

ELETROS - ELETROS PLANO BD

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 | 978.767.254,77 | 58,41% | | | 0,92% | -0,22% | -1,54% | 0,72% | 13,35% | 17,87% | 39,41% | |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,92% | 3,20% | 6,44% | 2,05% | 13,00% | 19,38% | 22,21% | |
| Renda Fixa CDI | 139.007.298,88 | 8,30% | | 0,04% | | | | | | | | |
| ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP | 89.986.765,50 | 5,37% | ALFA | 11,09% | 0,01% | 0,87% | 3,23% | 6,64% | 2,02% | 13,86% | 20,91% | 23,75% |
| BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV | 2.631.567,71 | 0,16% | BRADESCO | 11,40% | 0,00% | 0,91% | 3,16% | 6,37% | 2,03% | 12,81% | 19,03% | 21,75% |
| URCA FI MULT CRED PRIV | 46.388.965,67 | 2,77% | SANTANDER | 10,81% | 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 | 839.759.955,89 | 50,11% | | | | | | | | | | |
| ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RF | 839.759.955,89 | 50,11% | | 100% | - | - | - | - | - | - | - | |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,92% | 3,20% | 6,44% | 2,05% | 13,00% | 19,38% | 22,21% | |
| Renda Variável | 377.612.834,84 | 22,53% | | | -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 | 314.410.669,33 | 18,76% | | 1,76% | | | | | | | | |
| GRUMARI FIA | 23.544.496,15 | 1,41% | AZ QUEST | 38,44% | 5,99% | -4,99% | -4,23% | -7,93% | -2,44% | -11,12% | -17,10% | -19,90% |
| ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE | 14.051.266,81 | 0,21% | BLACKROCK | 0,10% | 8,17% | -7,91% | -6,84% | -4,42% | -4,53% | -7,12% | -4,20% | 0,80% |
| FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS | 54.715.262,44 | 3,27% | CONSTANCIA | 38,44% | 6,92% | -5,95% | -4,88% | -8,31% | -2,11% | -2,51% | 2,23% | -6,74% |
| CONSTELLATION RESERVA FIA | 6.770.872,27 | 0,40% | CONSTELLATION | 38,44% | 8,92% | -7,02% | -8,20% | -9,15% | -3,32% | -16,77% | -36,95% | - |
| FIA SÃO CONRADO | 9.709.316,26 | 0,58% | EQUITAS | 38,44% | 16,11% | -0,26% | 1,60% | -6,07% | 9,30% | -15,89% | -30,01% | -33,95% |
| FIA ITACOATIARA | 8.403.743,68 | 0,50% | INDIE CAPITAL | 38,44% | 9,97% | -8,16% | -8,97% | -10,96% | -4,88% | -20,09% | -36,08% | - |
| SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA | 161.451.793,78 | 9,64% | SHARP | 38,44% | 7,97% | -7,93% | -6,45% | -3,50% | -4,10% | -2,09% | 2,41% | 13,14% |
| VINCI JOATINGA FIA | 25.862.766,72 | 1,54% | VINCI | 38,44% | 8,40% | -6,23% | -7,84% | -8,29% | -3,18% | -12,93% | -13,03% | -11,86% |
| FIA PIPA | 9.901.151,22 | 0,59% | XP | 38,44% | 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 | 63.202.165,51 | 3,77% | | | | | | | | | | |
| ELETROS PLANO BD CARTEIRA PROPRIA RV | 63.202.165,51 | 3,77% | | 100% | - | - | - | - | - | - | - | |
| Benchmark: | IBX | | | | -7,59% | -6,85% | -4,76% | -4,34% | -8,23% | -5,60% | 0,93% | |
| Estruturado | 59.648.326,56 | 3,56% | | | 0,59% | -1,49% | 0,17% | 0,85% | 7,68% | 15,28% | 33,49% | |
| Benchmark: | CDI + 2% a.a. | | | | 1,06% | 3,70% | 7,48% | 2,37% | 15,25% | 24,20% | 29,66% | |
| Multimercados Estruturados | 49.392.515,55 | 2,95% | | 1,12% | | | | | | | | |
| NAVI LS ESTRUTURADO FIC FI MULT | 16.054.652,30 | 0,96% | NAVI CAPITAL | 2,97% | 1,72% | 0,93% | 0,31% | 4,32% | 0,80% | 16,13% | 26,39% | 29,72% |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI | 12.171.499,22 | 0,73% | OCCAM | 0,81% | 2,26% | 0,90% | 1,25% | 4,51% | 1,01% | 11,73% | 15,26% | 25,76% |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT | 3.074.680,28 | 0,18% | OCCAM | 0,23% | 2,26% | 0,90% | 1,25% | 4,51% | 1,01% | 11,72% | 15,25% | 25,71% |
| QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP | 9.373.350,40 | 0,56% | QUANTITAS | 4,13% | | 0,80% | 3,25% | 7,97% | 1,59% | 21,00% | 29,55% | 39,66% |
| GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT | 8.718.333,35 | 0,52% | ZEITGEIST | 0,54% | 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% | |
| FIP | 10.255.811,01 | 0,61% | | | | | | | | | | |
| SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES | 10.255.811,01 | 0,61% | SIGNAL CAPITAL | 10,28% | | 0,11% | -11,98% | -17,22% | 0,35% | -16,92% | -44,31% | -44,61% |
| Benchmark: | IPCA | | | | | 0,84% | 2,00% | 2,73% | 1,37% | 5,60% | 16,73% | 22,79% |
| Exterior | 43.938.901,78 | 2,62% | | | 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 | 43.938.901,78 | 2,62% | | 3,65% | | | | | | | | |
| ISHARES S&P 500 FC FUNDO DE INDICE IE | 43.938.901,78 | 2,62% | BLACKROCK | 1,43% | 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 ** | 65.327.353,77 | 3,90% | | | 1,78% | 4,39% | 3,98% | 3,18% | 15,96% | 36,45% | 53,18% | |
| Benchmark: | INPC + 11.60% a.a. | | | | 1,56% | 4,72% | 8,11% | 3,01% | 17,65% | 45,54% | 72,30% | |
| Imobiliário ** | 160.510.425,21 | 9,58% | | | -0,24% | 0,87% | 2,19% | 0,49% | 5,77% | 15,82% | 41,17% | |
| Benchmark: | INPC | | | | 0,77% | 1,93% | 2,47% | 1,23% | 5,47% | 16,86% | 24,12% | |
| Total | 1.675.676.134,56 | 100% | | | 2,79% | -1,08% | -1,42% | -1,84% | -0,16% | 6,83% | 11,57% | 28,52% |
| 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

