

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	551.731.325,98	69,26%			0,04%	-0,31%	4,37%	0,04%	8,38%	9,55%	15,80%	
Benchmark:	CDI				1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
Renda Fixa CDI	272.523.039,80	34,21%		0,06%								
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	177.376.423,28	22,27%	ALFA	21,68%	0,01%	1,14%	3,42%	7,01%	1,14%	13,86%	20,01%	22,95%
BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	5.102.061,29	0,64%	BRDESCO	22,29%	0,00%	1,11%	3,27%	6,63%	1,11%	12,62%	18,11%	21,01%
URCA FI MULT CRED PRIV	90.044.555,23	11,30%	SANTANDER	21,16%	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	279.208.286,18	35,05%										
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RF	279.208.286,18	35,05%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				1,12%	3,30%	6,71%	1,12%	12,81%	18,45%	21,46%	
Renda Variável	162.487.802,41	20,40%			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	136.256.829,31	17,11%		1,20%								
GRUMARI FIA	12.764.651,74	1,60%	AZ QUEST	15,94%	5,62%	2,68%	-9,19%	2,74%	2,68%	-7,40%	-12,02%	-19,85%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	24.127.066,55	3,03%	CONSTANCIA	15,94%	7,31%	4,08%	-6,46%	4,39%	4,08%	2,71%	6,14%	-6,54%
CONSTELLATION RESERVA FIA	3.020.562,36	0,38%	CONSTELLATION	15,94%	9,84%	3,98%	-11,22%	1,32%	3,98%	-10,89%	-34,00%	-
FIA SÃO CONRADO	4.036.938,37	0,51%	EQUITAS	15,94%	13,61%	9,59%	-11,64%	4,21%	9,59%	-16,90%	-31,87%	-39,92%
FIA ITACOATIARA	3.794.875,44	0,48%	INDIE CAPITAL	15,94%	11,18%	3,57%	-9,54%	7,22%	3,57%	-17,30%	-33,26%	-
SHARP ARPOADOR IBrX ATIVO FIA	72.722.751,02	9,13%	SHARP	15,94%	7,43%	4,16%	-1,07%	12,22%	4,16%	9,72%	7,46%	13,90%
VINCI JOATINGA FIA	11.437.477,17	1,44%	VINCI	15,94%	8,40%	3,24%	-10,44%	3,61%	3,24%	-7,73%	-10,11%	-11,46%
FIA PIPA	4.352.506,66	0,55%	XP	15,94%	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	26.230.973,10	3,29%										
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RV	26.230.973,10	3,29%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX				3,51%	-2,34%	9,39%	3,51%	0,75%	-1,38%	0,24%	
Estruturado	46.394.765,79	5,82%			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	46.394.765,79	5,82%		1,23%								
NAVI LS ESTRUTURADO FIC FI MULT	15.043.829,61	1,89%	NAVI CAPITAL	2,81%	1,73%	-0,13%	0,72%	7,41%	-0,13%	15,91%	25,46%	28,45%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	2.881.947,26	0,36%	OCCAM	0,21%	2,64%	0,11%	-0,08%	4,74%	0,11%	11,03%	15,72%	24,10%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	11.408.552,57	1,43%	OCCAM	0,73%	2,64%	0,11%	-0,09%	4,74%	0,11%	11,04%	15,69%	24,06%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	8.795.051,34	1,10%	QUANTITAS	3,84%	3,84%	0,79%	4,05%	10,22%	0,79%	19,79%	27,99%	39,40%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	8.265.385,01	1,04%	ZEITGEIST	0,48%	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	26.323.200,27	3,30%			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	26.323.200,27	3,30%		4,09%								
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	26.323.200,27	3,02%	BLACKROCK	0,82%	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	11.684.552,64	1,47%			1,01%	2,48%	4,30%	1,01%	13,25%	34,94%	55,99%	
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.				1,43%	4,41%	7,18%	1,43%	17,97%	45,61%	71,27%	
Total	796.573.623,08	100%			2,42%	0,91%	-1,20%	5,09%	0,91%	6,55%	7,31%	12,31%
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.

