

ELETROS - ELETROS PLANO CV ONS

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	533.551.829,92	67,76%			-0,10%	0,57%	3,96%	7,91%	7,91%	9,03%	16,19%	
Benchmark:	CDI				1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	281.824.578,64	35,79%										
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RF	281.824.578,64	35,79%	100%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				1,12%	3,20%	6,61%	12,37%	12,37%	17,31%	20,56%	
RF REFERENCIADO DI	251.727.251,28	31,97%										
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	156.954.198,36	19,93%	ALFA	21,70%	1,19%	3,36%	7,07%	13,48%	13,48%	18,85%	22,02%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	5.080.956,75	0,65%	BRADESCO	22,45%	1,11%	3,16%	6,52%	12,18%	12,18%	16,98%	20,12%	
URCA FI MULT CRED PRIV	89.692.096,17	11,39%	SANTANDER	21,29%	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	168.762.132,30	21,43%			-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	104.773.758,96	13,31%										
SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA	70.478.825,22	8,95%	SHARP	16,09%	-2,44%	0,39%	13,67%	13,30%	13,30%	0,39%	9,22%	
FIA SÃO CONRADO	3.718.580,57	0,47%	EQUITAS	16,09%	-7,05%	-12,44%	1,51%	-17,57%	-17,57%	-38,75%	-43,36%	
FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS	23.399.098,39	2,97%	CONSTANCIA	16,09%	-2,83%	-5,09%	5,21%	2,33%	2,33%	-2,15%	-8,38%	
FIA PIPA	4.245.382,20	0,54%	XP	16,09%	-1,56%	-4,57%	7,15%	11,93%	11,93%	-2,96%	-	
CONSTELLATION RESERVA FIA	2.931.872,59	0,37%	CONSTELLATION	16,09%	-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	25.834.602,18	3,28%										
ELETROS PLANO CV O N S CARTEIRA PROPRIA RV	25.834.602,18	3,28%	100%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	IBX				-2,63%	-0,39%	10,33%	4,02%	4,02%	-7,61%	-4,37%	
RV VALOR	17.251.857,71	2,19%										
VINCI JOATINGA FIA	13.553.270,06	1,72%	VINCI	16,09%	-4,81%	-5,96%	5,02%	-4,05%	-4,05%	-15,50%	-12,81%	
FIA ITACOATIARA	3.698.587,65	0,47%	INDIE CAPITAL	16,09%	-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	12.548.892,91	1,59%										
GRUMARI FIA	12.548.892,91	1,59%	AZ QUEST	16,09%	-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	8.353.020,55	1,06%										
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	8.353.020,55	1,06%	BLACKROCK	0,05%	-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	46.270.670,35	5,88%			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	31.207.267,77	3,96%										
QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP	8.726.179,72	1,11%	QUANTITAS	3,84%	1,63%	5,38%	11,11%	23,49%	23,49%	28,96%	39,35%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT	2.878.898,36	0,37%	OCCAM	0,20%	0,24%	1,55%	4,67%	11,69%	11,69%	15,44%	25,54%	
OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI	11.396.554,98	1,45%	OCCAM	0,71%	0,24%	1,55%	4,66%	11,70%	11,70%	15,47%	25,41%	
GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT	8.205.634,72	1,04%	ZEITGEIST	0,43%	-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	15.063.402,58	1,91%										
NAVI LS ESTRUTURADO FIC FI MULT	15.063.402,58	1,91%	NAVI CAPITAL	2,81%	-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	25.954.078,78	3,30%			-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	25.954.078,78	3,30%										
ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE	25.954.078,78	3,30%	BLACKROCK	0,79%	-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	11.931.374,99	1,52%										
Benchmark:	INPC + 8.68% a.a.				1,42%	3,65%	4,60%	15,09%	15,09%	37,74%	57,80%	
Total	787.419.910,18	100%			2,51%	-0,74%	0,17%	5,32%	6,80%	6,80%	5,33%	11,83%
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.

