0,01%	1,14%	3,42%	7,01%	1,14%	13,86%	20,01%	22,95%	
BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	9.227.694,74	0,59%	BRDESCO	40,32%	0,00%	1,11%	3,27%	6,63%	1,11%	12,62%	18,11%	21,01%	
URCA FI MULT CRED PRIV	162.856.465,50	10,49%	SANTANDER	38,27%	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	587.009.435,44	37,82%											
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	587.009.435,44	37,82%		100%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
Renda Variável	264.654.620,38	17,05%				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	221.252.638,39	14,25%			1,20%								
GRUMARI FIA	20.727.128,97	1,34%	AZ QUEST	25,89%	5,62%	2,68%	-9,19%	2,74%	2,68%	-7,40%	-12,02%	-19,85%	
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	39.177.318,00	2,52%	CONSTANCIA	25,89%	7,31%	4,08%	-6,46%	4,39%	4,08%	2,71%	6,14%	-6,54%	
CONSTELLATION RESERVA FIA	4.904.762,54	0,32%	CONSTELLATION	25,89%	9,84%	3,98%	-11,22%	1,32%	3,98%	-10,89%	-34,00%	-	
FIA SÃO CONRADO	6.555.144,93	0,42%	EQUITAS	25,89%	13,61%	9,59%	-11,64%	4,21%	9,59%	-16,90%	-31,87%	-39,92%	
FIA ITACOATIARA	6.162.085,29	0,40%	INDIE CAPITAL	25,89%	11,18%	3,57%	-9,54%	7,22%	3,57%	-17,30%	-33,26%	-	
SHARP ARPOADOR IBrX ATIVO FIA	118.086.562,09	7,61%	SHARP	25,89%	7,43%	4,16%	-1,07%	12,22%	4,16%	9,72%	7,46%	13,90%	
VINCI JOATINGA FIA	18.572.074,62	1,20%	VINCI	25,89%	8,40%	3,24%	-10,44%	3,61%	3,24%	-7,73%	-10,11%	-11,46%	
FIA PIPA	7.067.561,95	0,46%	XP	25,89%	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	43.401.981,99	2,80%											
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RV	43.401.981,99	2,80%		100%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX					3,51%	-2,34%	9,39%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	
Estruturado	88.312.450,78	5,69%				0,27%	0,65%	5,94%	0,27%	13,10%	19,66%	20,29%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.					1,30%	3,82%	7,79%	1,30%	15,07%	23,24%	28,86%	
Multimercados Estruturados	88.312.450,78	5,69%			1,23%								
NAVI LS ESTRUTURADO FIC FI MULT	28.635.934,24	1,84%	NAVI CAPITAL	5,35%	1,73%	-0,13%	0,72%	7,41%	-0,13%	15,91%	25,46%	28,45%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	5.485.787,49	0,35%	OCCAM	0,40%	2,64%	0,11%	-0,08%	4,74%	0,11%	11,03%	15,72%	24,10%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	21.716.183,28	1,40%	OCCAM	1,40%	2,64%	0,11%	-0,09%	4,74%	0,11%	11,04%	15,69%	24,06%	
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	16.741.382,89	1,08%	QUANTITAS	7,30%		0,79%	4,05%	10,22%	0,79%	19,79%	27,99%	39,40%	
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	15.733.162,87	1,01%	ZEITGEIST	0,91%	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	52.183.681,82	3,36%				1,42%	3,75%	-2,55%	1,42%	-12,43%	3,44%	19,88%	
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)					4,58%	6,03%	-0,33%	4,58%	-13,34%	-2,56%	42,00%	
Exterior - RV	52.183.681,82	3,36%			4,09%								
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	52.183.681,82	3,07%	BLACKROCK	1,63%	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	25.839.388,44	1,66%				0,24%	0,07%	0,23%	0,24%	9,29%	29,22%	45,33%	
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.					1,43%	4,41%	7,18%	1,43%	17,97%	45,61%	71,27%	
Imobiliário	45.464.260,99	2,93%				0,74%	1,55%	3,33%	0,74%	6,03%	16,02%	41,65%	
Benchmark:	INPC					0,46%	1,54%	1,37%	0,46%	5,71%	16,92%	23,38%	
Total	1.552.218.614,84	100%				2,32%	0,75%	-1,20%	4,77%	0,75%	6,43%	7,36%	13,04%
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.

