

ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

Data-base: 31/08/2022

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 | 164.417.012,69 | 53,70% | | | 2,01% | 1,07% | 5,33% | 5,08% | 5,45% | 7,54% | 26,08% |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,17% | 3,25% | 6,16% | 7,74% | 10,20% | 13,18% | 17,57% |
| CARTEIRA PRÓPRIA RF | 93.020.387,37 | 30,38% | | | | | | | | | |
| ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA | 93.020.387,37 | 30,38% | 100% | | - | - | - | - | - | - | - |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,17% | 3,25% | 6,16% | 7,74% | 10,20% | 13,18% | 17,57% |
| RF REFERENCIADO DI | 71.396.625,32 | 23,32% | | | | | | | | | |
| ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP | 45.502.592,51 | 14,86% | ALFA | 6,14% | 1,22% | 3,53% | 6,76% | 8,56% | 11,31% | 14,41% | 18,69% |
| BRANCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV | 1.390.983,84 | 0,45% | BRANCO | 6,41% | 1,15% | 3,20% | 6,06% | 7,60% | 10,00% | 12,88% | 17,17% |
| URCA FI MULT CRED PRIV | 24.503.048,97 | 8,00% | SANTANDER | 6,05% | 1,34% | 3,41% | 6,46% | 8,33% | 10,60% | 13,45% | 18,01% |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,17% | 3,25% | 6,16% | 7,74% | 10,20% | 13,18% | 17,57% |
| Renda Variável | 83.734.009,91 | 27,35% | | | 6,84% | -0,14% | -1,00% | 6,07% | -7,00% | 10,33% | 3,66% |
| Benchmark: | IBrX + 2% a.a. | | | | 6,34% | -1,49% | -2,67% | 5,87% | -6,35% | 15,46% | 16,45% |
| RV ATIVO | 46.105.916,94 | 15,06% | | | | | | | | | |
| SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA | 30.186.545,74 | 9,86% | SHARP | 6,94% | 7,06% | 1,64% | 1,46% | 12,58% | -1,58% | 20,03% | 24,06% |
| FIA SAO CONRADO | 1.865.165,68 | 0,61% | EQUITAS | 6,94% | 10,66% | 0,00% | -10,45% | -4,08% | -30,93% | -18,96% | -24,65% |
| FIA CONSTANCIA CAMBOINHAS | 10.766.949,58 | 3,52% | CONSTANCIA | 6,94% | 7,07% | 0,01% | 6,33% | 9,24% | -0,12% | 17,78% | 18,39% |
| FIA PIPA | 1.942.562,98 | 0,63% | XP | 6,94% | 6,97% | 5,41% | 11,20% | 18,82% | 6,39% | 9,31% | - |
| CONSTELLATION RESERVA FIA | 1.344.692,96 | 0,44% | CONSTELLATION | 6,94% | 3,69% | -0,46% | -8,39% | -8,31% | -32,06% | - | - |
| Benchmark: | IBOVESPA | | | | 6,16% | -1,64% | -3,20% | 4,48% | -7,79% | 10,22% | 8,29% |
| CARTEIRA PRÓPRIA RV | 15.867.596,05 | 5,18% | | | | | | | | | |
| ELETROS PLANO CD SALDADO CARTEIRA PROPRIA | 15.867.596,05 | 5,18% | 100% | | - | - | - | - | - | - | - |
| Benchmark: | IBX | | | | 6,15% | -2,00% | -3,64% | 4,48% | -8,18% | 10,99% | 9,74% |
| RV VALOR | 10.018.661,17 | 3,27% | | | | | | | | | |
| VINCI JOATINGA FIA | 8.315.598,04 | 2,72% | VINCI | 6,94% | 5,95% | -1,89% | -5,05% | 1,29% | -10,34% | 5,40% | 10,83% |
| FIA ITACOATIARA | 1.703.063,13 | 0,56% | INDIE CAPITAL | 6,94% | 10,59% | -0,46% | -10,25% | -11,27% | -29,70% | -21,88% | - |
| Benchmark: | IBOVESPA | | | | 6,16% | -1,64% | -3,20% | 4,48% | -7,79% | 10,22% | 8,29% |
| RV SMALL CAP | 8.501.120,08 | 2,78% | | | | | | | | | |
| GRUMARI FIA | 8.501.120,08 | 2,78% | AZ QUEST | 6,94% | 6,01% | -1,55% | -3,47% | -1,90% | -13,58% | -1,89% | 4,00% |
