

ELETROS - ELETROS PLANO CV EPE

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 | 95.117.717,23 | 70,01% | | | 0,19% | 0,14% | 4,71% | 0,19% | 9,03% | 10,57% | 16,73% | |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,12% | 3,30% | 6,71% | 1,12% | 12,81% | 18,45% | 21,46% | |
| Renda Fixa CDI | 54.138.757,18 | 39,85% | | 0,06% | | | | | | | | |
| ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP | 35.237.164,23 | 25,94% | ALFA | 4,31% | 0,01% | 1,14% | 3,42% | 7,01% | 1,14% | 13,86% | 20,01% | 22,95% |
| BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV | 1.013.562,95 | 0,75% | BRDESCO | 4,43% | 0,00% | 1,11% | 3,27% | 6,63% | 1,11% | 12,62% | 18,11% | 21,01% |
| URCA FI MULT CRED PRIV | 17.888.030,00 | 13,17% | SANTANDER | 4,20% | 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 | 40.978.960,05 | 30,16% | | | | | | | | | | |
| ELETROS PLANO CV EPE CARTEIRA PROPRIA RF | 40.978.960,05 | 30,16% | | 100% | - | - | - | - | - | - | - | |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,12% | 3,30% | 6,71% | 1,12% | 12,81% | 18,45% | 21,46% | |
| Renda Variável | 26.716.676,71 | 19,66% | | | 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 | 22.356.337,34 | 16,46% | | 1,20% | | | | | | | | |
| GRUMARI FIA | 2.094.360,05 | 1,54% | AZ QUEST | 2,62% | 5,62% | 2,68% | -9,19% | 2,74% | 2,68% | -7,40% | -12,02% | -19,85% |
| FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS | 3.958.648,10 | 2,91% | CONSTANCIA | 2,62% | 7,31% | 4,08% | -6,46% | 4,39% | 4,08% | 2,71% | 6,14% | -6,54% |
| CONSTELLATION RESERVA FIA | 495.598,73 | 0,36% | CONSTELLATION | 2,62% | 9,84% | 3,98% | -11,22% | 1,32% | 3,98% | -10,89% | -34,00% | - |
| FIA SÃO CONRADO | 662.360,61 | 0,49% | EQUITAS | 2,62% | 13,61% | 9,59% | -11,64% | 4,21% | 9,59% | -16,90% | -31,87% | -39,92% |
| FIA ITACOATIARA | 622.644,13 | 0,46% | INDIE CAPITAL | 2,62% | 11,18% | 3,57% | -9,54% | 7,22% | 3,57% | -17,30% | -33,26% | - |
| SHARP ARPOADOR IBrX ATIVO FIA | 11.931.984,34 | 8,78% | SHARP | 2,62% | 7,43% | 4,16% | -1,07% | 12,22% | 4,16% | 9,72% | 7,46% | 13,90% |
| VINCI JOATINGA FIA | 1.876.603,91 | 1,38% | VINCI | 2,62% | 8,40% | 3,24% | -10,44% | 3,61% | 3,24% | -7,73% | -10,11% | -11,46% |
| FIA PIPA | 714.137,47 | 0,53% | XP | 2,62% | 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 | 4.360.339,37 | 3,21% | | | | | | | | | | |
| ELETROS PLANO CV EPE CARTEIRA PROPRIA RV | 4.360.339,37 | 3,21% | | 100% | - | - | - | - | - | - | - | |
| Benchmark: | IBX | | | | 3,51% | -2,34% | 9,39% | 3,51% | 0,75% | -1,38% | 0,24% | |
| Estruturado | 7.391.883,99 | 5,44% | | | 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 | 7.391.883,99 | 5,44% | | 1,23% | | | | | | | | |
| NAVI LS ESTRUTURADO FIC FI MULT | 2.396.870,45 | 1,76% | NAVI CAPITAL | 0,45% | 1,73% | -0,13% | 0,72% | 7,41% | -0,13% | 15,91% | 25,46% | 28,45% |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI | 1.817.676,97 | 1,34% | OCCAM | 0,12% | 2,64% | 0,11% | -0,09% | 4,74% | 0,11% | 11,04% | 15,69% | 24,06% |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT | 459.168,60 | 0,34% | OCCAM | 0,03% | 2,64% | 0,11% | -0,08% | 4,74% | 0,11% | 11,03% | 15,72% | 24,10% |
| QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP | 1.401.278,75 | 1,03% | QUANTITAS | 0,61% | | 0,79% | 4,05% | 10,22% | 0,79% | 19,79% | 27,99% | 39,40% |
| GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT | 1.316.889,22 | 0,97% | ZEITGEIST | 0,08% | 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 | 4.978.738,05 | 3,66% | | | 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 | 4.978.738,05 | 3,66% | | 4,09% | | | | | | | | |
| ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE | 4.978.738,05 | 3,35% | BLACKROCK | 0,16% | 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 | 2.046.742,27 | 1,51% | | | 1,07% | 1,62% | 2,07% | 1,07% | 11,14% | 30,53% | 47,24% | |
| Benchmark: | INPC + 11.60% a.a. | | | | 1,43% | 4,41% | 7,18% | 1,43% | 17,97% | 45,61% | 71,27% | |
| Total | 135.859.298,60 | 100% | | | 2,24% | 1,01% | -0,87% | 5,31% | 1,01% | 6,98% | 8,09% | 13,02% |
| Benchmark: | INPC + 4.86% a.a. | | | | 0,88% | 2,77% | 3,85% | 0,88% | 10,85% | 28,56% | 42,18% | |

