

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 28/02/2023

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	1.071.496.008,55	69,54%			1,08%	0,84%	3,30%	1,04%	8,60%	10,76%	16,29%	
Benchmark:	CDI				0,92%	3,20%	6,44%	2,05%	13,00%	19,38%	22,21%	
Renda Fixa CDI	494.451.692,57	32,09%		0,04%								
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	320.084.692,44	20,77%	ALFA	39,46%	0,01%	0,87%	3,23%	6,64%	2,02%	13,86%	20,91%	23,75%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	9.360.538,05	0,61%	BRADESCO	40,54%	0,00%	0,91%	3,16%	6,37%	2,03%	12,81%	19,03%	21,75%
URCA FI MULT CRED PRIV	165.006.462,08	10,71%	SANTANDER	38,45%	0,11%	0,79%	3,09%	6,44%	1,89%	13,31%	19,83%	22,61%
Benchmark:	CDI				0,92%	3,20%	6,44%	2,05%	13,00%	19,38%	22,21%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	577.044.315,98	37,45%										
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF	577.044.315,98	37,45%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				0,92%	3,20%	6,44%	2,05%	13,00%	19,38%	22,21%	
Renda Variável	263.731.239,07	17,12%			-7,18%	-6,25%	-6,37%	-3,61%	-7,31%	-6,56%	-3,53%	
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				-7,46%	-6,40%	-3,84%	-4,04%	-6,40%	-1,79%	7,09%	
Renda Variável Ativa	219.589.769,54	14,25%		1,76%								
GRUMARI FIA	16.443.877,35	1,07%	AZ QUEST	26,85%	5,99%	-4,99%	-4,23%	-7,93%	-2,44%	-11,12%	-17,10%	-19,90%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	9.813.644,18	0,16%	BLACKROCK	0,07%	8,17%	-7,91%	-6,84%	-4,42%	-4,53%	-7,12%	-4,20%	0,80%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	38.214.071,73	2,48%	CONSTANCIA	26,85%	6,92%	-5,95%	-4,88%	-8,31%	-2,11%	-2,51%	2,23%	-6,74%
CONSTELLATION RESERVA FIA	4.728.892,58	0,31%	CONSTELLATION	26,85%	8,92%	-7,02%	-8,20%	-9,15%	-3,32%	-16,77%	-36,95%	-
FIA SÃO CONRADO	6.781.151,94	0,44%	EQUITAS	26,85%	16,11%	-0,26%	1,60%	-6,07%	9,30%	-15,89%	-30,01%	-33,95%
FIA ITACOATIARA	5.869.317,80	0,38%	INDIE CAPITAL	26,85%	9,97%	-8,16%	-8,97%	-10,96%	-4,88%	-20,09%	-36,08%	-
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	112.760.684,19	7,32%	SHARP	26,85%	7,97%	-7,93%	-6,45%	-3,50%	-4,10%	-2,09%	2,41%	13,14%
VINCI JOATINGA FIA	18.062.997,02	1,17%	VINCI	26,85%	8,40%	-6,23%	-7,84%	-8,29%	-3,18%	-12,93%	-13,03%	-11,86%
FIA PIPA	6.915.132,75	0,45%	XP	26,85%	6,50%	-5,66%	-3,89%	-8,03%	-2,37%	2,27%	-0,12%	-
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				-7,46%	-6,40%	-3,84%	-4,04%	-6,40%	-1,79%	7,09%	
CARTEIRA PRÓPRIA RV	44.141.469,53	2,86%										
ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RV	44.141.469,53	2,86%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX				-7,59%	-6,85%	-4,76%	-4,34%	-8,23%	-5,60%	0,93%	
Estruturado	88.921.105,61	5,77%			0,69%	1,01%	4,18%	0,96%	13,40%	20,71%	21,12%	
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,06%	3,70%	7,48%	2,37%	15,25%	24,20%	29,66%	
Multimercados Estruturados	88.921.105,61	5,77%		1,12%								
NAVI LS ESTRUTURADO FIC FI MULT	28.903.112,48	1,88%	NAVI CAPITAL	5,35%	1,72%	0,93%	0,31%	4,32%	0,80%	16,13%	26,39%	29,72%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	5.535.331,97	0,36%	OCCAM	0,41%	2,26%	0,90%	1,25%	4,51%	1,01%	11,72%	15,25%	25,71%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	21.912.290,87	1,42%	OCCAM	1,45%	2,26%	0,90%	1,25%	4,51%	1,01%	11,73%	15,26%	25,76%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	16.874.797,15	1,10%	QUANTITAS	7,43%		0,80%	3,25%	7,97%	1,59%	21,00%	29,55%	39,66%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	15.695.573,14	1,02%	ZEITGEIST	0,97%	1,92%	-0,24%	-0,18%	0,31%	0,49%	7,96%	23,21%	24,86%
Benchmark:	CDI + 2% a.a.				1,06%	3,70%	7,48%	2,37%	15,25%	24,20%	29,66%	
Exterior	52.435.131,56	3,40%			0,48%	-1,68%	1,60%	1,91%	-6,38%	-1,01%	20,46%	
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-0,45%	-1,86%	3,90%	4,10%	-7,70%	-6,26%	46,77%	
Exterior - RV	52.435.131,56	3,40%		3,65%								
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	52.435.131,56	3,40%	BLACKROCK	1,71%	6,58%	0,48%	-1,69%	1,46%	1,91%	-6,60%	-0,74%	61,07%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-0,45%	-1,86%	3,90%	4,10%	-7,70%	-6,26%	46,77%	
Operações com Participantes **	25.839.388,44	1,68%			1,43%	2,33%	1,13%	1,67%	9,35%	28,47%	44,93%	
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.				1,56%	4,72%	8,11%	3,01%	17,65%	45,54%	72,30%	
Imobiliário **	45.464.260,99	2,95%			-0,24%	0,87%	2,19%	0,49%	5,77%	15,82%	41,17%	
Benchmark:	INPC				0,77%	1,93%	2,47%	1,23%	5,47%	16,86%	24,12%	
Total	1.540.812.197,75	100%			2,16%	-0,41%	-0,39%	1,59%	0,33%	5,52%	7,83%	14,41%
Benchmark:	INPC + 5.2% a.a.				1,14%	3,21%	5,04%	2,05%	10,93%	29,33%	44,42%	