| Benchmark: | SMLL | | | | 10,90% | -2,42% | -4,48% | -6,34% | -22,25% | -9,05% | -3,57% |
| RV PASSIVO | 3.240.715,68 | 1,06% | | | | | | | | | |
| ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE | 3.240.715,68 | 1,06% | BLACKROCK | 0,02% | 6,58% | -1,26% | -2,82% | 4,99% | -7,23% | 10,59% | 8,63% |
| Benchmark: | IBOVESPA | | | | 6,16% | -1,64% | -3,20% | 4,48% | -7,79% | 10,22% | 8,29% |
| Estruturado | 21.520.299,94 | 7,03% | | | 2,39% | 4,54% | 8,84% | 10,79% | 11,96% | 16,66% | |
| Benchmark: | INPC + 10% a.a. | | | | 0,56% | 2,19% | 8,03% | 11,52% | 19,71% | 45,35% | 64,58% |
| MM MACRO | 14.900.664,66 | 4,87% | | | | | | | | | |
| QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP | 3.734.241,56 | 1,22% | QUANTITAS | 1,73% | 2,90% | 4,69% | 12,06% | 16,19% | 16,61% | 24,87% | 33,10% |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO FC FI MULT | 1.265.454,71 | 0,41% | OCCAM | 0,08% | 1,13% | 2,14% | 6,90% | 7,95% | 8,66% | 10,83% | 23,60% |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADV FC FI MULT | 5.009.593,61 | 1,64% | OCCAM | 0,28% | 1,13% | 2,14% | 6,91% | 7,96% | 8,67% | 10,82% | - |
| PACIFICO MACRO FC FI MULT | 1.152.703,70 | 0,38% | PACIFICO | 0,91% | 1,70% | 2,99% | 3,51% | 4,27% | 3,60% | 4,29% | 9,73% |
| GIANT ZARATHUSTRA II FC FI MULT | 3.738.671,08 | 1,22% | ZEITGEIST | 0,19% | 1,59% | 1,18% | 7,64% | 9,29% | 14,33% | 18,51% | 34,75% |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,17% | 3,25% | 6,16% | 7,74% | 10,20% | 13,18% | 17,57% |
| MM LONG-SHORT | 6.619.635,28 | 2,16% | | | | | | | | | |
| NAVI LS ESTRUT FC DE FI MULT | 6.619.635,28 | 2,16% | NAVI CAPITAL | 1,28% | 3,92% | 8,98% | 11,32% | 13,32% | 14,65% | 21,67% | 26,31% |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,17% | 3,25% | 6,16% | 7,74% | 10,20% | 13,18% | 17,57% |
| Exterior | 11.508.153,76 | 3,76% | | | -3,62% | 5,36% | -7,86% | -23,17% | -11,21% | 8,35% | |
| Benchmark: | MSCI WORLD (BRL) | | | | -4,51% | 3,09% | -11,16% | -24,55% | -15,78% | 1,28% | 53,75% |
| RV INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 11.508.153,76 | 3,76% | | | | | | | | | |
| ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE | 11.508.153,76 | 3,76% | BLACKROCK | 0,38% | -3,62% | 5,36% | -7,94% | -23,01% | -11,02% | 9,10% | 74,69% |
| Benchmark: | MSCI WORLD (BRL) | | | | -4,51% | 3,09% | -11,16% | -24,55% | -15,78% | 1,28% | 53,75% |
| Operações com Participantes ** | 7.755.524,54 | 2,53% | | | 4,07% | 5,65% | 10,31% | 11,87% | 19,80% | 43,00% | |
| Benchmark: | INPC + 8.68% a.a. | | | | 0,45% | 1,87% | 7,37% | 10,62% | 18,27% | 41,89% | 58,74% |
| Imobiliário ** | 16.839.685,52 | 5,50% | | | 0,87% | 2,28% | 3,50% | 3,98% | 7,69% | 31,97% | |
| Benchmark: | INPC | | | | -0,31% | -0,29% | 2,93% | 4,65% | 8,83% | 20,17% | 23,70% |
| Total | 306.182.518,98 | 100% | | | 4,90% | 3,07% | 1,08% | 2,93% | 4,48% | 1,34% | 10,76% |
| Benchmark: | INPC + 4.8% a.a. | | | | 0,12% | 0,92% | 5,41% | 7,98% | 14,05% | 31,96% | 42,36% |

