

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

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 | 1.045.134.225,90 | 67,88% | | | -0,20% | 0,38% | 3,75% | 7,63% | 7,63% | 8,54% | 15,79% | |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,12% | 3,20% | 6,61% | 12,37% | 12,37% | 17,31% | 20,56% | |
| CARTEIRA PRÓPRIA RF | 592.446.299,17 | 38,48% | | | | | | | | | | |
| ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF | 592.446.299,17 | 38,48% | | 100% | - | - | - | - | - | - | - | |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,12% | 3,20% | 6,61% | 12,37% | 12,37% | 17,31% | 20,56% | |
| RF REFERENCIADO DI | 452.687.926,73 | 29,40% | | | | | | | | | | |
| ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP | 282.254.981,47 | 18,33% | ALFA | 39,03% | 1,19% | 3,36% | 7,07% | 13,48% | 13,48% | 18,85% | 22,02% | |
| BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV | 9.137.222,00 | 0,59% | BRADESCO | 40,37% | 1,11% | 3,16% | 6,52% | 12,18% | 12,18% | 16,98% | 20,12% | |
| URCA FI MULT CRED PRIV | 161.295.723,25 | 10,48% | SANTANDER | 38,28% | 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 | 281.874.386,42 | 18,31% | | | -2,74% | -2,60% | 8,93% | 3,03% | 3,03% | -8,38% | -6,60% | |
| Benchmark: | IBrX + 2% a.a. | | | | -2,46% | 0,09% | 11,44% | 6,09% | 6,09% | -3,89% | 1,46% | |
| RV ATIVO | 174.998.020,02 | 11,37% | | | | | | | | | | |
| SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA | 117.717.021,79 | 7,65% | SHARP | 26,88% | -2,44% | 0,39% | 13,67% | 13,30% | 13,30% | 0,39% | 9,22% | |
| FIA SÃO CONRADO | 6.210.946,74 | 0,40% | EQUITAS | 26,88% | -7,05% | -12,44% | 1,51% | -17,57% | -17,57% | -38,75% | -43,36% | |
| FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS | 39.082.265,72 | 2,54% | CONSTANCIA | 26,88% | -2,83% | -5,09% | 5,21% | 2,33% | 2,33% | -2,15% | -8,38% | |
| FIA PIPA | 7.090.835,40 | 0,46% | XP | 26,88% | -1,56% | -4,57% | 7,15% | 11,93% | 11,93% | -2,96% | - | |
| CONSTELLATION RESERVA FIA | 4.896.950,37 | 0,32% | CONSTELLATION | 26,88% | -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 | 43.150.157,94 | 2,80% | | | | | | | | | | |
| ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RV | 43.150.157,94 | 2,80% | | 100% | - | - | - | - | - | - | - | |
| Benchmark: | IBX | | | | -2,63% | -0,39% | 10,33% | 4,02% | 4,02% | -7,61% | -4,37% | |
| RV VALOR | 28.814.857,56 | 1,87% | | | | | | | | | | |
| VINCI JOATINGA FIA | 22.637.303,92 | 1,47% | VINCI | 26,88% | -4,81% | -5,96% | 5,02% | -4,05% | -4,05% | -15,50% | -12,81% | |
| FIA ITACOATIARA | 6.177.553,64 | 0,40% | INDIE CAPITAL | 26,88% | -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 | 20.959.746,36 | 1,36% | | | | | | | | | | |
| GRUMARI FIA | 20.959.746,36 | 1,36% | AZ QUEST | 26,88% | -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 | 13.951.604,54 | 0,91% | | | | | | | | | | |
| ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE | 13.951.604,54 | 0,91% | BLACKROCK | 0,09% | -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 | 88.076.233,68 | 5,72% | | | 0,05% | 1,91% | 5,81% | 14,32% | 14,32% | 18,46% | 19,97% | |
| Benchmark: | INPC + 10% a.a. | | | | 1,53% | 3,96% | 5,24% | 16,48% | 16,48% | 41,09% | 63,60% | |
| MM MACRO | 59.403.042,75 | 3,86% | | | | | | | | | | |
| QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP | 16.610.285,48 | 1,08% | QUANTITAS | 7,30% | 1,63% | 5,38% | 11,11% | 23,49% | 23,49% | 28,96% | 39,35% | |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT | 5.479.983,81 | 0,36% | OCCAM | 0,39% | 0,24% | 1,55% | 4,67% | 11,69% | 11,69% | 15,44% | 25,54% | |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI | 21.693.345,52 | 1,41% | OCCAM | 1,36% | 0,24% | 1,55% | 4,66% | 11,70% | 11,70% | 15,47% | 25,41% | |
| GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT | 15.619.427,94 | 1,01% | ZEITGEIST | 0,82% | -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 | 28.673.190,93 | 1,86% | | | | | | | | | | |
| NAVI LS ESTRUTURADO FIC FI MULT | 28.673.190,93 | 1,86% | NAVI CAPITAL | 5,35% | -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% | |
| Exterior | 51.451.925,88 | 3,34% | | | -3,53% | 5,53% | 3,97% | -23,41% | -23,41% | 6,82% | 18,20% | |
| Benchmark: | MSCI WORLD (BRL) | | | | -5,72% | 5,60% | 1,82% | -24,70% | -24,70% | -2,86% | 42,85% | |
| RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 51.451.925,88 | 3,34% | | | | | | | | | | |
| ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE | 51.451.925,88 | 3,34% | BLACKROCK | 1,57% | -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 | 26.030.162,42 | 1,69% | | | 0,65% | -2,85% | 0,83% | 10,50% | 10,50% | 30,82% | 46,49% | |
| Benchmark: | INPC + 8.68% a.a. | | | | 1,42% | 3,65% | 4,60% | 15,09% | 15,09% | 37,74% | 57,80% | |
| Imobiliário | 45.476.477,43 | 2,95% | | | 0,37% | 1,25% | 3,23% | 5,74% | 5,74% | 15,99% | 41,55% | |
| Benchmark: | INPC | | | | 0,69% | 1,55% | 0,30% | 5,93% | 5,93% | 16,70% | 23,05% | |
| Total | 1.539.627.922,30 | 100% | | | 2,41% | -0,71% | 0,12% | 4,97% | 6,61% | 6,61% | 5,65% | 12,74% |
| Benchmark: | INPC + 4.8% a.a. | | | | 1,10% | 2,73% | 2,70% | 11,00% | 11,00% | 28,12% | 41,56% | |