** Alocação em Operações com Participantes e/ou Imóveis referentes à 31/01/2023

* 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.

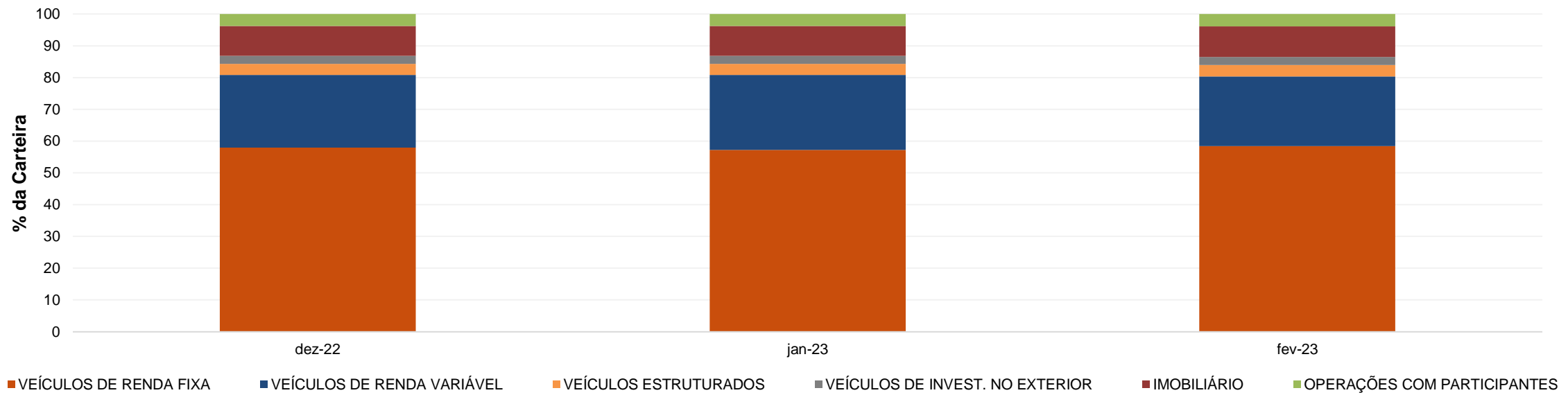
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