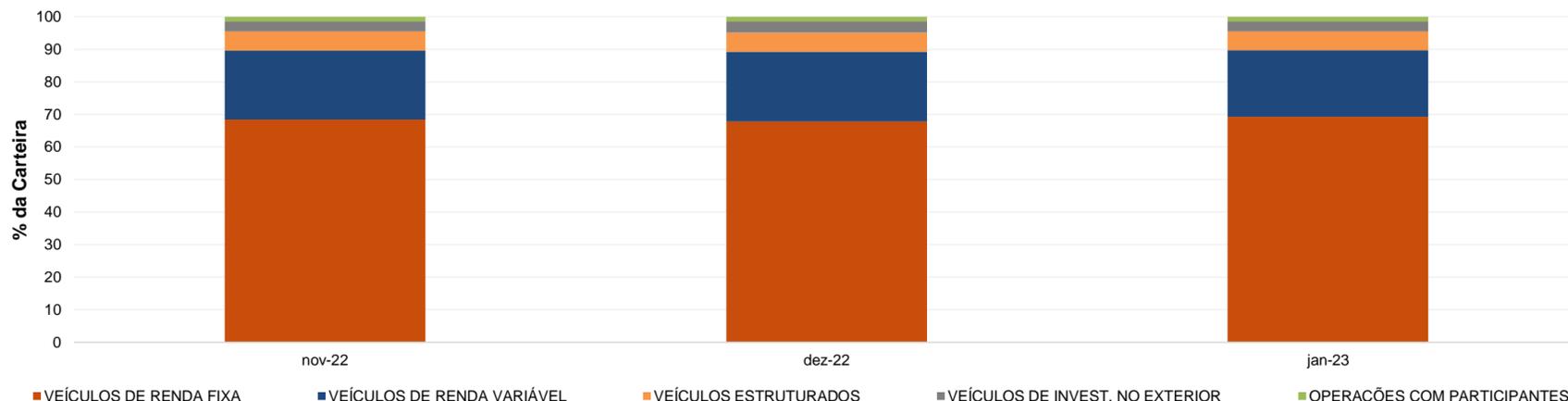
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

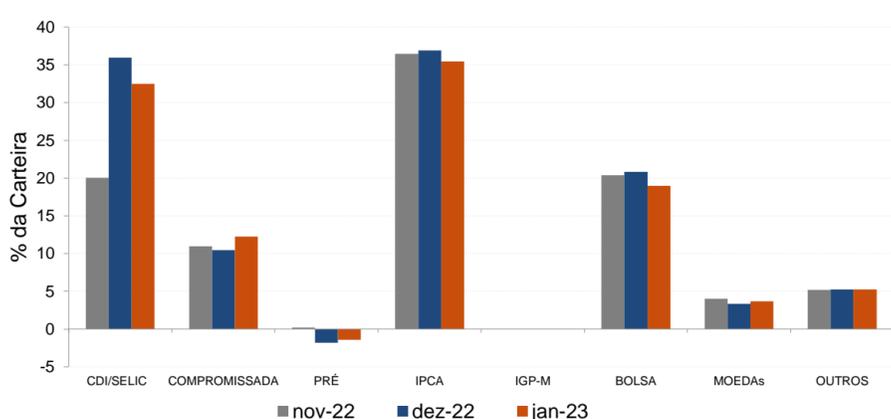
Distribuição da Carteira

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.

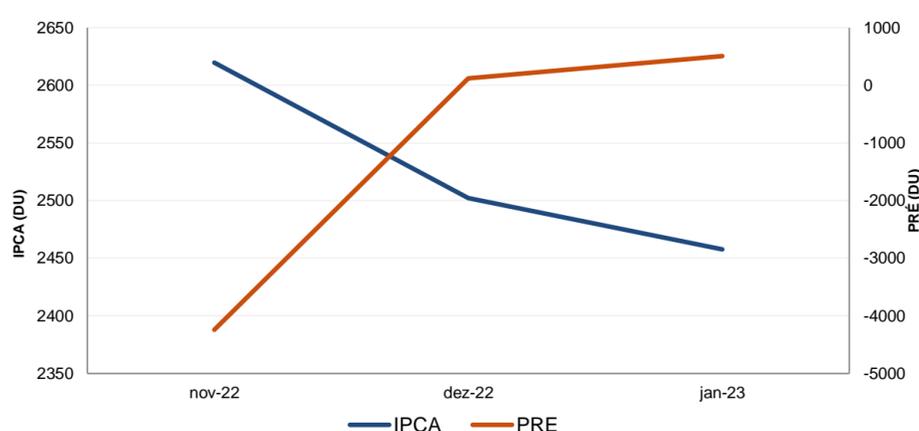
Evolução do Patrimônio Líquido



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	22.948,99	14,53	21.343,49	13,44
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	9.561,43	6,06	9.235,83	5,82
ITSA4	Intermediários Financeiros	7.524,71	4,77	8.018,03	5,05
EQTL3	Energia Elétrica	7.382,03	4,68	7.201,28	4,54
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	6.950,70	4,40	6.320,11	3,98
ELET3	Energia Elétrica	6.112,59	3,87	6.827,45	4,30
ITUB4	Intermediários Financeiros	5.377,02	3,41	6.467,46	4,07
RENT3	Diversos	5.187,08	3,29	4.856,76	3,06
ASAI3	Comércio e Distribuição	4.213,79	2,67	3.939,73	2,48
BPAC11	Intermediários Financeiros	4.112,63	2,60	4.993,94	3,15