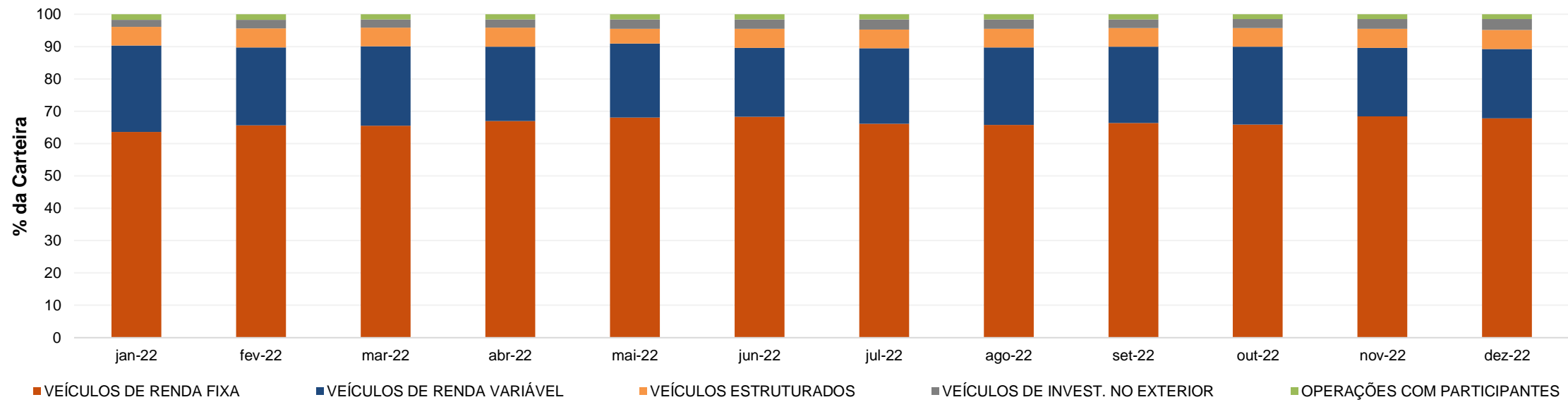
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

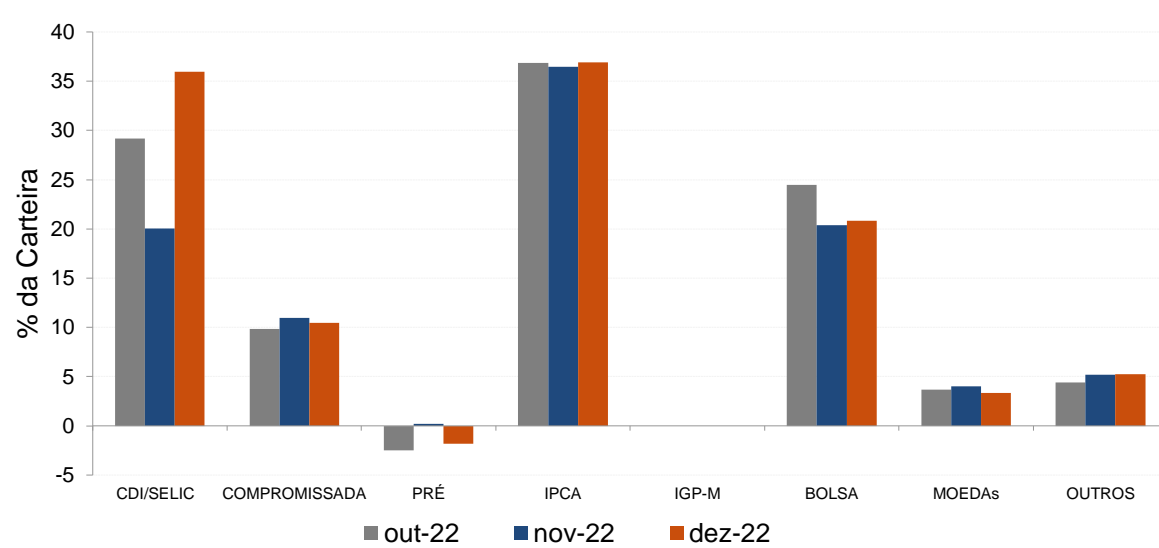
Distribuição da Carteira

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.

