

ELETROS - ELETROS PLANO CD I

Data-base: 30/12/2022

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	372.724.392,23	61,48%			-0,59%	-1,52%	0,87%	9,02%	9,02%		
Benchmark:	CDI				1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	252.627.149,84	41,67%									
ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA PROPRIA R	252.627.149,84	41,67%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
RF REFERENCIADO DI	120.097.242,39	19,81%									
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	74.881.707,52	12,35%	ALFA	10,35%	1,19%	3,36%	7,07%	13,48%	13,48%	18,85%	22,02%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	2.424.087,55	0,40%	BRADESCO	10,71%	1,11%	3,16%	6,52%	12,18%	12,18%	16,98%	20,12%
URCA FI MULT CRED PRIV	42.791.447,33	7,06%	SANTANDER	10,16%	1,18%	3,30%	7,02%	13,18%	13,18%	17,71%	21,07%
Benchmark:	CDI				1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
Renda Variável	124.104.889,58	20,47%			-2,74%	-2,60%	8,93%	3,03%	3,03%		
Benchmark:	IBrX + 2% a.a.				-2,46%	0,09%	11,44%	6,09%	6,09%	-3,89%	1,46%
RV ATIVO	77.048.895,11	12,71%									
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	51.828.966,20	8,55%	SHARP	11,83%	-2,44%	0,39%	13,67%	13,30%	13,30%	0,39%	9,22%
FIA SÃO CONRADO	2.734.582,85	0,45%	EQUITAS	11,83%	-7,05%	-12,44%	1,51%	-17,57%	-17,57%	-38,75%	-43,36%
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	17.207.311,21	2,84%	CONSTANCIA	11,83%	-2,83%	-5,09%	5,21%	2,33%	2,33%	-2,15%	-8,38%
FIA PIPA	3.121.984,08	0,51%	XP	11,83%	-1,56%	-4,57%	7,15%	11,93%	11,93%	-2,96%	-
CONSTELLATION RESERVA FIA	2.156.050,77	0,36%	CONSTELLATION	11,83%	-5,05%	-6,22%	5,04%	-13,84%	-13,84%	-36,01%	-
Benchmark:	IBOVESPA				-2,45%	-0,27%	11,36%	4,69%	4,69%	-7,80%	-5,11%
CARTEIRA PRÓPRIA RV	18.998.340,21	3,13%									
ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA PROPRIA R'	18.998.340,21	3,13%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	IBX				-2,63%	-0,39%	10,33%	4,02%	4,02%	-7,61%	-4,37%
RV VALOR	12.686.731,76	2,09%									
VINCI JOATINGA FIA	9.966.851,37	1,64%	VINCI	11,83%	-4,81%	-5,96%	5,02%	-4,05%	-4,05%	-15,50%	-12,81%
FIA ITACOATIARA	2.719.880,39	0,45%	INDIE CAPITAL	11,83%	-4,30%	-4,81%	7,90%	-16,94%	-16,94%	-35,89%	-
Benchmark:	IBOVESPA				-2,45%	-0,27%	11,36%	4,69%	4,69%	-7,80%	-5,11%
RV SMALL CAP	9.228.248,97	1,52%									
GRUMARI FIA	9.228.248,97	1,52%	AZ QUEST	11,83%	-1,83%	-3,55%	3,85%	-7,42%	-7,42%	-15,93%	-17,67%
Benchmark:	SMLL				-3,01%	-7,61%	5,76%	-15,06%	-15,06%	-28,82%	-29,28%