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

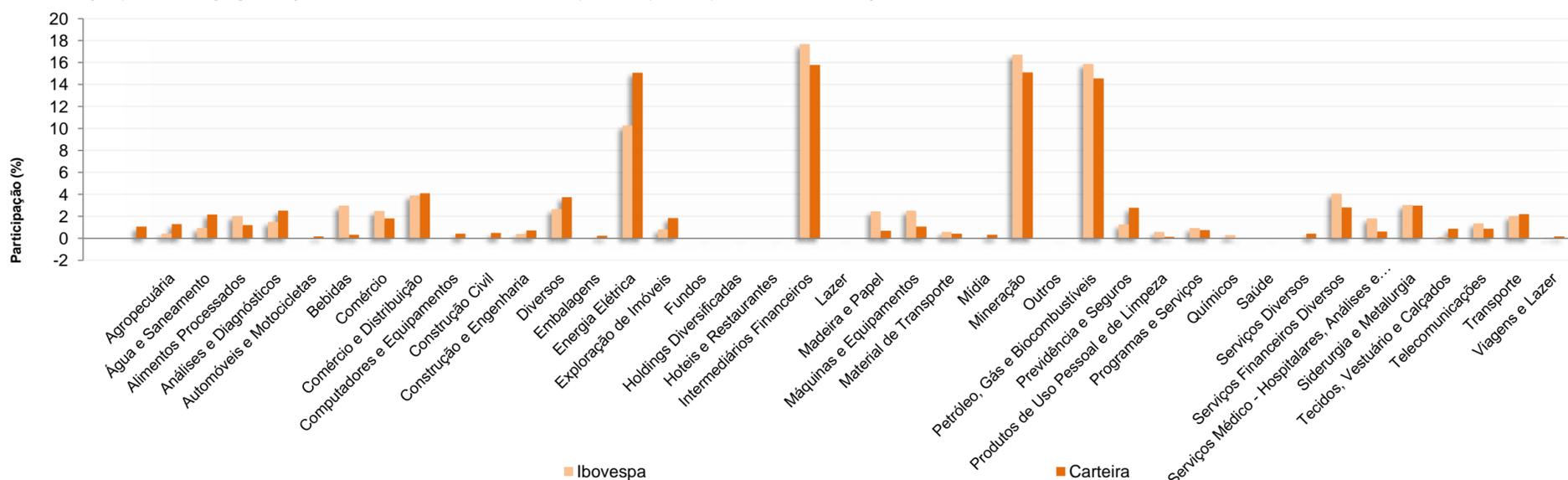
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
GETT11	0,08	0,00	0,00	Sem Liquidez
MTSA4	152,25	0,10	0,14	12
CRIV4	34,18	0,02	0,04	6
LAND3	350,82	0,22	0,05	2
HBRE3	158,09	0,10	0,14	2
ALLD3	75,18	0,05	0,08	2
EALT4	41,44	0,03	0,08	2
SCAR3	39,55	0,03	0,02	2
VALE3	22.948,99	14,53	0,01	1
PETR4	9.561,43	6,06	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.



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 ONS

Data-base: 31/01/2023

Análises de Contrapartes

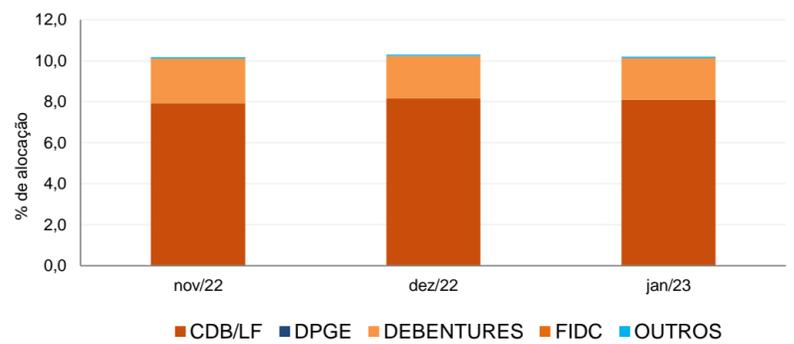
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	38.321,91	4,92	Faixa 1
VALE SA	22.948,99	2,94	Faixa 1
BCO SAFRA SA	9.993,73	1,28	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	9.648,49	1,24	Faixa 2
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	9.522,18	1,22	Faixa 2
ITAUSA SA	7.931,09	1,02	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	7.421,01	0,95	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	7.382,03	0,95	Faixa 1
PETRO RIO SA	6.950,70	0,89	Faixa 2
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	5.697,01	0,73	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 ONS

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 2028-08-15	15-ago-28	20.437	0,00%	IPCA	09-jan-23	6,34%	6,29%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA P
NTN-B 2035-05-15	15-mai-35	3.945	0,00%	IPCA	12-jan-23	6,19%	6,06%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA P