* 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.

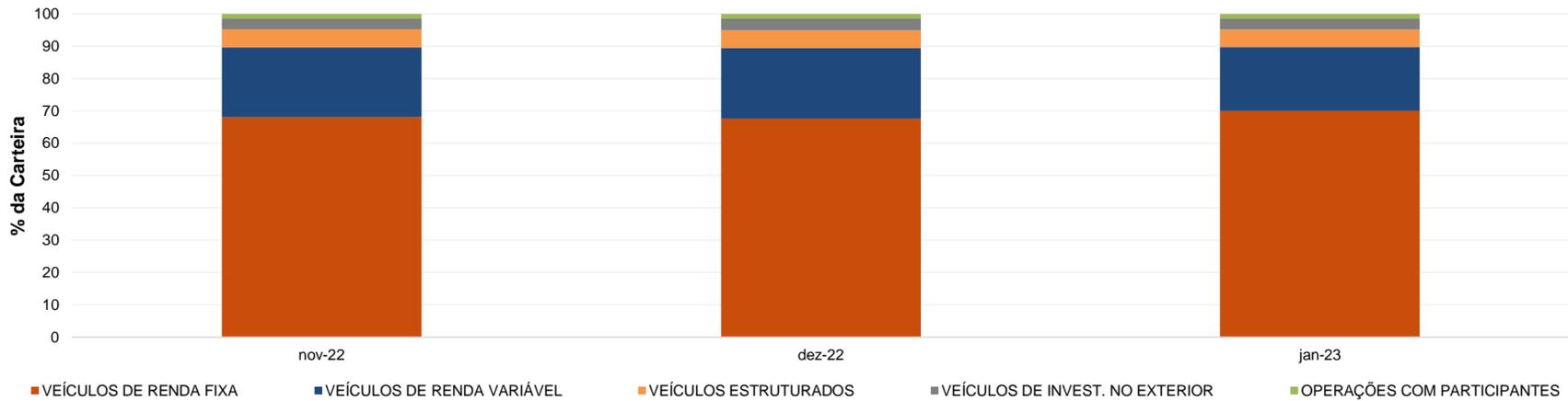
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