RV PASSIVO	6.142.673,53	1,01%									
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	6.142.673,53	1,01%	BLACKROCK	0,04%	-1,25%	2,07%	10,36%	5,11%	5,69%	-7,85%	-5,63%
Benchmark:	IBOVESPA				-2,45%	-0,27%	11,36%	4,69%	4,69%	-7,80%	-5,11%
Estruturado	27.307.313,26	4,50%			-1,01%	0,65%	4,01%	10,12%	10,12%		
Benchmark:	INPC + 10% a.a.				1,53%	3,96%	5,24%	16,48%	16,48%	41,09%	63,60%
MM MACRO	17.018.679,63	2,81%									
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	4.758.765,11	0,78%	QUANTITAS	2,09%	1,63%	5,38%	11,11%	23,49%	23,49%	28,96%	39,35%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	1.569.988,41	0,26%	OCCAM	0,11%	0,24%	1,55%	4,67%	11,69%	11,69%	15,44%	25,54%
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	6.215.036,81	1,03%	OCCAM	0,39%	0,24%	1,55%	4,66%	11,70%	11,70%	15,47%	25,41%
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	4.474.889,30	0,74%	ZEITGEIST	0,24%	-0,66%	-1,45%	0,61%	9,09%	9,09%	17,56%	28,29%
Benchmark:	CDI				1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
MM LONG-SHORT	8.214.728,20	1,35%									
NAVI LS ESTRUTURADO FIC FI MULT	8.214.728,20	1,35%	NAVI CAPITAL	1,53%	-0,49%	2,47%	7,36%	17,27%	17,27%	24,72%	27,71%
Benchmark:	CDI				1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%
FIP	2.073.905,42	0,34%									
SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES	2.073.905,42	0,34%	SIGNAL CAPITAL	2,09%	-12,29%	-16,42%	-16,89%	-18,24%	-18,24%	-45,16%	-44,80%
Benchmark:	IPCA				0,62%	1,63%	0,28%	5,79%	5,79%	16,43%	21,69%
Exterior	20.418.159,67	3,37%			-3,53%	5,53%	3,97%	-23,41%	-23,41%		
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-5,72%	5,60%	1,82%	-24,70%	-24,70%	-2,86%	42,85%
RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR	20.418.159,67	3,37%									
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	20.418.159,67	3,37%	BLACKROCK	0,62%	-2,17%	4,18%	3,45%	-23,35%	-24,43%	7,14%	59,97%
Benchmark:	MSCI WORLD (BRL)				-5,72%	5,60%	1,82%	-24,70%	-24,70%	-2,86%	42,85%
Operações com Participantes	17.497.157,33	2,89%			0,35%	-0,09%	1,52%	13,35%	13,35%		
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				1,42%	3,65%	4,60%	15,09%	15,09%	37,74%	57,80%
Imobiliário	43.518.439,92	7,18%			0,37%	1,25%	3,23%	5,25%	5,25%		
Benchmark:	INPC				0,69%	1,55%	0,30%	5,93%	5,93%	16,70%	23,05%
Total	606.269.037,50	100%			2,63%	-1,03%	-1,09%	3,20%	6,41%	6,41%	
Benchmark:	INPC + 4.5% a.a.				1,08%	2,65%	2,55%	10,68%	10,68%	27,39%	40,35%