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

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 29/07/2022

* 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.

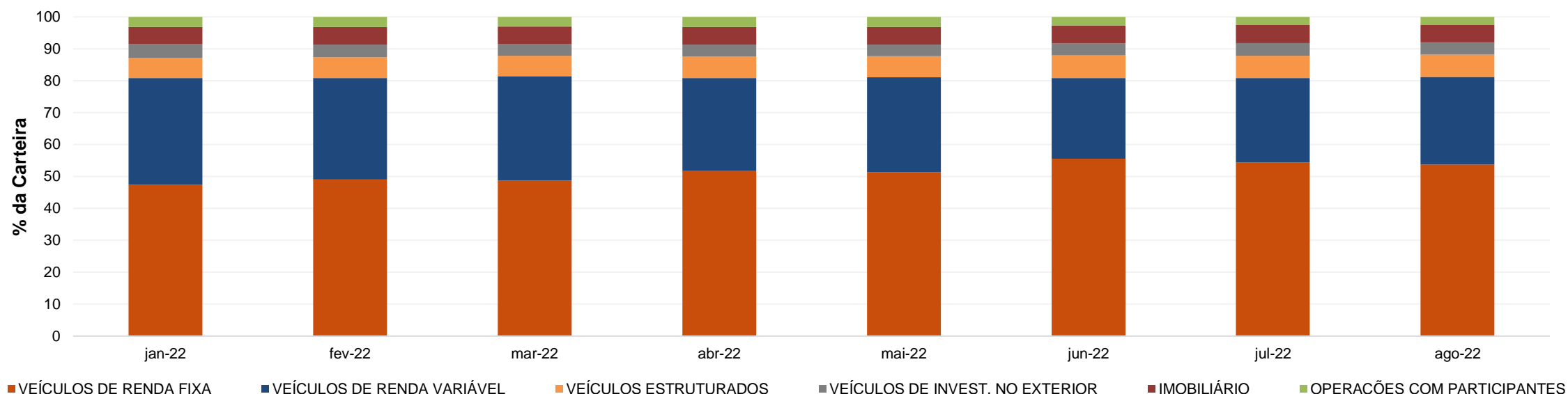
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