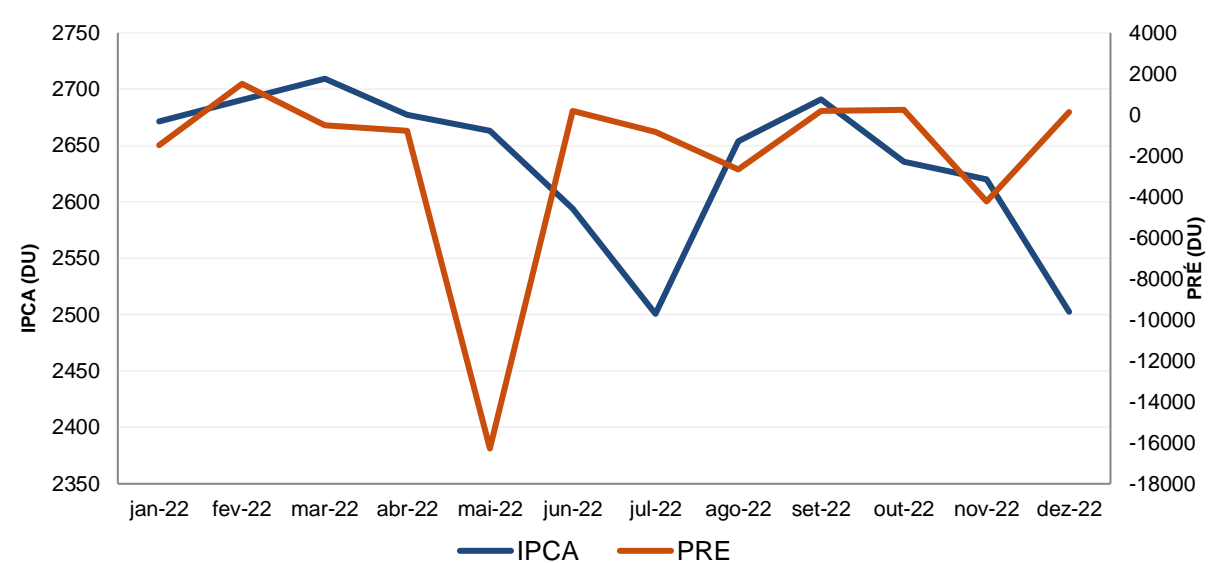
Evolução do Patrimônio Líquido



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	21.343,49	13,44	16.486,56	9,97
PETR4	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	9.235,83	5,82	10.067,67	6,09
ITSA4	Intermediários Financeiros	8.018,03	5,05	9.188,66	5,56
EQTL3	Energia Elétrica	7.201,28	4,54	7.011,28	4,24
ELET3	Energia Elétrica	6.827,45	4,30	8.233,73	4,98
ITUB4	Intermediários Financeiros	6.467,46	4,07	5.012,78	3,03
PRI03	Petróleo, Gás e Biocombustíveis	6.320,11	3,98	6.594,13	3,99
BPAC11	Intermediários Financeiros	4.993,94	3,15	5.852,95	3,54
RENT3	Diversos	4.856,76	3,06	5.892,70	3,57
BBDC4	Intermediários Financeiros	4.503,06	2,84	4.252,87	2,57