* 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.

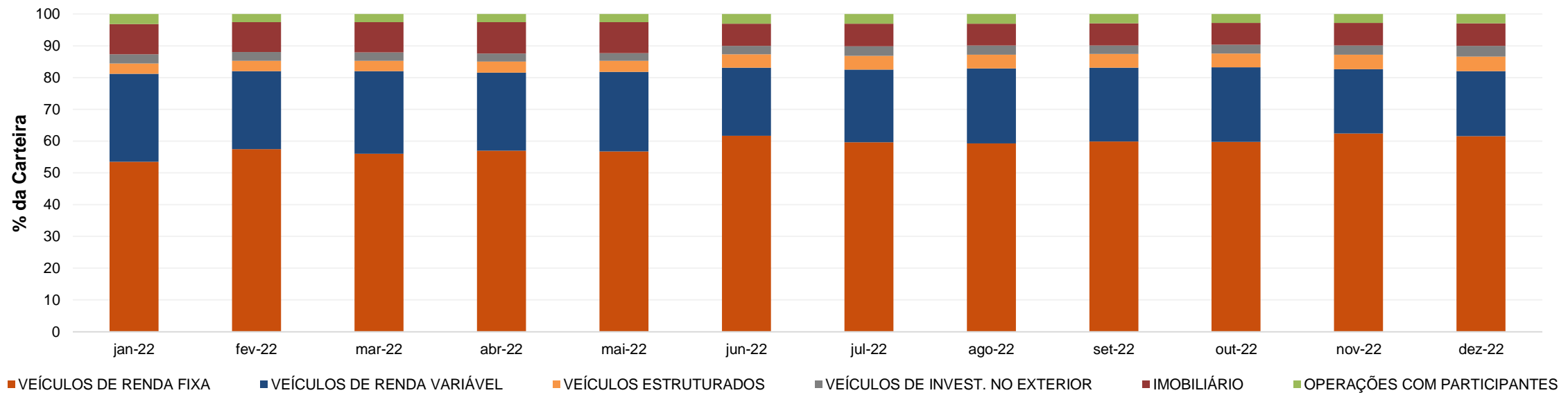
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

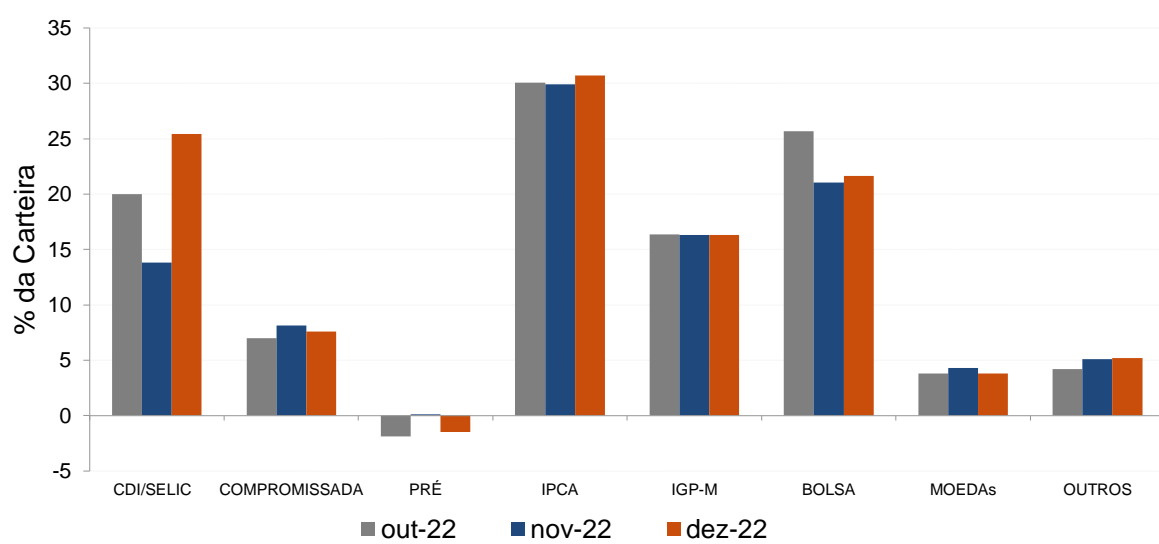
Distribuição da Carteira

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.

