

ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

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	203.021.263,95	67,97%			-0,40%	-0,31%	4,58%	-0,40%	8,50%	7,58%	11,46%	
Benchmark:	CDI				1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
Renda Fixa CDI	79.610.477,53	26,65%		0,06%								
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	51.815.882,32	17,35%	ALFA	6,33%	0,01%	1,14%	3,42%	7,01%	1,14%	13,86%	20,01%	22,95%
BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.490.433,75	0,50%	BRDESCO	6,51%	0,00%	1,11%	3,27%	6,63%	1,11%	12,62%	18,11%	21,01%
URCA FI MULT CRED PRIV	26.304.161,46	8,81%	SANTANDER	6,18%	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	123.410.786,42	41,32%										
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	123.410.786,42	41,32%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
Renda Variável	49.966.625,58	16,73%			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	41.642.483,15	13,94%		1,20%								
GRUMARI FIA	3.901.102,04	1,31%	AZ QUEST	4,87%	5,62%	2,68%	-9,19%	2,74%	2,68%	-7,40%	-12,02%	-19,85%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	7.373.655,82	2,47%	CONSTANCIA	4,87%	7,31%	4,08%	-6,46%	4,39%	4,08%	2,71%	6,14%	-6,54%
CONSTELLATION RESERVA FIA	923.136,97	0,31%	CONSTELLATION	4,87%	9,84%	3,98%	-11,22%	1,32%	3,98%	-10,89%	-34,00%	-
FIA SÃO CONRADO	1.233.759,36	0,41%	EQUITAS	4,87%	13,61%	9,59%	-11,64%	4,21%	9,59%	-16,90%	-31,87%	-39,92%
FIA ITACOATIARA	1.159.780,67	0,39%	INDIE CAPITAL	4,87%	11,18%	3,57%	-9,54%	7,22%	3,57%	-17,30%	-33,26%	-
SHARP ARPOADOR IBrX ATIVO FIA	22.225.351,56	7,44%	SHARP	4,87%	7,43%	4,16%	-1,07%	12,22%	4,16%	9,72%	7,46%	13,90%
VINCI JOATINGA FIA	3.495.494,16	1,17%	VINCI	4,87%	8,40%	3,24%	-10,44%	3,61%	3,24%	-7,73%	-10,11%	-11,46%
FIA PIPA	1.330.202,58	0,45%	XP	4,87%	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	8.324.142,43	2,79%										
ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA	8.324.142,43	2,79%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX				3,51%	-2,34%	9,39%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	
Estruturado	11.008.448,23	3,69%			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	11.008.448,23	3,69%		1,23%								
NAVI LS ESTRUTURADO FIC FI MULT	3.569.566,88	1,20%	NAVI CAPITAL	0,67%	1,73%	-0,13%	0,72%	7,41%	-0,13%	15,91%	25,46%	28,45%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	683.822,12	0,23%	OCCAM	0,05%	2,64%	0,11%	-0,08%	4,74%	0,11%	11,03%	15,72%	24,10%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	2.706.996,32	0,91%	OCCAM	0,17%	2,64%	0,11%	-0,09%	4,74%	0,11%	11,04%	15,69%	24,06%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	2.086.870,48	0,70%	QUANTITAS	0,91%	0,91%	0,79%	4,05%	10,22%	0,79%	19,79%	27,99%	39,40%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	1.961.192,42	0,66%	ZEITGEIST	0,11%	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	11.635.887,91	3,90%			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	11.635.887,91	3,90%		4,09%								
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	11.635.887,91	3,56%	BLACKROCK	0,36%	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	7.152.782,30	2,39%			1,20%	4,00%	8,06%	1,20%	16,14%	36,15%	54,68%	
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.				1,43%	4,41%	7,18%	1,43%	17,97%	45,61%	71,27%	
Imobiliário	16.853.185,72	5,64%			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	298.704.353,96	100%			2,47%	0,53%	-1,40%	5,03%	0,53%	5,22%	5,73%	9,50%
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.