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

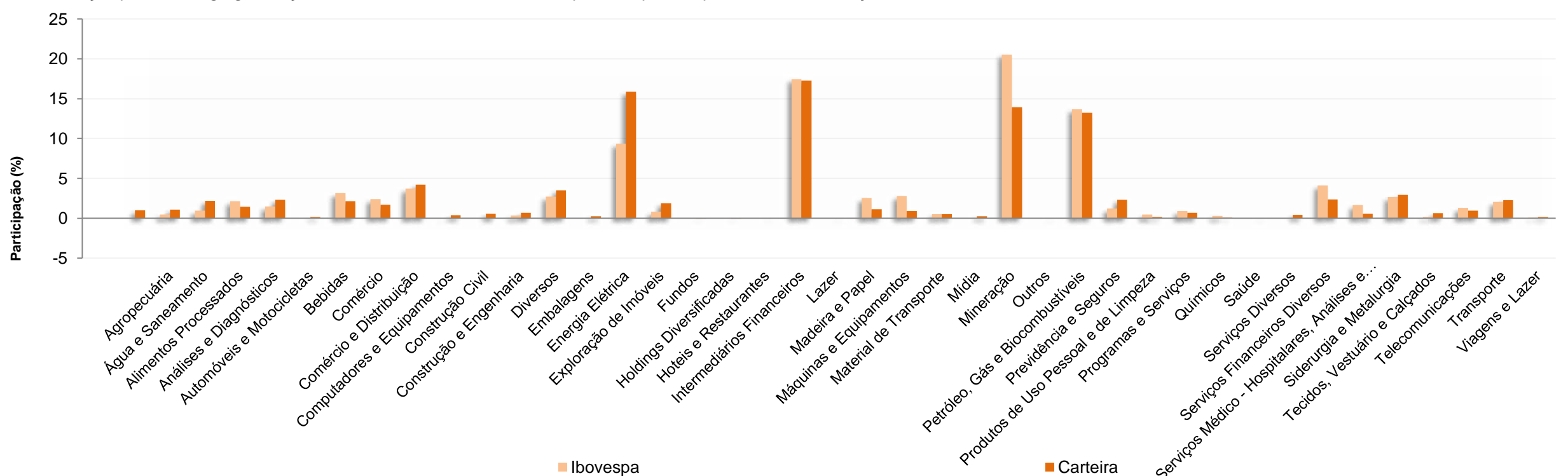
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

Nome	Valor*	%	% Free Float	Dias para Desmonte
CRIV4	35,61	0,02	0,04	24
MTSA4	160,92	0,10	0,14	4
HBRE3	146,26	0,09	0,13	2
ALLD3	79,85	0,05	0,08	2
EALT4	38,09	0,02	0,08	2
VALE3	21.343,49	13,44	0,01	1
PETR4	9.235,83	5,82	0,01	1
ITSA4	8.018,03	5,05	0,02	1
EQTL3	7.201,28	4,54	0,03	1
ELET3	6.827,45	4,30	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: 30/12/2022

Análises de Contrapartes

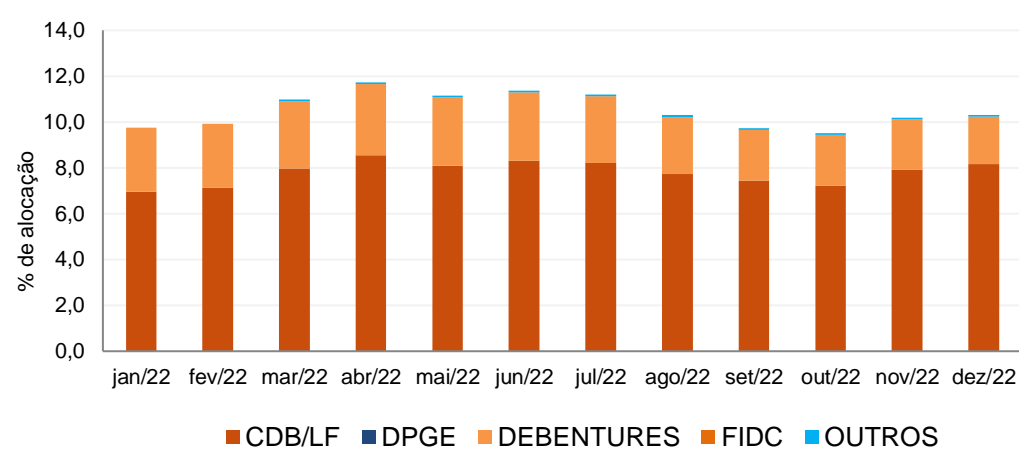
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	38.904,04	5,05	Faixa 1
VALE SA	21.343,49	2,77	Faixa 1
BCO SAFRA SA	10.016,74	1,30	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	9.541,11	1,24	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	8.659,55	1,12	Faixa 2
ITAUSA SA	8.422,31	1,09	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE	8.195,57	1,06	Faixa 2
EQUATORIAL ENERGIA SA	7.201,28	0,93	Faixa 1
ITAU UNIBANCO HOLDING SA	6.467,61	0,84	Faixa 1
PETRO RIO SA	6.320,11	0,82	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 CV ONS

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.