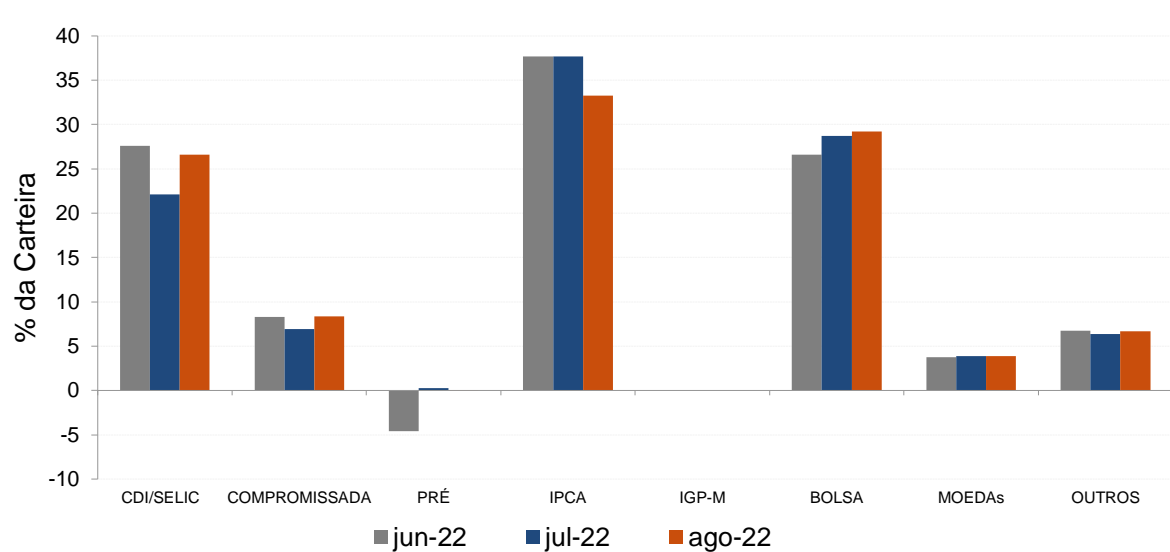
Distribuição da Carteira

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.

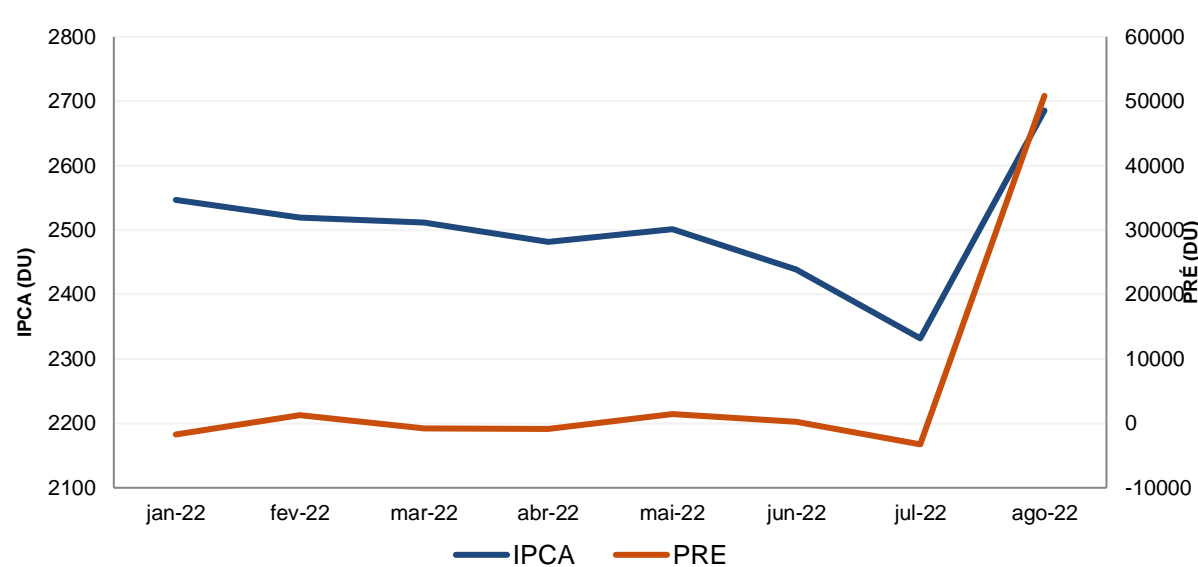
Evolução do Patrimônio Líquido



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* | % |
|--------|---------------------------------|----------|------|-----------|-------|
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 8.394,97 | 9,85 | 8.491,57 | 10,63 |
| VALE3 | Mineração | 7.490,15 | 8,79 | 7.720,41 | 9,67 |
| BPAC11 | Intermediários Financeiros | 3.632,70 | 4,26 | 2.933,23 | 3,67 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 3.619,81 | 4,25 | 3.035,98 | 3,80 |
| ELET3 | Energia Elétrica | 3.476,49 | 4,08 | 3.841,12 | 4,81 |
| EQTL3 | Energia Elétrica | 3.390,97 | 3,98 | 3.449,22 | 4,32 |
| ITSA4 | Intermediários Financeiros | 3.345,92 | 3,93 | 2.980,30 | 3,73 |
| RENT3 | Diversos | 3.104,46 | 3,64 | 2.545,28 | 3,19 |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 2.375,26 | 2,79 | 2.054,16 | 2,57 |
| VBBR3 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 2.218,31 | 2,60 | 1.760,26 | 2,20 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