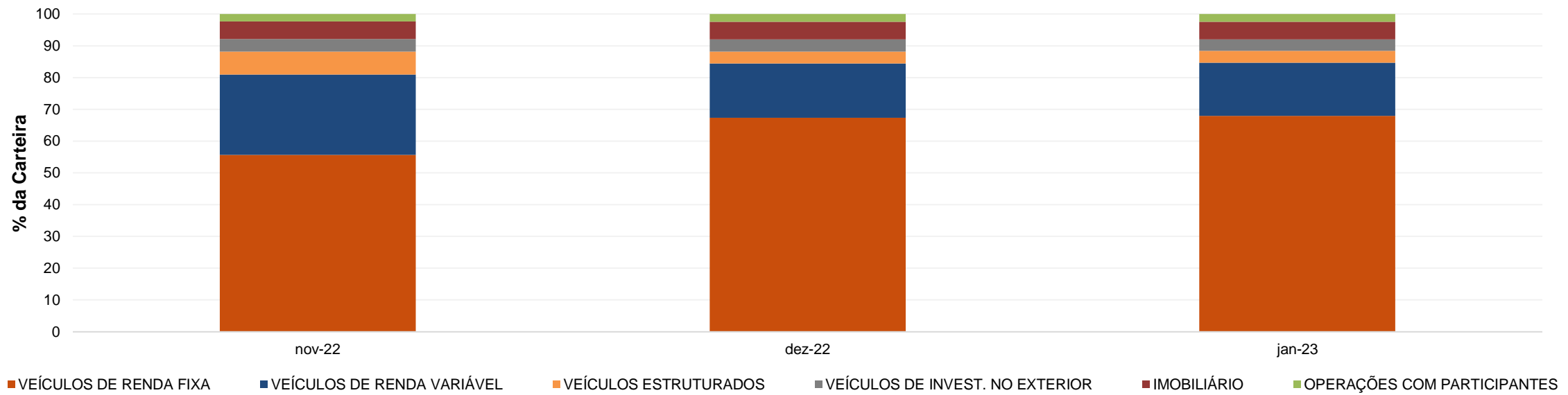
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

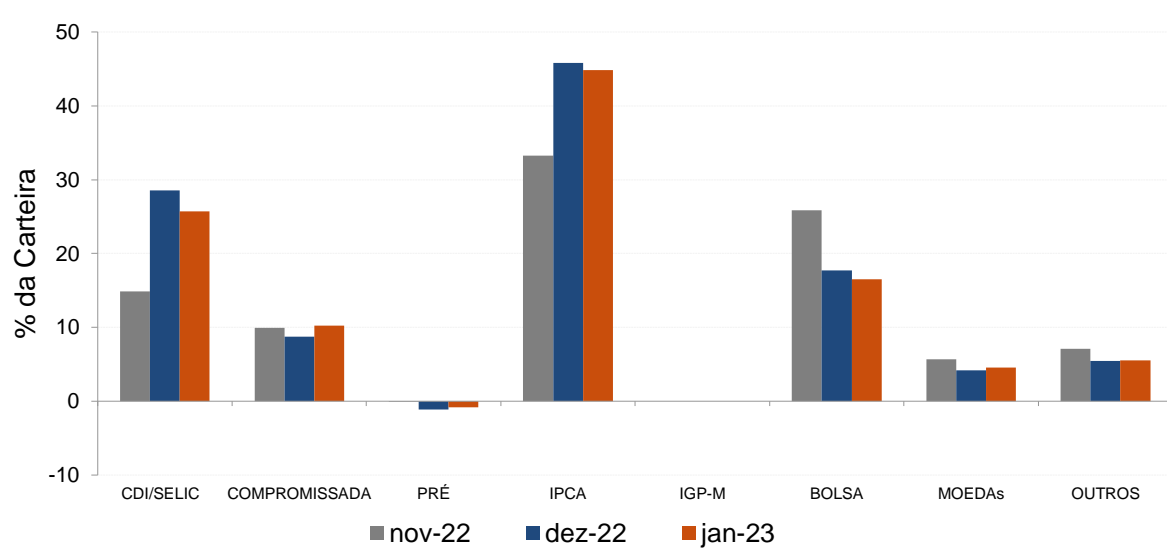
Distribuição da Carteira

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.