* 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.

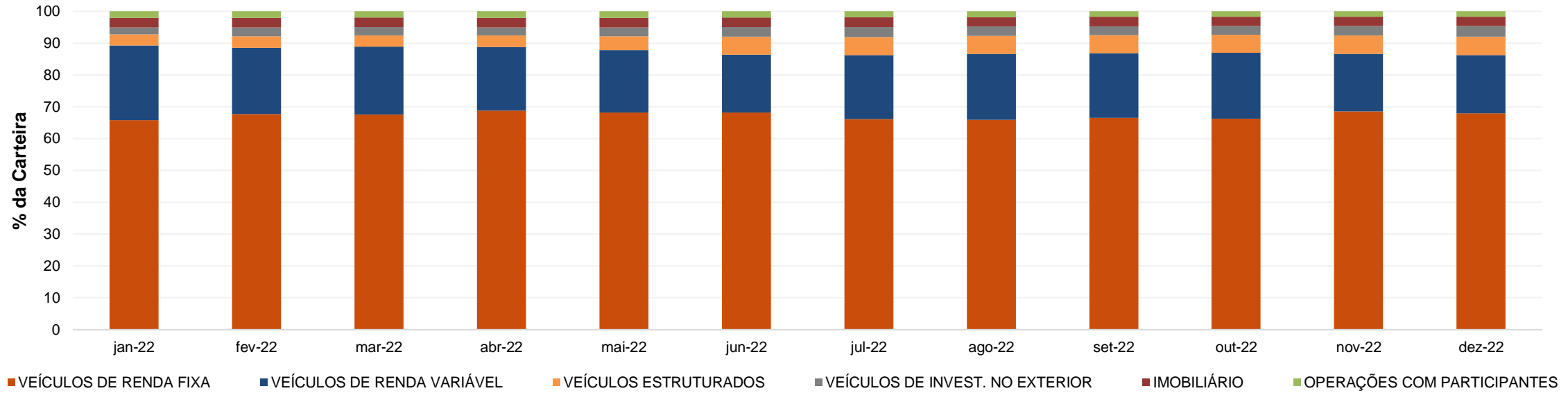
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