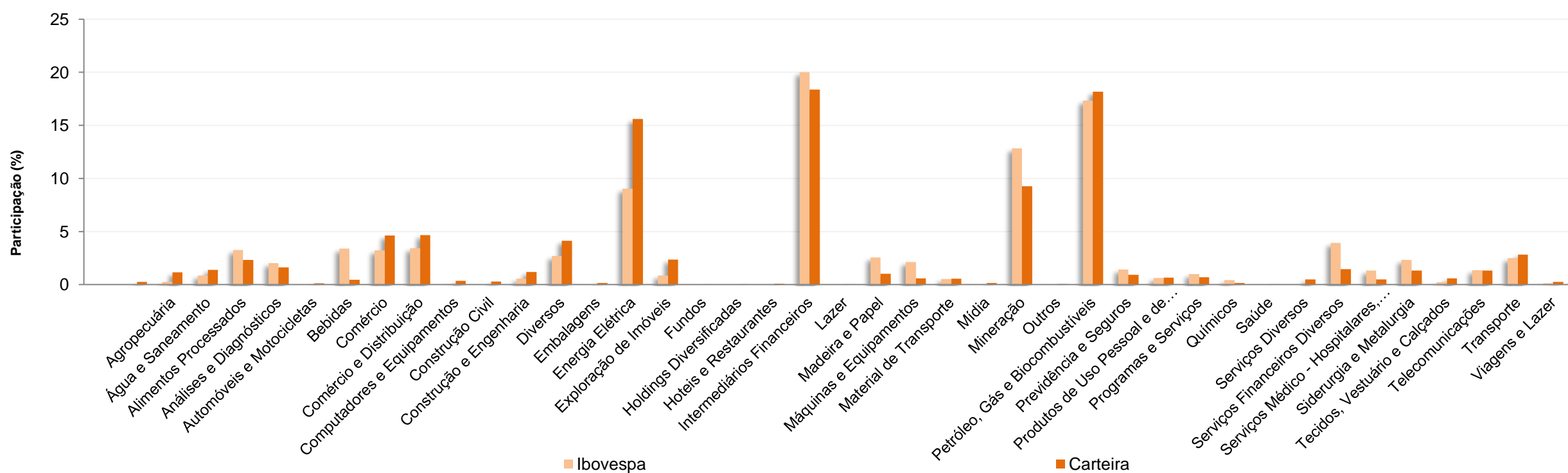
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|--------|----------|------|--------------|--------------------|
| CRIV4 | 15,35 | 0,02 | 0,02 | 14 |
| MTSA4 | 65,29 | 0,08 | 0,04 | 7 |
| SCAR3 | 29,26 | 0,03 | 0,00 | 3 |
| HBRE3 | 98,05 | 0,12 | 0,07 | 2 |
| PETR4 | 8.394,97 | 9,85 | 0,01 | 1 |
| VALE3 | 7.490,15 | 8,79 | 0,00 | 1 |
| BPAC11 | 3.632,70 | 4,26 | 0,00 | 1 |
| ITUB4 | 3.619,81 | 4,25 | 0,00 | 1 |
| ELET3 | 3.476,49 | 4,08 | 0,00 | 1 |
| EQTL3 | 3.390,97 | 3,98 | 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.



ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

Data-base: 31/08/2022

Análises de Contrapartes

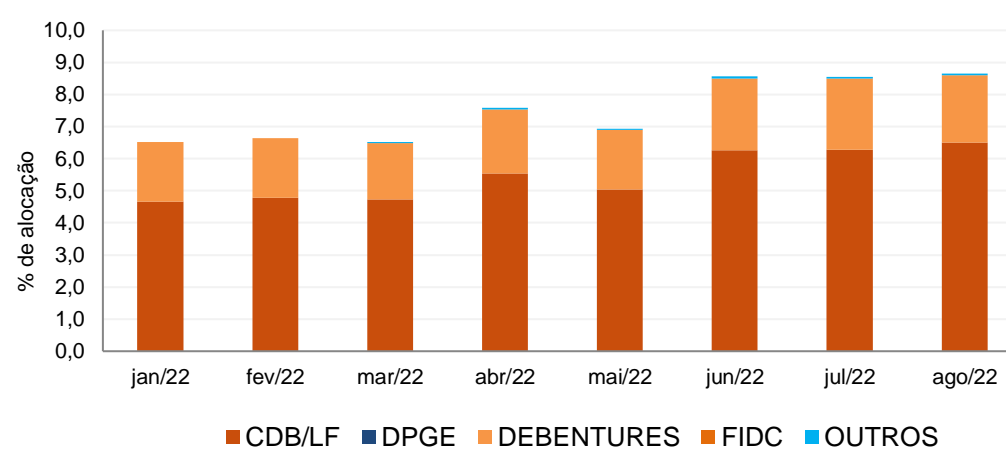
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|--|-----------|------|---------------------------|
| BCO BRADESCO SA | 12.190,77 | 4,34 | Faixa 1 |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 9.134,13 | 3,25 | Faixa 2 |
| VALE SA | 7.490,15 | 2,67 | Faixa 1 |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE | 3.937,19 | 1,40 | Faixa 2 |
| BCO BTG PACTUAL SA | 3.632,70 | 1,29 | Faixa 2 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 3.619,67 | 1,29 | Faixa 1 |
| ITAUSA INVESTS ITAU SA | 3.500,14 | 1,25 | Faixa 2 |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 3.390,97 | 1,21 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 3.379,09 | 1,20 | Faixa 1 |
| LOCALIZA RENT A CAR SA | 3.104,46 | 1,11 | 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 |
|--------------------------------------|-----------------|-------------|----------------|-------------|-------|--------|------|---------|
| Nenhuma mudança de faixa encontrada. | | | | | | | | |



ELETROS - ELETROS PLANO CD SALDADO

Data-base: 31/08/2022

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.

| Títulos Privados | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | Emissor | Data Compra | Tx de Compra | Faixa Atual | Veículo |
|------------------|------------|---------|-----------------|-----------|------------------------------------|-------------|--------------|-------------|------------------------------------|
| BSA316 | 05-ago-27 | 122.422 | 0,04% | CDI | B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO | 09-ago-22 | 1,30% | Faixa 1 | URCA FI MULT CRED PRIV |
| CSBR11 | 10-dez-25 | 26.283 | 0,01% | CDI | CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÔES | 04-ago-22 | 3,02% | Faixa 2 | ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP |
| ITSA15 | 08-ago-25 | 110.211 | 0,04% | CDI | ITAUSA INVESTS ITAU SA | 10-ago-22 | 1,12% | Faixa 2 | URCA FI MULT CRED PRIV |
| ITSA25 | 08-ago-25 | 44.009 | 0,02% | CDI | ITAUSA INVESTS ITAU SA | 10-ago-22 | 1,12% | Faixa 2 | URCA FI MULT CRED PRIV |

| Títulos Públicos | Vencimento | Valor | Valor (% Cart.) | Indexador | | Data Compra | Tx de Compra | Tx Ind. Anbima | Veículo |
|------------------|------------|-----------|-----------------|-----------|--|-------------|--------------|----------------|------------------------------------|
| LFT 2025-09-01 | 01-set-25 | 1.287.233 | 0,46% | Selic | | 03-ago-22 | 0,11% | 0,11% | ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP |



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.