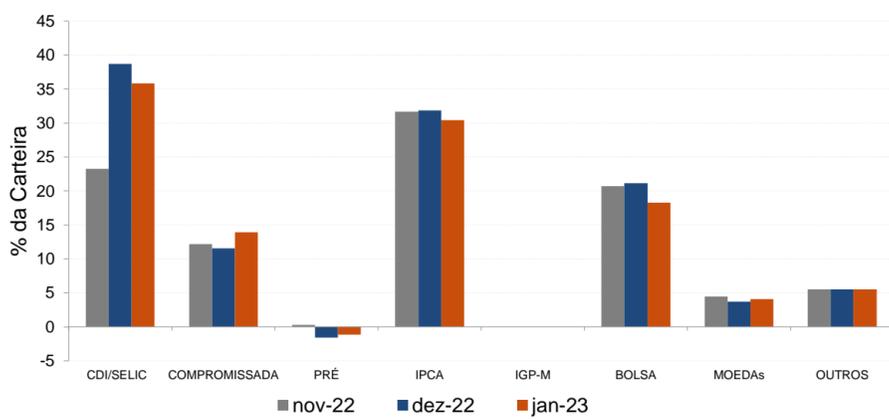
Distribuição da Carteira

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.

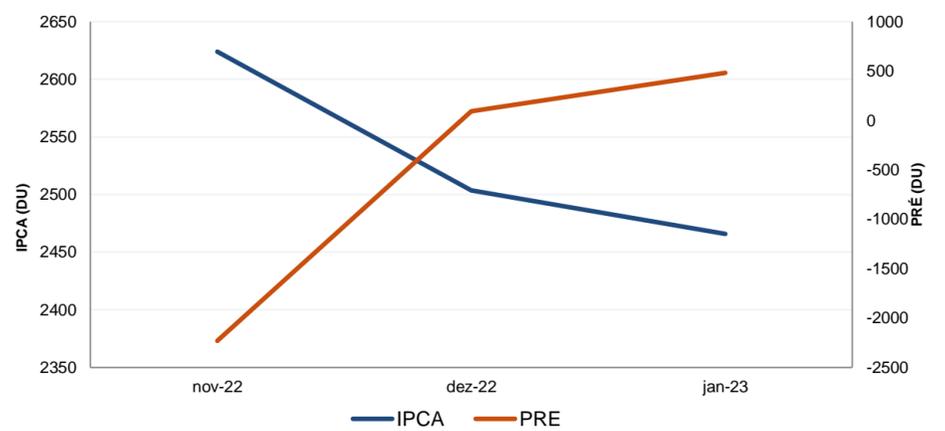
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | 3.758,53 | 14,53 | 3.692,58 | 13,46 |
| PETRA4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 1.560,71 | 6,04 | 1.581,25 | 5,77 |
| ITSA4 | Intermediários Financeiros | 1.231,48 | 4,76 | 1.378,51 | 5,03 |
| EQTL3 | Energia Elétrica | 1.205,91 | 4,66 | 1.230,44 | 4,49 |
| PRI03 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 1.139,08 | 4,40 | 1.091,67 | 3,98 |
| ELET3 | Energia Elétrica | 998,18 | 3,86 | 1.168,76 | 4,26 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 878,16 | 3,40 | 1.107,35 | 4,04 |
| RENT3 | Diversos | 850,60 | 3,29 | 840,24 | 3,06 |
| ASAI3 | Comércio e Distribuição | 688,28 | 2,66 | 673,04 | 2,45 |
| BPAC11 | Intermediários Financeiros | 673,37 | 2,60 | 860,51 | 3,14 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