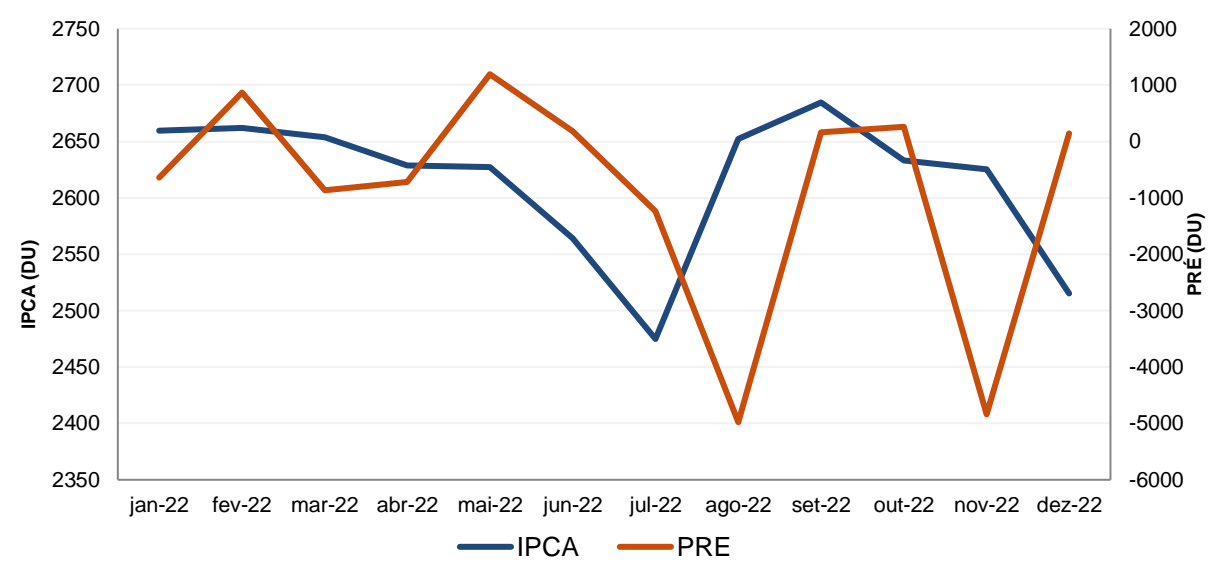
Evolução do Patrimônio Líquido



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	15.785,17	13,52	12.143,65	10,03
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	6.594,74	5,65	7.109,59	5,87
ITSA4	Intermediários Financeiros	5.806,89	4,97	6.702,13	5,54
EQTL3	Energia Elétrica	5.106,73	4,37	5.008,48	4,14
ELET3	Energia Elétrica	4.872,87	4,17	5.904,60	4,88
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	4.649,22	3,98	4.864,47	4,02
ITUB4	Intermediários Financeiros	4.618,98	3,95	3.498,85	2,89
BPAC11	Intermediários Financeiros	3.644,04	3,12	4.250,35	3,51
RENT3	Diversos	3.591,73	3,08	4.314,46	3,56
BBDC4	Intermediários Financeiros	3.360,02	2,88	3.201,33	2,64