- Rentabilidades de Carteiras, Segmentos e Planos foram informados pela (o) ELETROS

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 31/01/2023

* 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.

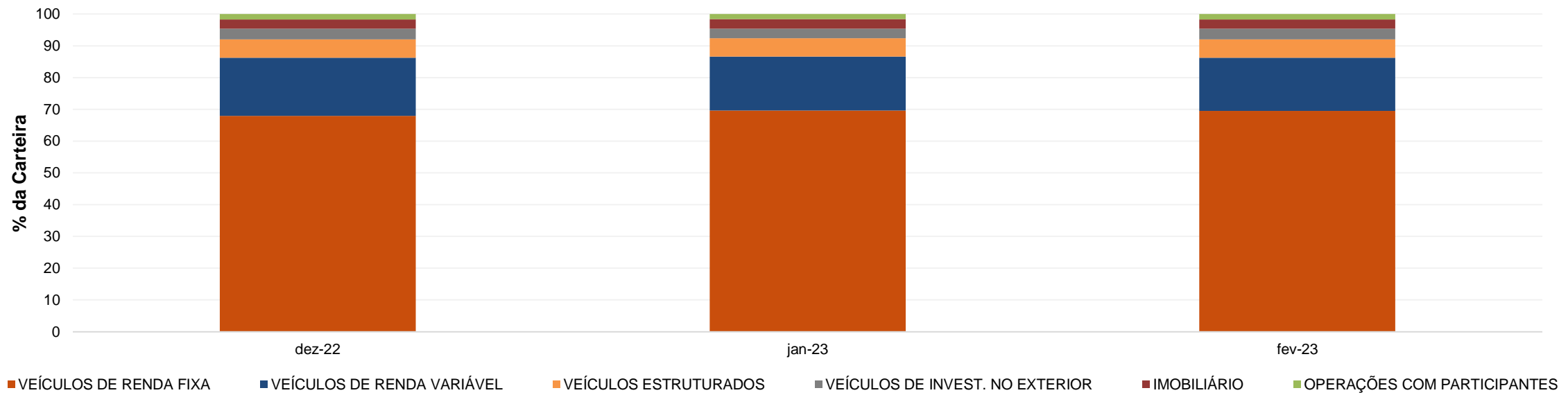
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