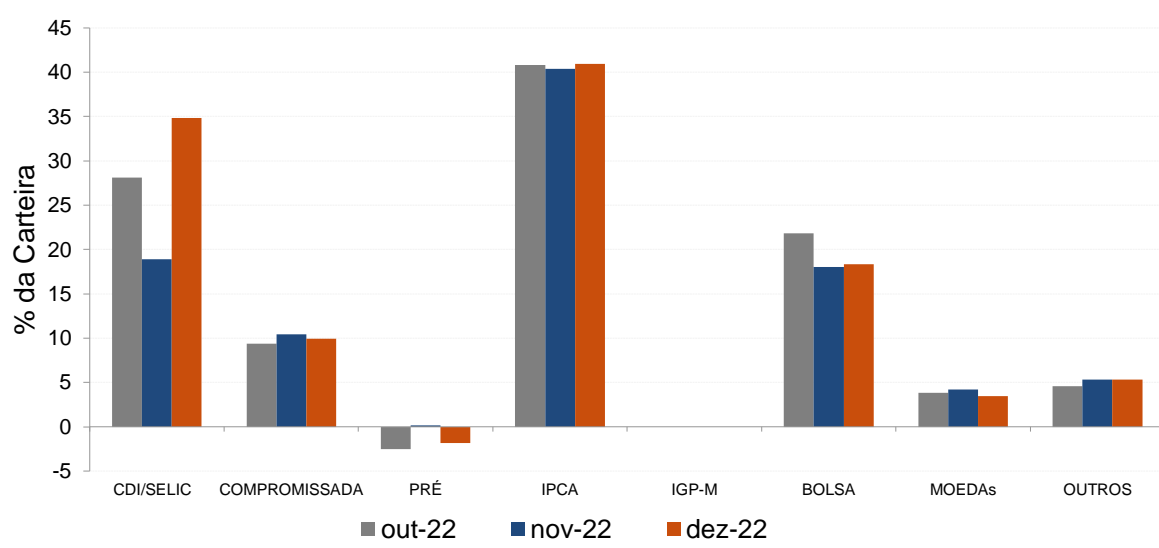
Distribuição da Carteira

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.