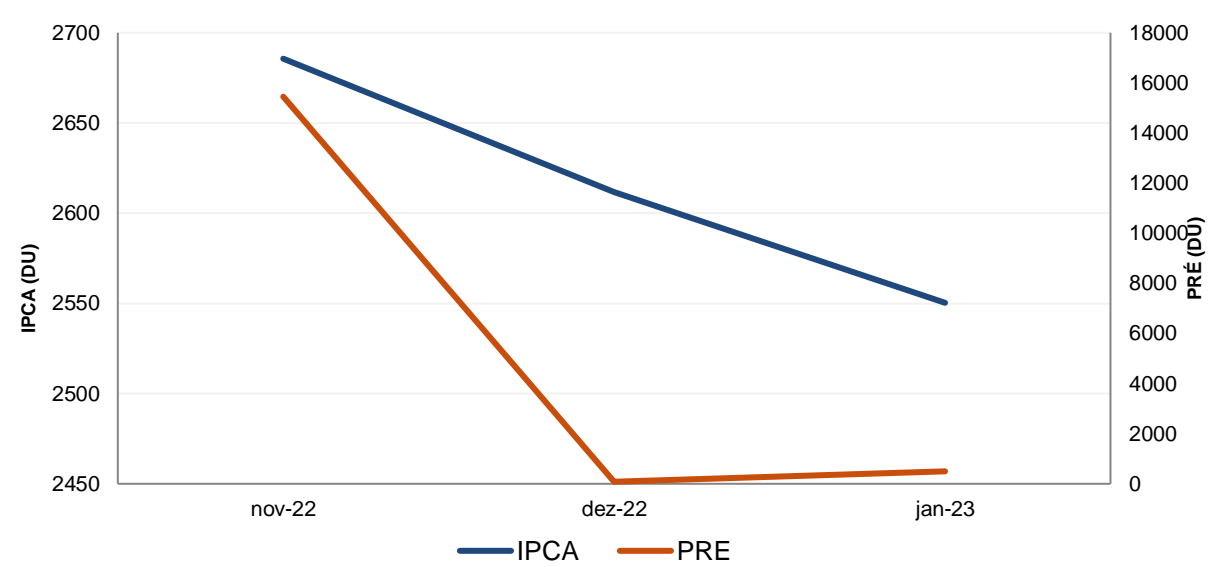
Evolução do Patrimônio Líquido



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	6.915,47	14,54	6.511,25	13,50
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	2.805,85	5,90	2.735,25	5,67
ITSA4	Intermediários Financeiros	2.254,55	4,74	2.403,10	4,98
EQTL3	Energia Elétrica	2.179,86	4,58	2.120,39	4,40
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	2.104,71	4,42	1.919,35	3,98
ELET3	Energia Elétrica	1.799,86	3,78	2.021,22	4,19
ITUB4	Intermediários Financeiros	1.584,72	3,33	1.915,71	3,97
RENT3	Diversos	1.578,51	3,32	1.481,57	3,07
ASAI3	Comércio e Distribuição	1.243,25	2,61	1.159,44	2,40
BPAC11	Intermediários Financeiros	1.236,64	2,60	1.506,27	3,12