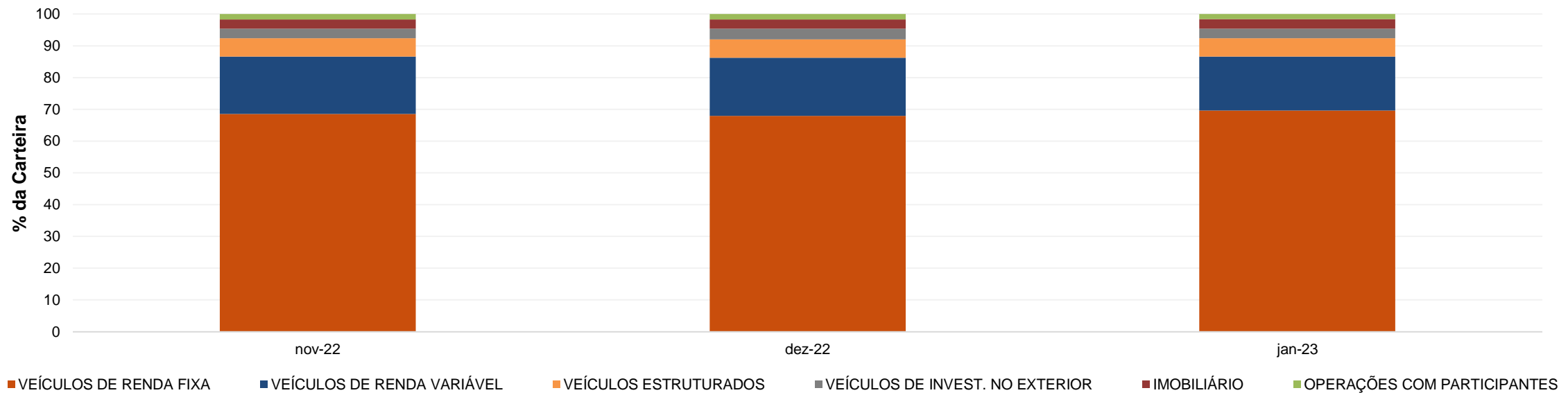
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

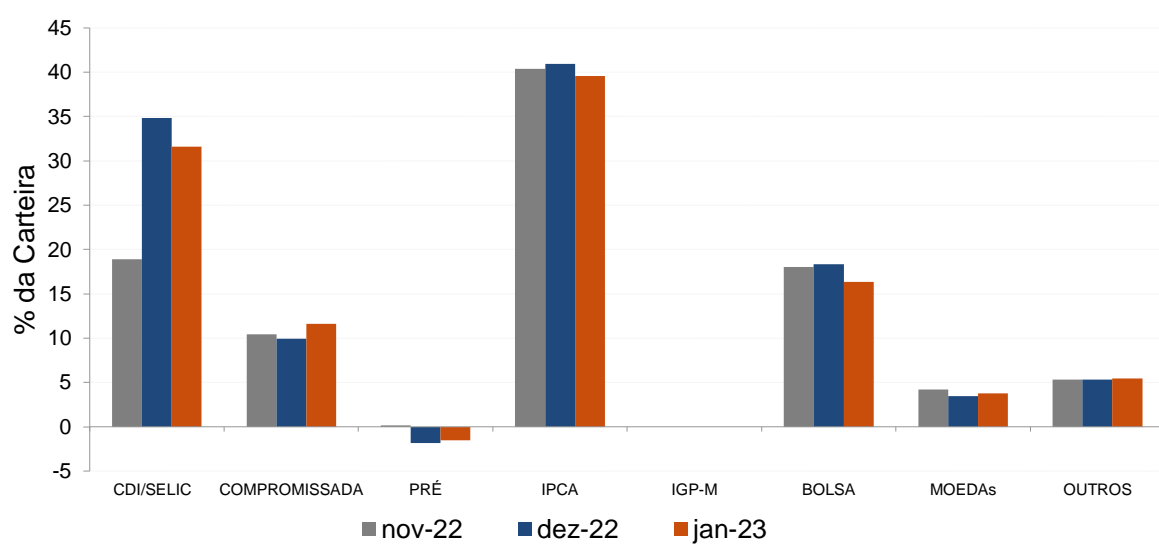
Distribuição da Carteira

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.