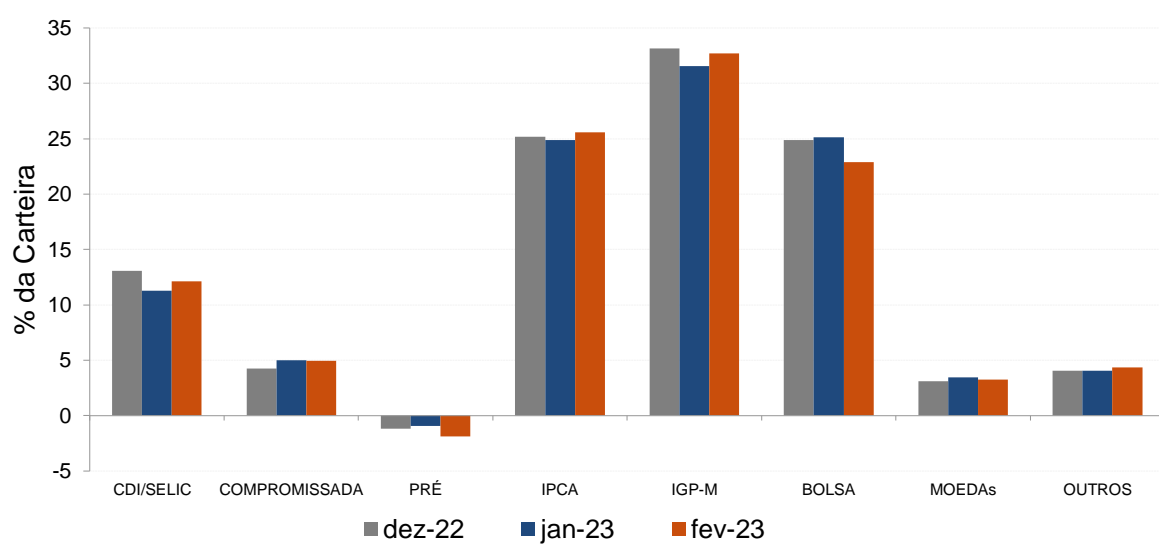
Distribuição da Carteira

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.

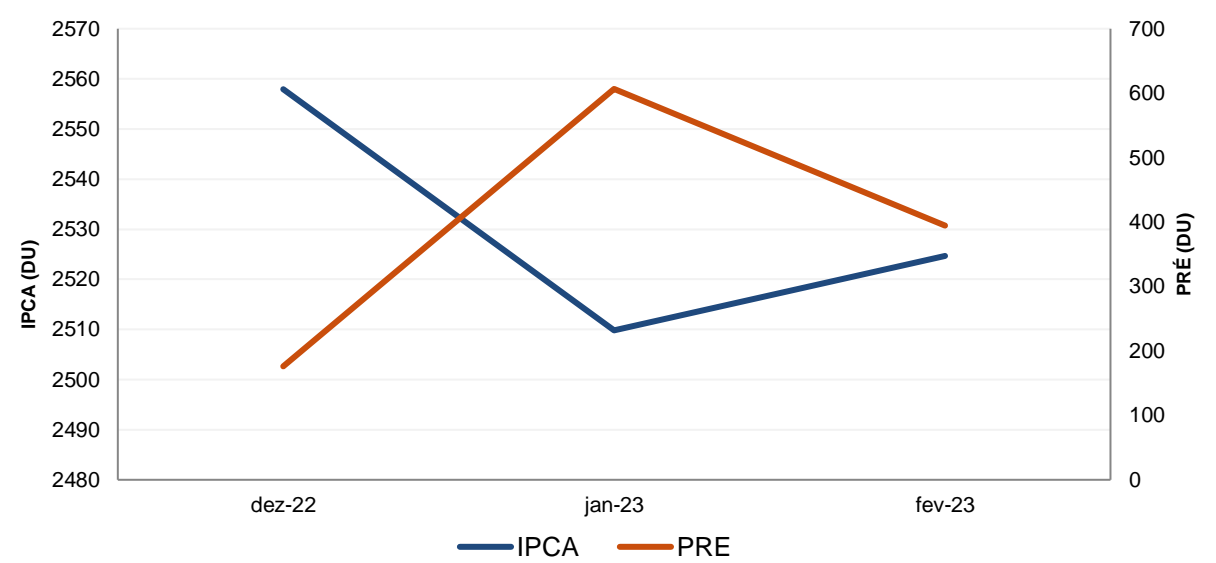
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | 49.753,26 | 14,38 | 55.918,70 | 14,54 |
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 20.952,67 | 6,06 | 21.674,61 | 5,64 |
| ITSA4 | Intermediários Financeiros | 16.679,47 | 4,82 | 18.056,31 | 4,70 |
| EQTL3 | Energia Elétrica | 15.425,17 | 4,46 | 17.026,06 | 4,43 |
| PRIO3 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 12.682,57 | 3,67 | 17.155,56 | 4,46 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 12.321,61 | 3,56 | 12.335,58 | 3,21 |
| RENT3 | Diversos | 11.882,13 | 3,43 | 12.971,45 | 3,37 |
| ELET3 | Energia Elétrica | 11.240,73 | 3,25 | 13.987,60 | 3,64 |
| BBAS3 | Intermediários Financeiros | 9.730,25 | 2,81 | 8.200,63 | 2,13 |
| BBDC4 | Intermediários Financeiros | 9.038,06 | 2,61 | 9.727,43 | 2,53 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