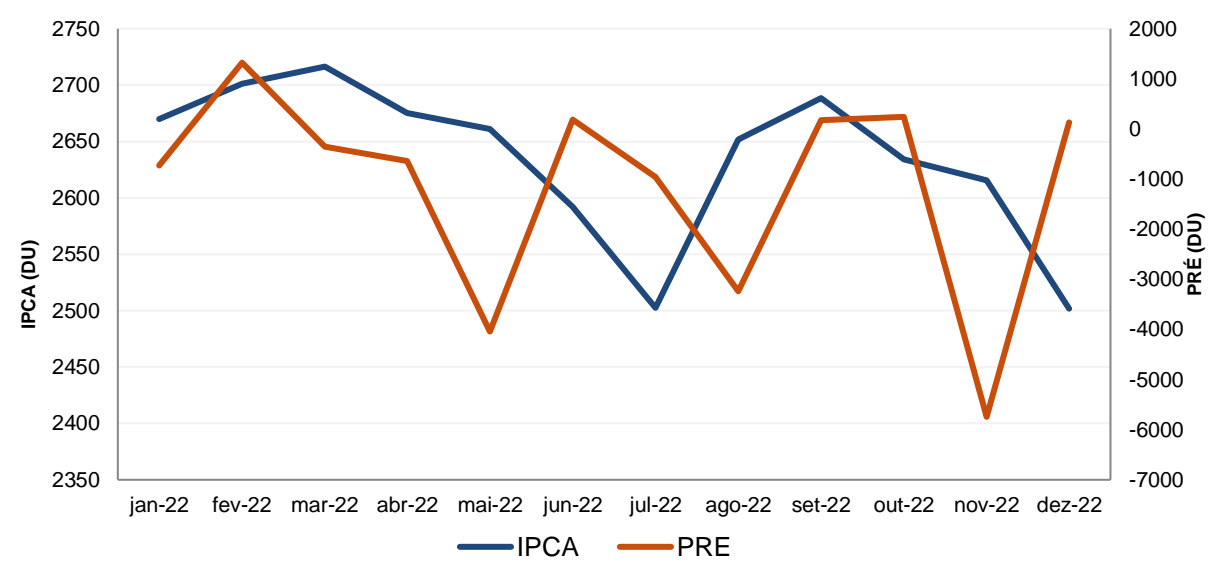
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | 35.539,03 | 13,40 | 27.727,95 | 9,95 |
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 15.668,07 | 5,91 | 17.287,03 | 6,20 |
| ITSA4 | Intermediários Financeiros | 13.501,86 | 5,09 | 15.530,50 | 5,57 |
| EQTL3 | Energia Elétrica | 12.259,86 | 4,62 | 11.972,61 | 4,29 |
| ELET3 | Energia Elétrica | 11.585,10 | 4,37 | 14.033,58 | 5,03 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 10.970,51 | 4,14 | 8.654,98 | 3,10 |
| PRI03 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 10.554,28 | 3,98 | 11.081,81 | 3,97 |
| BPAC11 | Intermediários Financeiros | 8.376,00 | 3,16 | 9.914,29 | 3,56 |
| RENT3 | Diversos | 8.087,25 | 3,05 | 9.940,77 | 3,57 |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 7.461,65 | 2,81 | 7.072,99 | 2,54 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

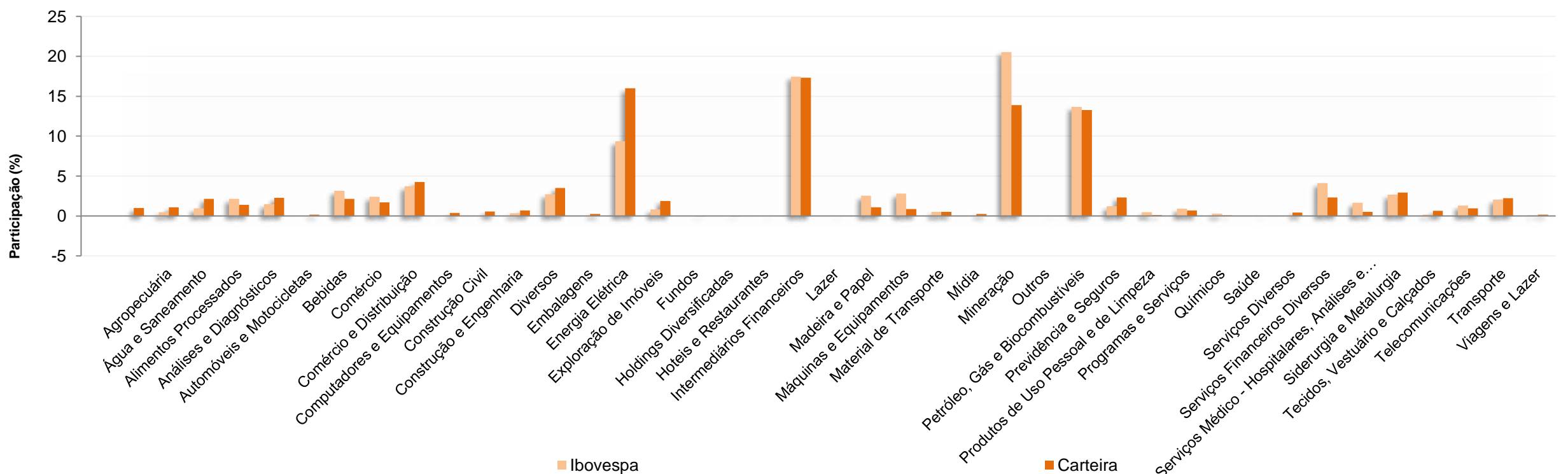
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|-------|--------|------|--------------|--------------------|
| CRIV4 | 59,47 | 0,02 | 0,07 | 39 |
| MTSA4 | 268,77 | 0,10 | 0,24 | 7 |
| HBRE3 | 244,29 | 0,09 | 0,21 | 4 |
| ALLD3 | 133,36 | 0,05 | 0,14 | 3 |
| EALT4 | 63,63 | 0,02 | 0,14 | 3 |
| ELMD3 | 701,45 | 0,26 | 0,16 | 2 |
| LAND3 | 561,44 | 0,21 | 0,08 | 2 |
| EMAE4 | 85,03 | 0,03 | 0,02 | 2 |
| SCAR3 | 79,15 | 0,03 | 0,04 | 2 |
| CLSC4 | 53,56 | 0,02 | 0,02 | 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.



ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 30/12/2022

Análises de Contrapartes

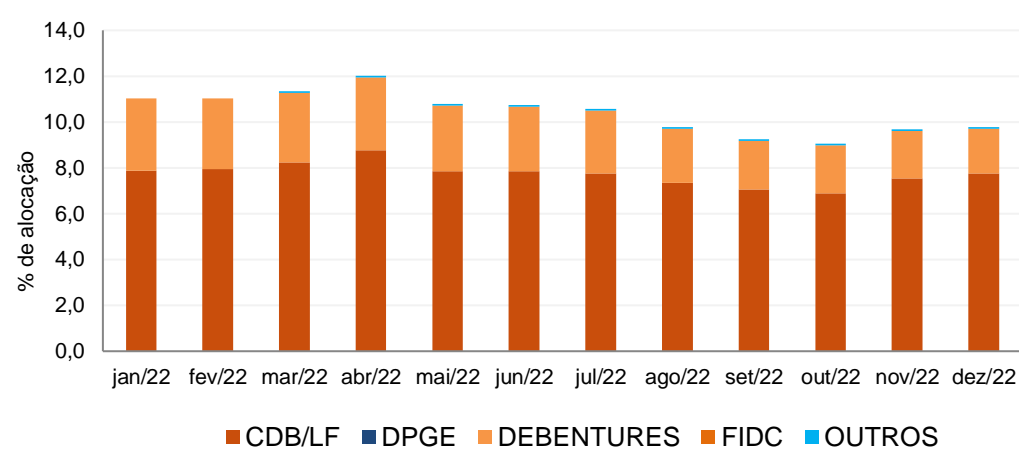
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|---|-----------|------|---------------------------|
| BCO BRADESCO SA | 69.259,03 | 4,75 | Faixa 1 |
| VALE SA | 35.539,03 | 2,44 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 18.013,37 | 1,23 | Faixa 1 |
| BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA | 17.158,04 | 1,18 | Faixa 2 |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 14.456,35 | 0,99 | Faixa 2 |
| ITAUSA SA | 14.228,90 | 0,98 | Faixa 2 |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE | 14.055,30 | 0,96 | Faixa 2 |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 12.259,86 | 0,84 | Faixa 1 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 10.970,79 | 0,75 | Faixa 1 |
| PETRO RIO SA | 10.554,28 | 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 |
|--------------------------------------|-----------------|-------------|----------------|-------------|-------|--------|------|---------|
| Nenhuma mudança de faixa encontrada. | | | | | | | | |



ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

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.