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

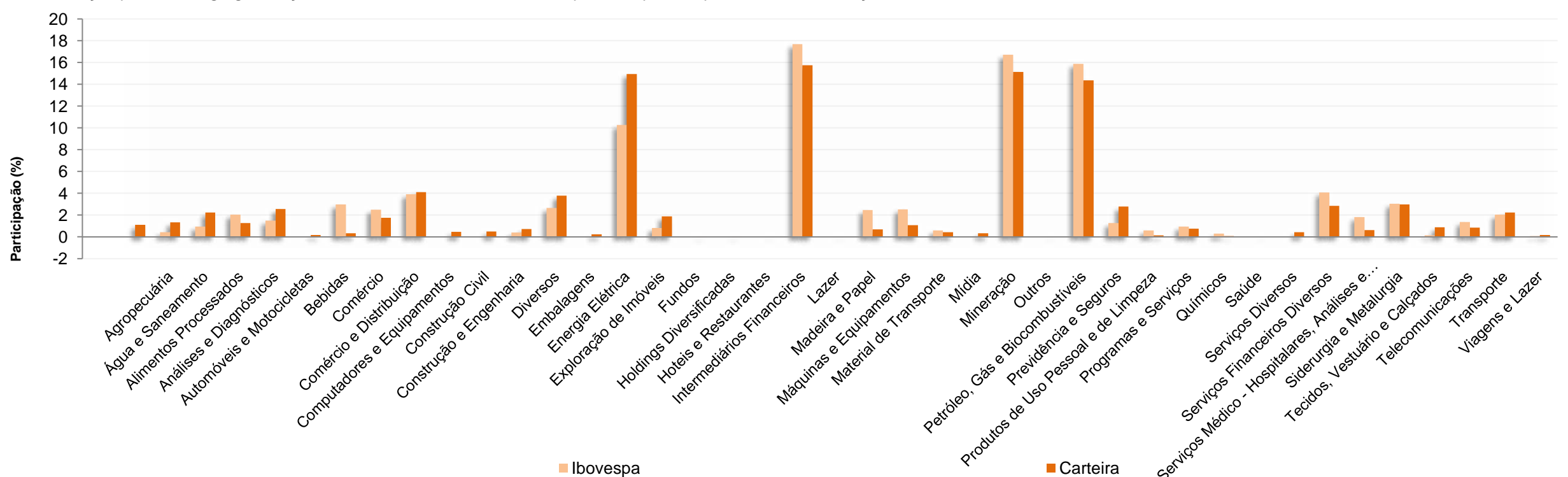
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
GETT11	0,02	0,00	0,00	Sem Liquidez
MTSA4	46,53	0,10	0,04	4
CRIV4	10,45	0,02	0,01	2
VALE3	6.915,47	14,54	0,00	1
PETR4	2.805,85	5,90	0,00	1
ITSA4	2.254,55	4,74	0,01	1
EQTL3	2.179,86	4,58	0,01	1
PRIO3	2.104,71	4,42	0,01	1
ELET3	1.799,86	3,78	0,00	1
ITUB4	1.584,72	3,33	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: 31/01/2023

Análises de Contrapartes

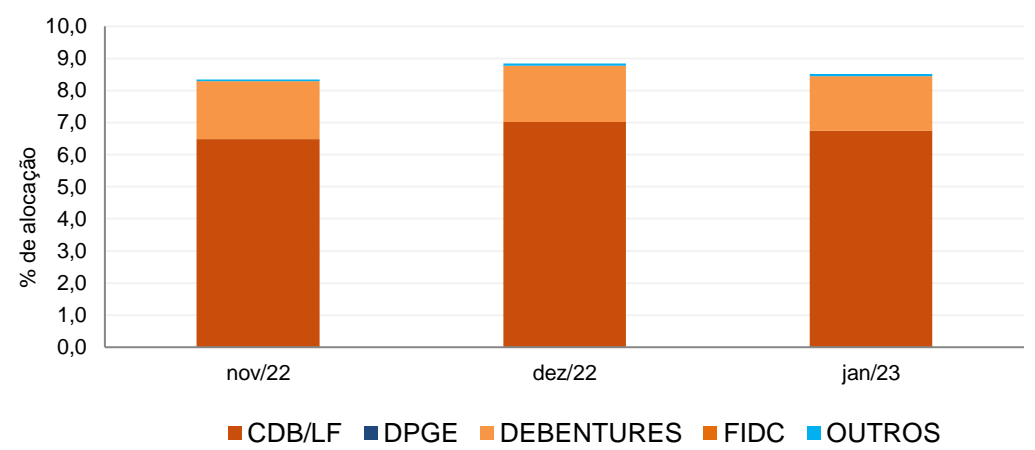
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	11.261,48	4,12	Faixa 1
VALE SA	6.915,47	2,53	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.919,41	1,07	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	2.833,02	1,04	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	2.781,65	1,02	Faixa 2
ITAUSA SA	2.373,27	0,87	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	2.179,86	0,80	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	2.162,72	0,79	Faixa 2
PETRO RIO SA	2.104,71	0,77	Faixa 2
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	1.676,53	0,61	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 SALDADO

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. Nenhuma operação feita no último mês.