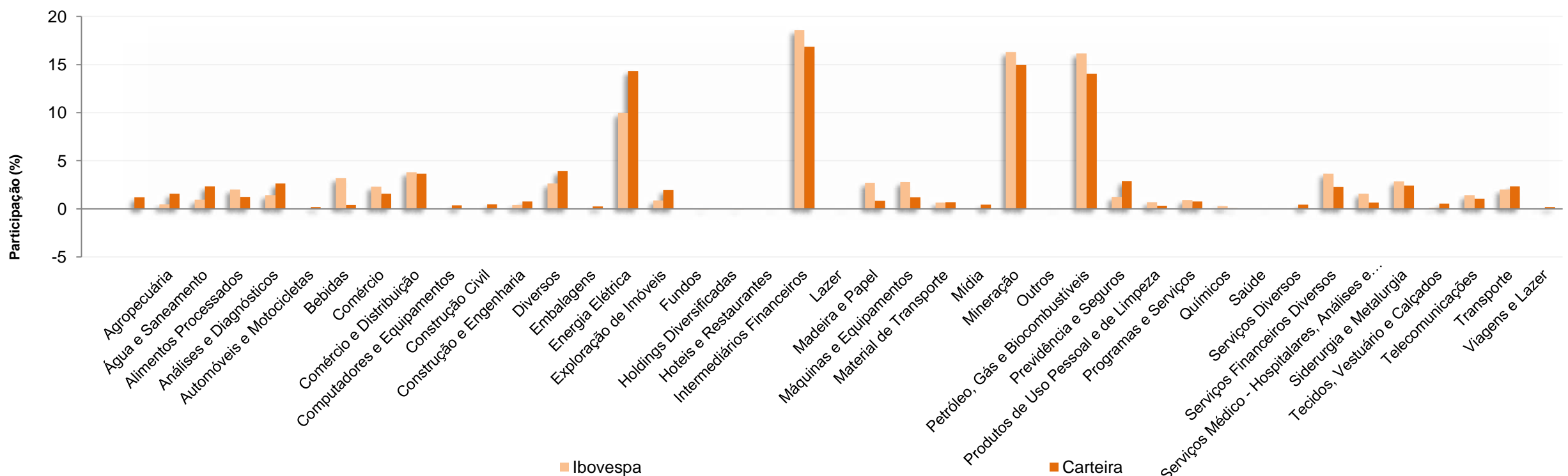
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|--------|----------|------|--------------|--------------------|
| BRML3 | 4,08 | 0,00 | 0,00 | Sem Liquidez |
| GETT11 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | Sem Liquidez |
| MTSA4 | 369,81 | 0,11 | 0,34 | 31 |
| CRIV4 | 82,93 | 0,02 | 0,10 | 11 |
| HBRE3 | 371,63 | 0,11 | 0,34 | 6 |
| ALLD3 | 157,33 | 0,05 | 0,20 | 6 |
| EALT4 | 94,27 | 0,03 | 0,20 | 5 |
| ELMD3 | 1.502,50 | 0,43 | 0,27 | 3 |
| LAND3 | 819,70 | 0,24 | 0,11 | 3 |
| WEST3 | 103,52 | 0,03 | 0,19 | 3 |

