

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	549.602.599,82	69,40%			1,06%	0,99%	3,52%	1,10%	8,94%	11,26%	16,75%	
Benchmark:	CDI				0,92%	3,20%	6,44%	2,05%	13,00%	19,38%	22,21%	
Renda Fixa CDI	275.141.802,22	34,74%		0,04%								
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	178.113.818,73	22,49%	ALFA	21,96%	0,01%	0,87%	3,23%	6,64%	2,02%	13,86%	20,91%	23,75%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	5.208.750,11	0,66%	BRADESCO	22,56%	0,00%	0,91%	3,16%	6,37%	2,03%	12,81%	19,03%	21,75%
URCA FI MULT CRED PRIV	91.819.233,38	11,59%	SANTANDER	21,39%	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	274.460.797,60	34,66%										
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RF	274.460.797,60	34,66%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				0,92%	3,20%	6,44%	2,05%	13,00%	19,38%	22,21%	
Renda Variável	161.853.481,64	20,44%			-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	134.763.591,59	17,02%		1,76%								
GRUMARI FIA	10.091.708,64	1,27%	AZ QUEST	16,48%	5,99%	-4,99%	-4,23%	-7,93%	-2,44%	-11,12%	-17,10%	-19,90%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	6.022.693,53	0,19%	BLACKROCK	0,04%	8,17%	-7,91%	-6,84%	-4,42%	-4,53%	-7,12%	-4,20%	0,80%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	23.452.210,80	2,96%	CONSTANCIA	16,48%	6,92%	-5,95%	-4,88%	-8,31%	-2,11%	-2,51%	2,23%	-6,74%
CONSTELLATION RESERVA FIA	2.902.150,46	0,37%	CONSTELLATION	16,48%	8,92%	-7,02%	-8,20%	-9,15%	-3,32%	-16,77%	-36,95%	-
FIA SÃO CONRADO	4.161.634,64	0,53%	EQUITAS	16,48%	16,11%	-0,26%	1,60%	-6,07%	9,30%	-15,89%	-30,01%	-33,95%
FIA ITACOATIARA	3.602.036,42	0,45%	INDIE CAPITAL	16,48%	9,97%	-8,16%	-8,97%	-10,96%	-4,88%	-20,09%	-36,08%	-
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	69.201.925,26	8,74%	SHARP	16,48%	7,97%	-7,93%	-6,45%	-3,50%	-4,10%	-2,09%	2,41%	13,14%
VINCI JOATINGA FIA	11.085.372,34	1,40%	VINCI	16,48%	8,40%	-6,23%	-7,84%	-8,29%	-3,18%	-12,93%	-13,03%	-11,86%
FIA PIPA	4.243.859,49	0,54%	XP	16,48%	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	27.089.890,05	3,42%										
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RV	27.089.890,05	3,42%		100%	-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX				-7,59%	-6,85%	-4,76%	-4,34%	-8,23%	-5,60%	0,93%	
Estruturado	46.714.520,84	5,90%			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	46.714.520,84	5,90%		1,12%								
NAVI LS ESTRUTURADO FIC FI MULT	15.184.190,99	1,92%	NAVI CAPITAL	2,81%	1,72%	0,93%	0,31%	4,32%	0,80%	16,13%	26,39%	29,72%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	2.907.975,32	0,37%	OCCAM	0,21%	2,26%	0,90%	1,25%	4,51%	1,01%	11,72%	15,25%	25,71%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	11.511.577,16	1,45%	OCCAM	0,76%	2,26%	0,90%	1,25%	4,51%	1,01%	11,73%	15,26%	25,76%
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	8.865.140,15	1,12%	QUANTITAS	3,90%		0,80%	3,25%	7,97%	1,59%	21,00%	29,55%	39,66%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	8.245.637,22	1,04%	ZEITGEIST	0,51%	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	26.450.040,37	3,34%			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	26.450.040,37	3,34%		3,65%								
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	26.450.040,37	3,34%	BLACKROCK	0,86%	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	11.684.552,64	1,48%			1,53%	3,71%	4,01%	2,55%	13,47%	34,85%	57,23%	
Benchmark:	INPC + 11.60% a.a.				1,56%	4,72%	8,11%	3,01%	17,65%	45,54%	72,30%	
Total	791.964.413,91	100%			2,27%	-0,67%	-0,51%	1,45%	0,23%	5,34%	7,56%	13,66%
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

* 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.