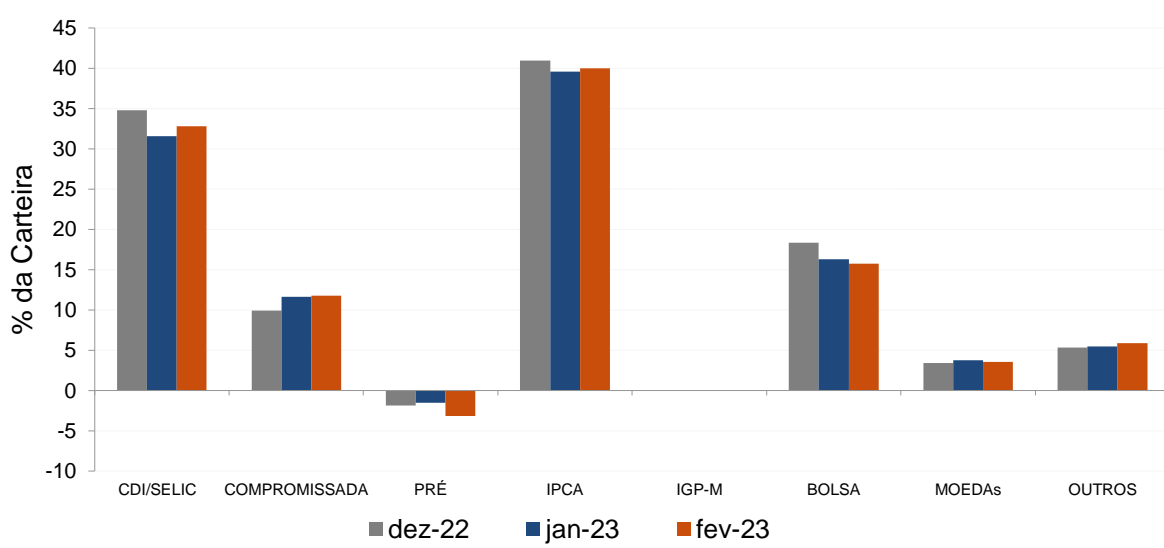
Distribuição da Carteira

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.