* 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 BD

Data-base: 28/02/2023

Análises de Contrapartes

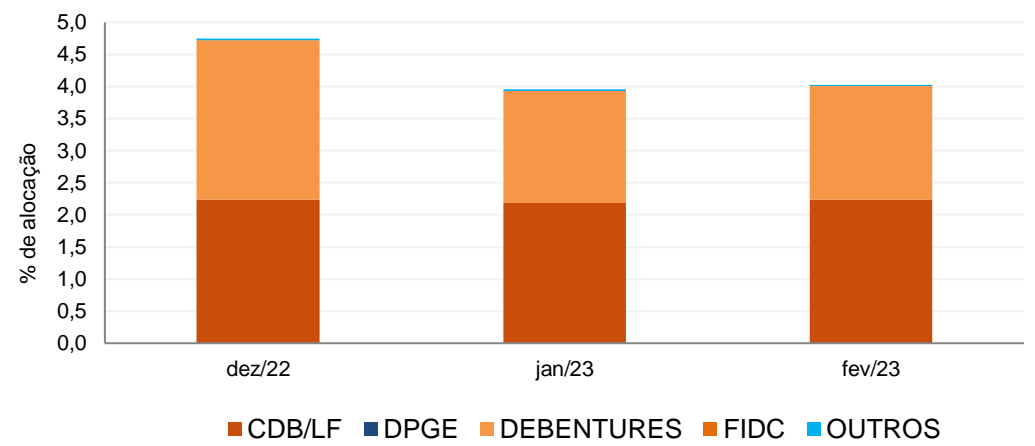
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|--|-----------|------|---------------------------|
| VALE SA | 67.561,95 | 4,67 | Faixa 1 |
| BCO BRADESCO SA | 27.352,59 | 1,89 | Faixa 1 |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 21.755,35 | 1,50 | Faixa 2 |
| ITAUSA SA | 16.888,97 | 1,17 | Faixa 2 |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 15.425,17 | 1,07 | Faixa 1 |
| PETRO RIO SA | 12.682,57 | 0,88 | Faixa 2 |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE | 12.375,05 | 0,85 | Faixa 2 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 12.321,77 | 0,85 | Faixa 1 |
| LOCALIZA RENT A CAR SA | 11.954,77 | 0,83 | Faixa 1 |
| BCO BRASIL SA | 9.730,25 | 0,67 | 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 | 191,92 | DIAGNOSTICOS AMERICA SA | Faixa 1 | Faixa 2 | 30-out-26 | CDI | 1,44% | URCA FI MULT CRED PRIV |
| DASAA5 | 40,88 | DIAGNOSTICOS AMERICA SA | Faixa 1 | Faixa 2 | 30-out-26 | CDI | 1,44% | URCA FI MULT CRED PRIV |
| DASAA5 | 86,12 | DIAGNOSTICOS AMERICA SA | Faixa 1 | Faixa 2 | 30-out-26 | CDI | 1,43% | URCA FI MULT CRED PRIV |



ELETROS - ELETROS PLANO BD

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 | 187.186 | 0,01% | Selic | 13-fev-23 | 0,01% | 0,00% | ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF |
| LFT 2025-03-01 | 01-mar-25 | 1.428.630 | 0,10% | Selic | 10-fev-23 | 0,02% | 0,02% | ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF |
| LFT 2025-09-01 | 01-set-25 | 87.085 | 0,01% | Selic | 28-fev-23 | 5,00% | 0,04% | ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF |
| LFT 2025-09-01 | 01-set-25 | 51.394 | 0,00% | Selic | 27-fev-23 | 5,00% | 0,05% | ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 4.276 | 0,00% | Selic | 27-fev-23 | 0,09% | 0,00% | ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF |