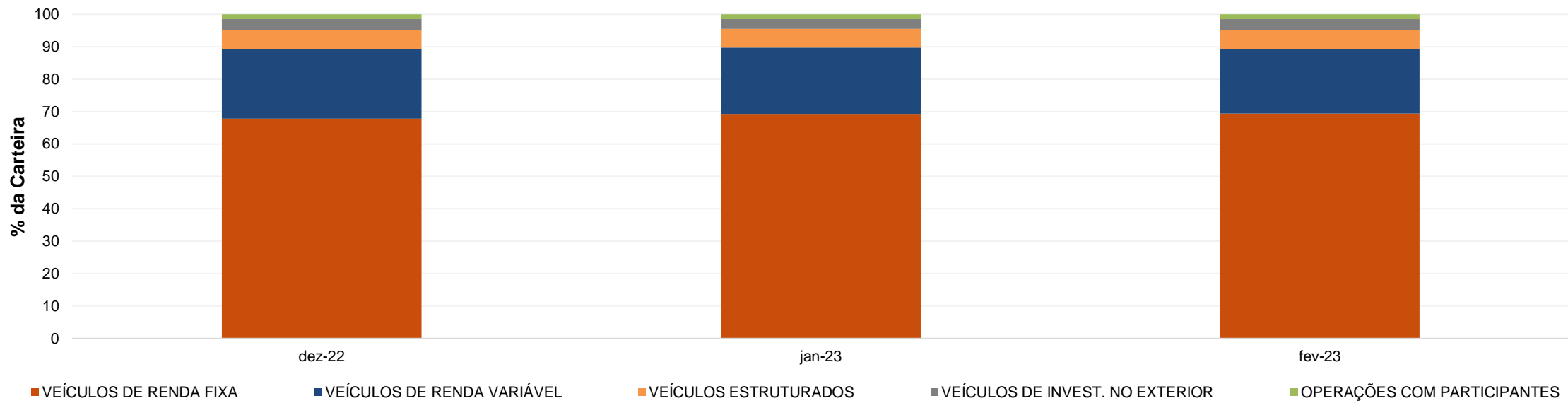
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

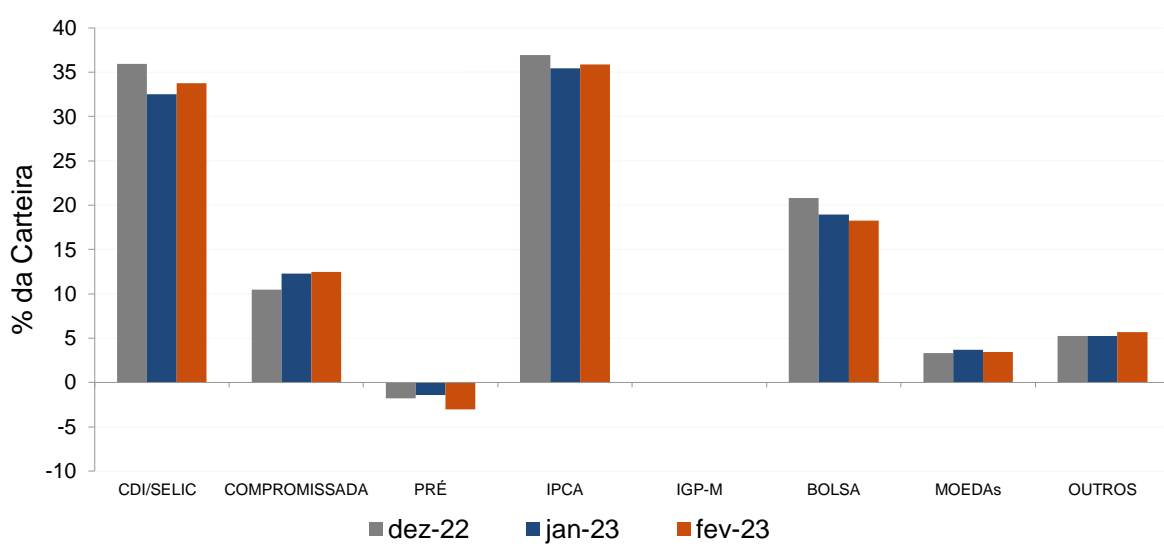
Distribuição da Carteira

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.