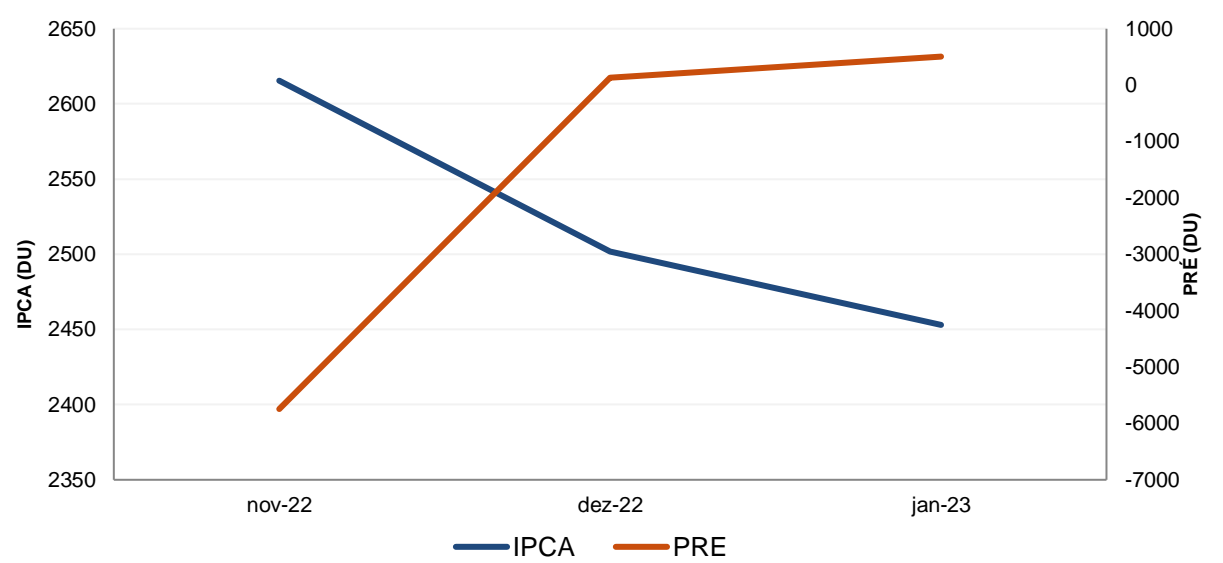
Evolução do Patrimônio Líquido



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	37.666,09	14,53	35.539,03	13,40
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	16.001,71	6,17	15.668,07	5,91
ITSA4	Intermediários Financeiros	12.403,27	4,79	13.501,86	5,09
EQTL3	Energia Elétrica	12.298,85	4,74	12.259,86	4,62
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	11.366,50	4,39	10.554,28	3,98
ELET3	Energia Elétrica	10.204,92	3,94	11.585,10	4,37
ITUB4	Intermediários Financeiros	8.970,97	3,46	10.970,51	4,14
RENT3	Diversos	8.450,35	3,26	8.087,25	3,05
ASAI3	Comércio e Distribuição	7.024,69	2,71	6.709,35	2,53
BPAC11	Intermediários Financeiros	6.760,93	2,61	8.376,00	3,16