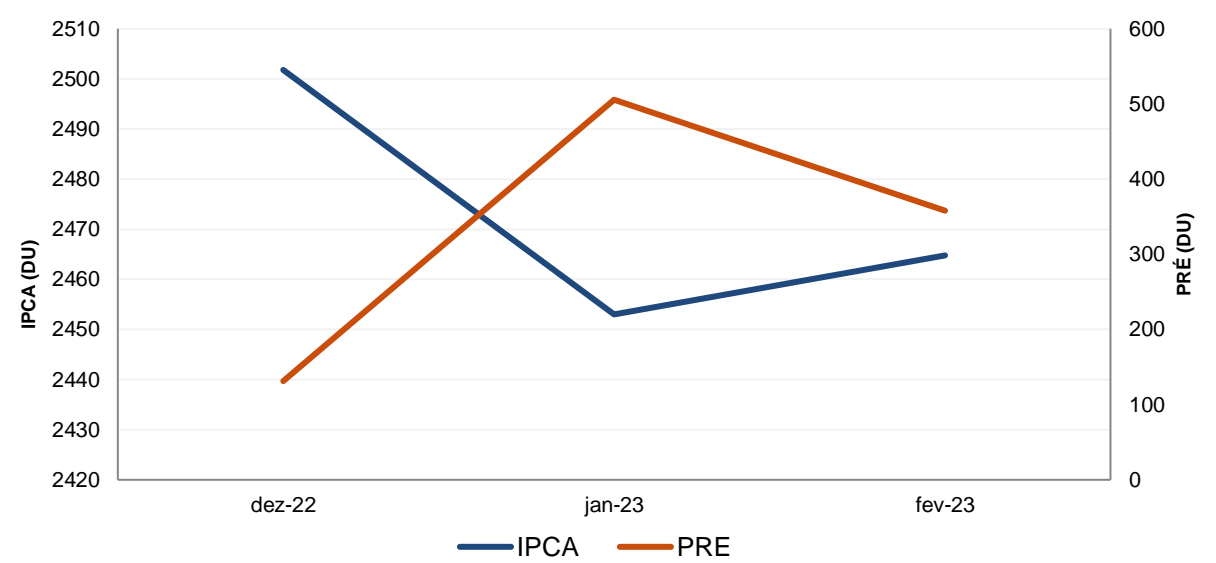
Evolução do Patrimônio Líquido



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	35.561,14	14,26	37.666,09	14,53
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	16.534,95	6,63	16.001,71	6,17
ITSA4	Intermediários Financeiros	12.377,91	4,96	12.403,27	4,79
EQTL3	Energia Elétrica	12.176,64	4,88	12.298,85	4,74
ITUB4	Intermediários Financeiros	9.228,82	3,70	8.970,97	3,46
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	9.082,55	3,64	11.366,50	4,39
ELET3	Energia Elétrica	8.658,24	3,47	10.204,92	3,94
RENT3	Diversos	8.304,17	3,33	8.450,35	3,26
BBAS3	Intermediários Financeiros	7.243,07	2,90	5.558,03	2,14
ASA13	Comércio e Distribuição	6.432,85	2,58	7.024,69	2,71

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

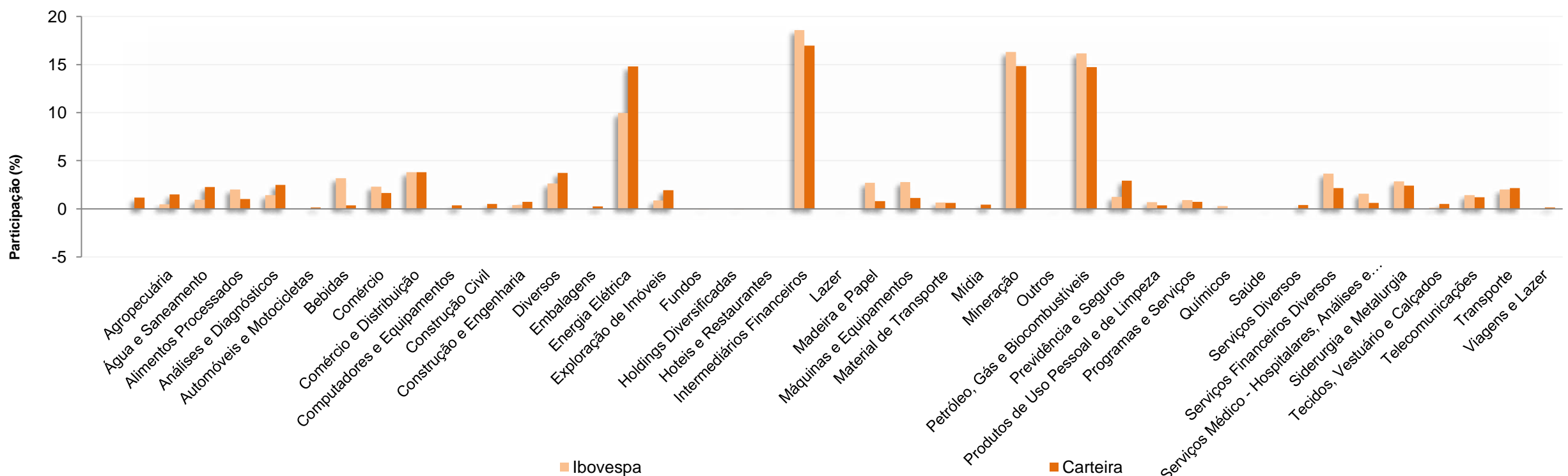
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BRML3	7,35	0,00	0,00	Sem Liquidez
GETT11	0,01	0,00	0,00	Sem Liquidez
MTSA4	258,28	0,10	0,23	22
CRIV4	57,92	0,02	0,07	8
HBRE3	259,55	0,10	0,24	4
ALLD3	109,88	0,04	0,14	4
LAND3	572,49	0,23	0,08	3
EALT4	65,84	0,03	0,14	3
ELMD3	1.049,37	0,42	0,19	2
MDNE3	146,78	0,06	0,10	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.