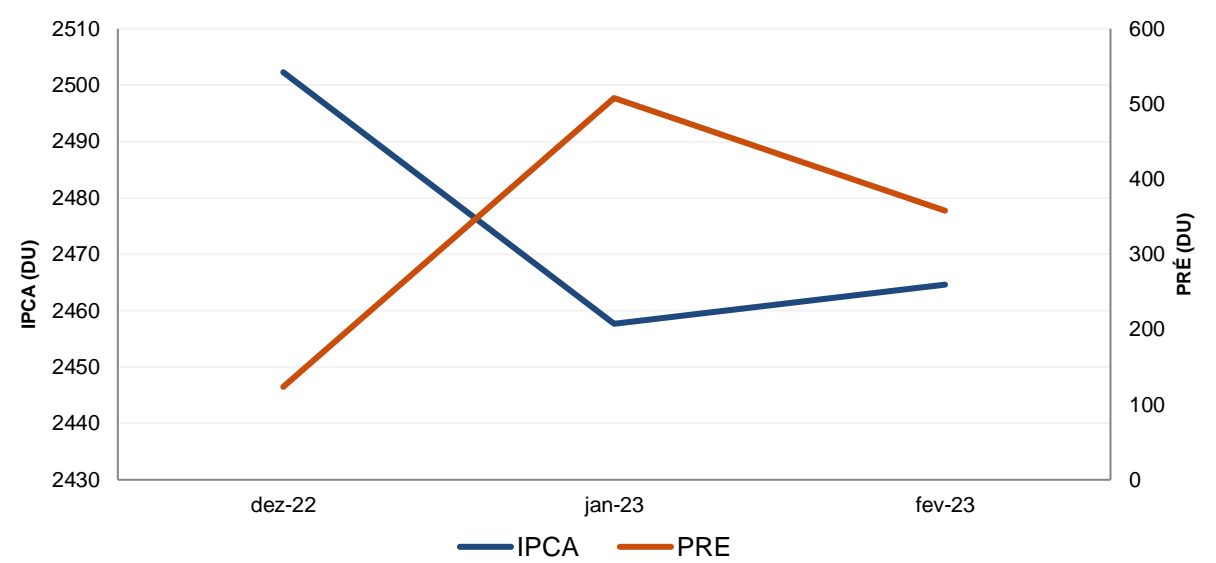
Evolução do Patrimônio Líquido



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	21.706,78	14,29	22.948,99	14,53
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	9.873,13	6,50	9.561,43	6,06
ITSA4	Intermediários Financeiros	7.491,20	4,93	7.524,71	4,77
EQTL3	Energia Elétrica	7.270,27	4,79	7.382,03	4,68
ITUB4	Intermediários Financeiros	5.573,82	3,67	5.377,02	3,41
PRIO3	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	5.541,56	3,65	6.950,70	4,40
ELET3	Energia Elétrica	5.197,04	3,42	6.112,59	3,87
RENT3	Diversos	5.095,53	3,35	5.187,08	3,29
BBAS3	Intermediários Financeiros	4.380,54	2,88	3.381,78	2,14
ASA13	Comércio e Distribuição	3.844,73	2,53	4.213,79	2,67

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

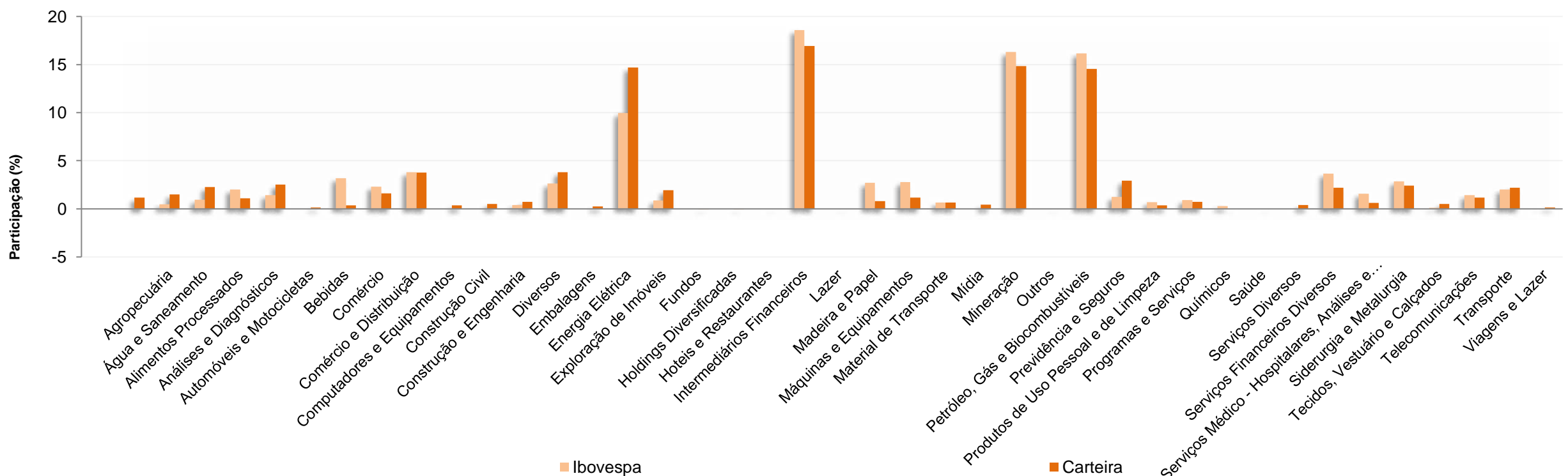
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
BRML3	3,86	0,00	0,00	Sem Liquidez
GETT11	0,00	0,00	0,00	Sem Liquidez
MTSA4	158,51	0,10	0,14	14
CRIV4	35,55	0,02	0,04	5
HBRE3	159,29	0,10	0,14	3
ALLD3	67,43	0,04	0,09	3
ELMD3	644,01	0,42	0,11	2
LAND3	351,34	0,23	0,05	2
WEST3	44,37	0,03	0,08	2
EALT4	40,40	0,03	0,08	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