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

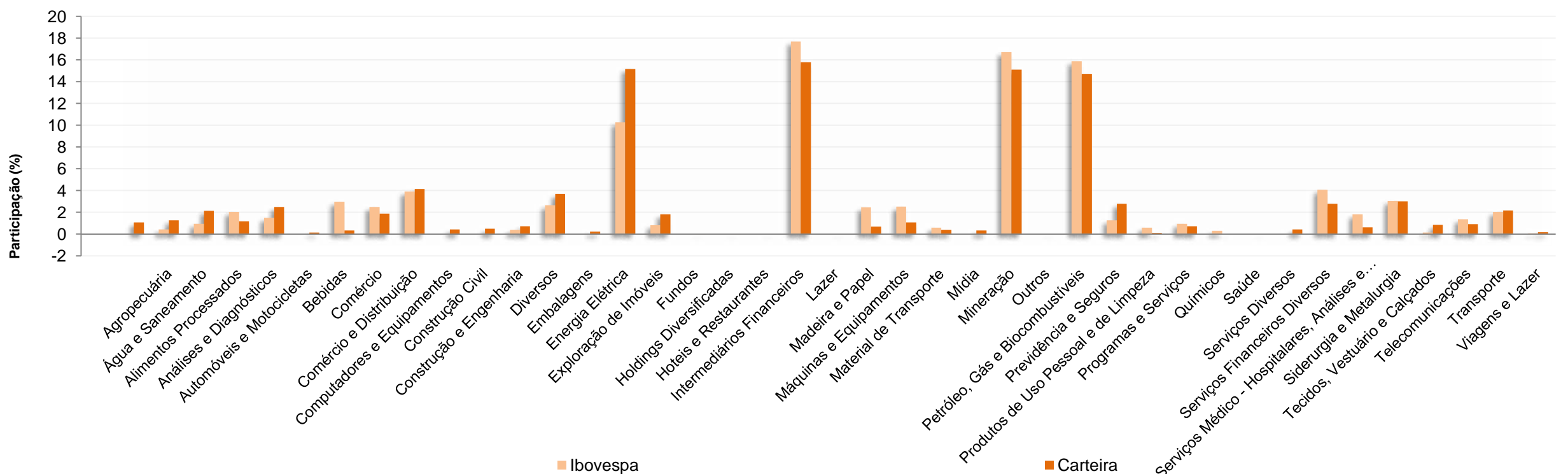
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
GETT11	0,16	0,00	0,00	Sem Liquidez
MTSA4	247,22	0,10	0,23	20
CRIV4	55,50	0,02	0,07	9
ALLD3	122,07	0,05	0,14	4
LAND3	569,65	0,22	0,08	3
HBRE3	256,70	0,10	0,23	3
SCAR3	64,22	0,02	0,03	3
AGXY3	129,58	0,05	0,02	2
EALT4	67,29	0,03	0,13	2
WEST3	64,83	0,03	0,13	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: 31/01/2023

Análises de Contrapartes

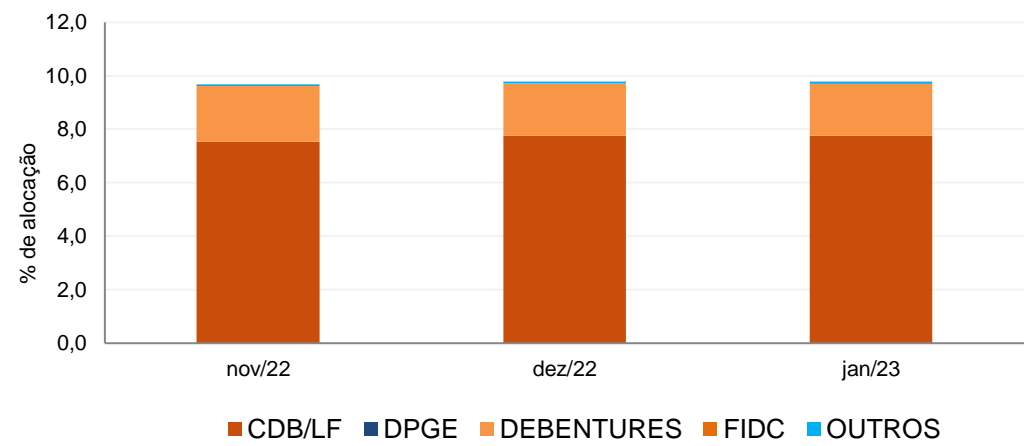
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	68.520,31	4,66	Faixa 1
VALE SA	37.666,09	2,56	Faixa 1
BCO SAFRA SA	18.074,86	1,23	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	17.222,01	1,17	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	16.140,82	1,10	Faixa 2
ITAUSA SA	13.138,27	0,89	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	12.577,54	0,85	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	12.298,85	0,84	Faixa 1
PETRO RIO SA	11.366,50	0,77	Faixa 2
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	9.707,27	0,66	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: 31/01/2023

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 PURO CARTEIRA F
NTN-B 2060-08-15	15-ago-60	7.772	0,00%	IPCA	30-jan-23	6,45%	0,00%	ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA F