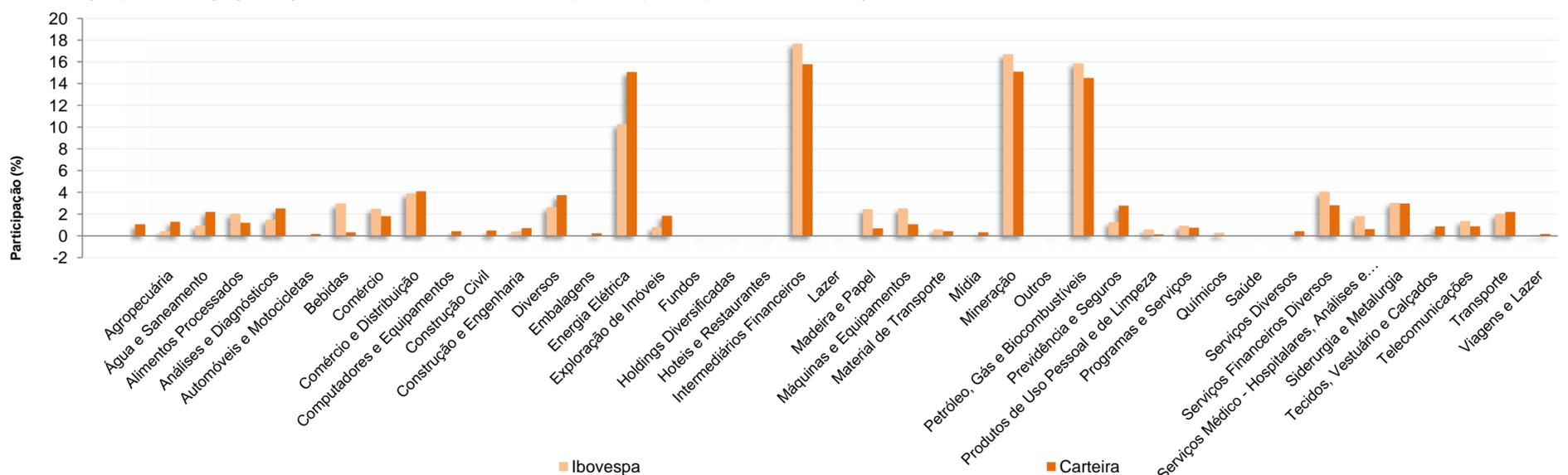
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|--------|----------|-------|--------------|--------------------|
| GETT11 | 0,01 | 0,00 | 0,00 | Sem Liquidez |
| MTSA4 | 24,98 | 0,10 | 0,02 | 1 |
| VALE3 | 3.758,53 | 14,53 | 0,00 | 1 |
| PETRA4 | 1.560,71 | 6,04 | 0,00 | 1 |
| ITSA4 | 1.231,48 | 4,76 | 0,00 | 1 |
| EQTL3 | 1.205,91 | 4,66 | 0,01 | 1 |
| PRI03 | 1.139,08 | 4,40 | 0,00 | 1 |
| ELET3 | 998,18 | 3,86 | 0,00 | 1 |
| ITUB4 | 878,16 | 3,40 | 0,00 | 1 |
| RENT3 | 850,60 | 3,29 | 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 CV EPE

Data-base: 31/01/2023

Análises de Contrapartes

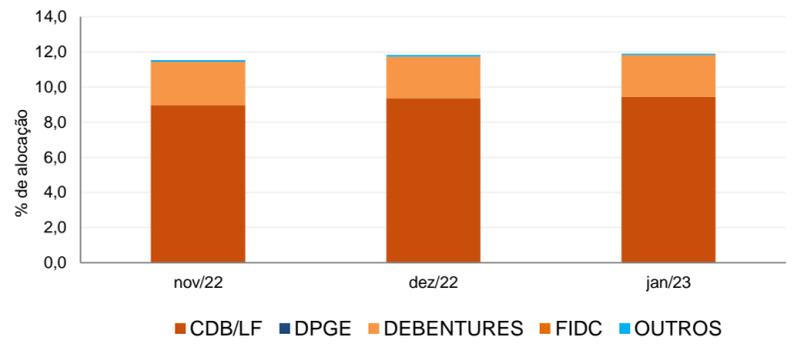
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|---|----------|------|---------------------------|
| BCO BRADESCO SA | 7.476,05 | 5,63 | Faixa 1 |
| VALE SA | 3.758,53 | 2,83 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 1.985,33 | 1,50 | Faixa 1 |
| BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA | 1.891,65 | 1,43 | Faixa 2 |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 1.575,03 | 1,19 | Faixa 2 |
| ITAUSA SA | 1.312,21 | 0,99 | Faixa 2 |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE | 1.236,74 | 0,93 | Faixa 2 |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 1.205,91 | 0,91 | Faixa 1 |
| PETRO RIO SA | 1.139,08 | 0,86 | Faixa 2 |
| BCO ITAU SA | 1.030,68 | 0,78 | 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 CV EPE

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.