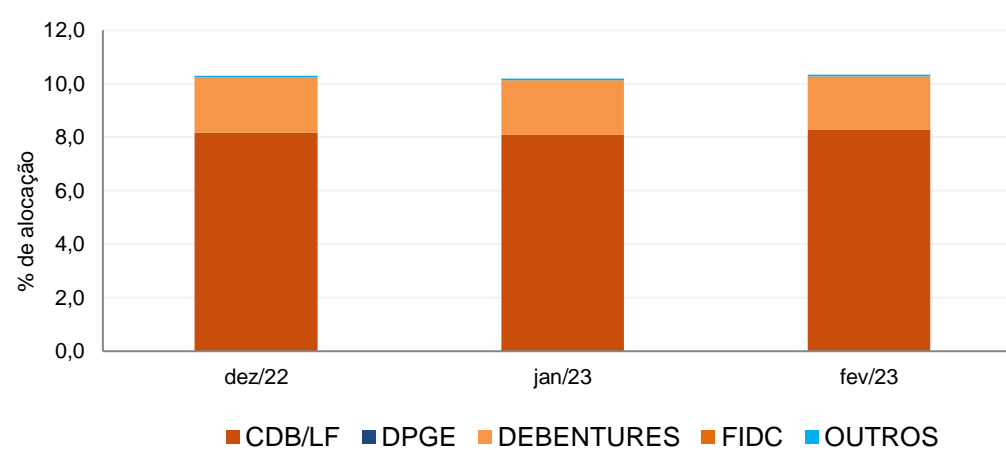
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	38.903,56	5,03	Faixa 1
VALE SA	21.706,78	2,80	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	10.114,67	1,31	Faixa 2
BCO SAFRA SA	10.097,92	1,30	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	9.619,87	1,24	Faixa 2
ITAUSA SA	7.905,87	1,02	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	7.270,27	0,94	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	6.446,05	0,83	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	5.573,97	0,72	Faixa 1
PETRO RIO SA	5.541,56	0,72	Faixa 2

* 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	170,46	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	Faixa 1	Faixa 2	30-out-26	CDI	1,43%	URCA FI MULT CRED PRIV
DASAA5	379,87	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	Faixa 1	Faixa 2	30-out-26	CDI	1,44%	URCA FI MULT CRED PRIV
DASAA5	80,92	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	Faixa 1	Faixa 2	30-out-26	CDI	1,44%	URCA FI MULT CRED PRIV



ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	370.503	0,05%	Selic	13-fev-23	0,01%	0,00%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LFT 2025-03-01	01-mar-25	2.827.735	0,37%	Selic	10-fev-23	0,02%	0,02%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LFT 2025-09-01	01-set-25	172.370	0,02%	Selic	28-fev-23	5,00%	0,04%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LFT 2025-09-01	01-set-25	101.727	0,01%	Selic	27-fev-23	5,00%	0,05%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LFT 2026-03-01	01-mar-26	8.463	0,00%	Selic	27-fev-23	0,09%	0,00%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	11.940	0,00%	IPCA	07-fev-23	6,43%	6,35%	ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA P