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.

Análises de Contrapartes

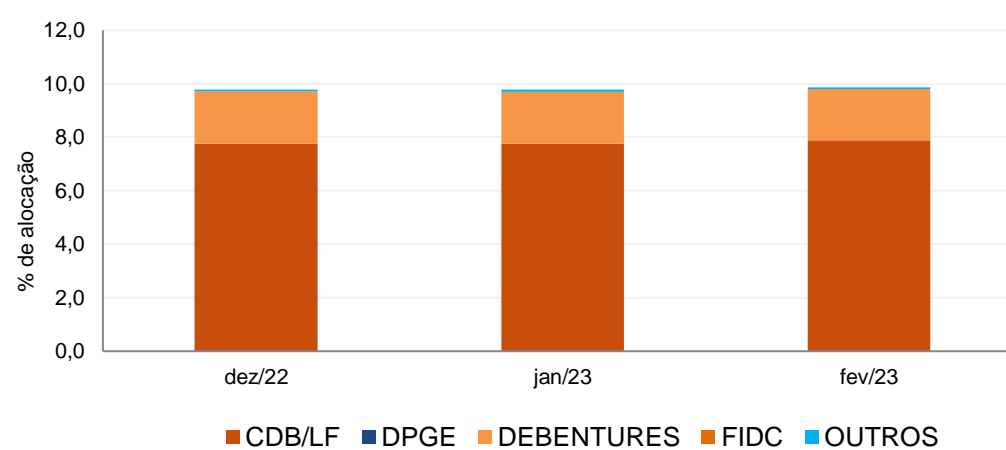
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	69.145,25	4,74	Faixa 1
VALE SA	35.561,14	2,44	Faixa 1
BCO SAFRA SA	18.146,77	1,24	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	17.287,68	1,19	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	16.877,16	1,16	Faixa 2
ITAUSA SA	13.123,10	0,90	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	12.176,64	0,83	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	10.905,74	0,75	Faixa 2
BCO ITAU SA	9.466,60	0,65	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	9.229,10	0,63	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
DASAA5	145,41	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	Faixa 1	Faixa 2	30-out-26	CDI	1,44%	URCA FI MULT CRED PRIV
DASAA5	306,34	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	Faixa 1	Faixa 2	30-out-26	CDI	1,43%	URCA FI MULT CRED PRIV
DASAA5	682,65	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	Faixa 1	Faixa 2	30-out-26	CDI	1,44%	URCA FI MULT CRED PRIV



ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 28/02/2023

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
LFT 2024-09-01	01-set-24	665.823	0,05%	Selic	13-fev-23	0,01%	0,00%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LFT 2025-03-01	01-mar-25	5.081.665	0,35%	Selic	10-fev-23	0,02%	0,02%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LFT 2025-09-01	01-set-25	309.763	0,02%	Selic	28-fev-23	5,00%	0,04%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LFT 2025-09-01	01-set-25	182.811	0,01%	Selic	27-fev-23	5,00%	0,05%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LFT 2026-03-01	01-mar-26	15.208	0,00%	Selic	27-fev-23	0,09%	0,00%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF