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

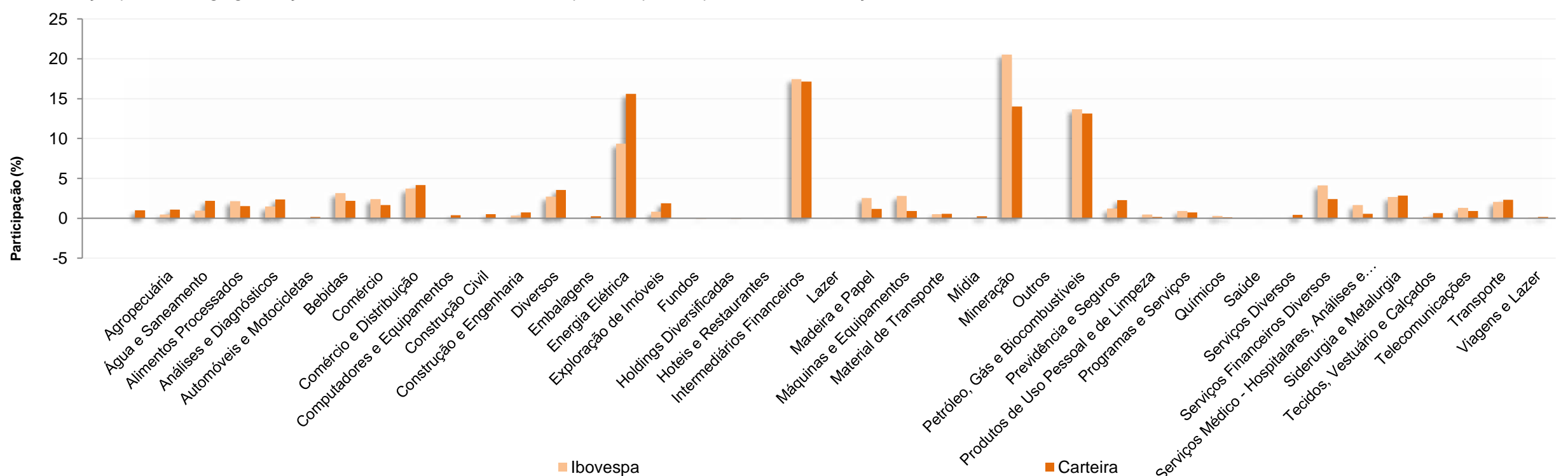
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	26,18	0,02	0,03	18
MTSA4	118,34	0,10	0,10	3
HBRE3	107,56	0,09	0,09	2
ALLD3	58,72	0,05	0,06	2
EALT4	28,01	0,02	0,06	2
VALE3	15.785,17	13,52	0,01	1
PETR4	6.594,74	5,65	0,01	1
ITSA4	5.806,89	4,97	0,01	1
EQTL3	5.106,73	4,37	0,02	1
ELET3	4.872,87	4,17	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 CD I

Data-base: 30/12/2022

Análises de Contrapartes

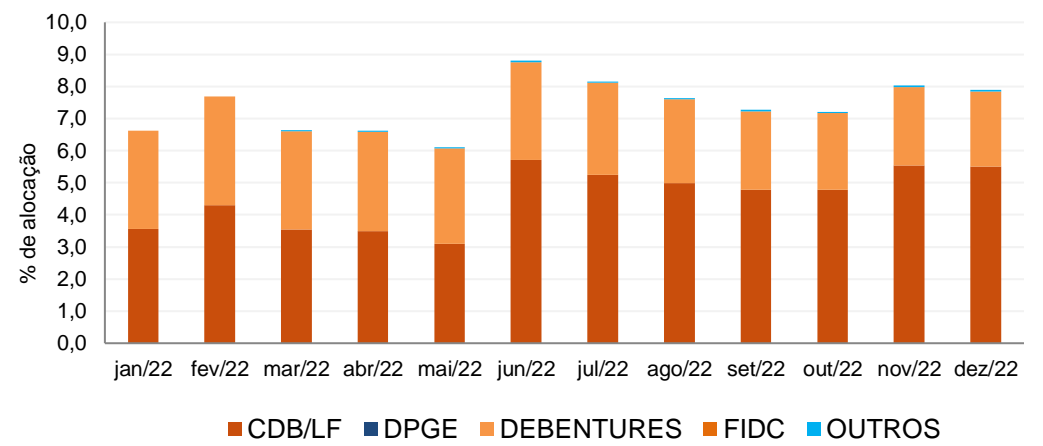
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
VALE SA	20.949,44	3,85	Faixa 1
BCO BRADESCO SA	19.868,37	3,65	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	6.373,98	1,17	Faixa 2
ITAUSA SA	5.999,77	1,10	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	5.613,69	1,03	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	5.106,73	0,94	Faixa 1
BCO SAFRA SA	4.778,91	0,88	Faixa 1
PETRO RIO SA	4.649,22	0,85	Faixa 2
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	4.619,06	0,85	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	4.552,00	0,84	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
Nenhuma mudança de faixa encontrada.								



ELETROS - ELETROS PLANO CD I

Data-base: 30/12/2022

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.

