

ELETROS - ELETROS PLANO CD EBRASI

Data-base: 31/08/2023

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 | 441.266.679,17 | 70,80% | | | 0,52% | 3,54% | 8,79% | 9,71% | 9,49% | | | |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,14% | 3,32% | 6,68% | 8,87% | 13,55% | 25,14% | 28,52% | |
| Renda Fixa CDI | 186.647.125,80 | 29,95% | | 0,04% | | | | | | | | |
| ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP | 124.573.424,28 | 19,99% | ALFA | 13,13% | 0,01% | 1,22% | 3,56% | 6,99% | 9,15% | 14,09% | 27,00% | 30,53% |
| BRDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV | 3.309.532,35 | 0,53% | BRDESCO | 13,44% | 0,00% | 1,14% | 3,29% | 6,60% | 8,77% | 13,39% | 24,73% | 28,00% |
| URCA FI MULT CRED PRIV | 58.764.169,18 | 9,43% | SANTANDER | 12,73% | 0,12% | 1,16% | 3,59% | 7,38% | 9,40% | 14,30% | 26,41% | 29,67% |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,14% | 3,32% | 6,68% | 8,87% | 13,55% | 25,14% | 28,52% | |
| CARTEIRA PRÓPRIA RF | 254.619.553,37 | 40,85% | | | | | | | | | | |
| ELETROS PLANO CD EBRASI CARTEIRA PROPRIA R | 254.619.553,37 | 40,85% | | 100% | - | - | - | - | - | - | - | |
| Benchmark: | CDI | | | | 1,14% | 3,32% | 6,68% | 8,87% | 13,55% | 25,14% | 28,52% | |
| Renda Variável | 73.703.311,68 | 11,83% | | | -4,66% | 7,96% | 11,60% | 7,58% | 4,50% | | | |
| Benchmark: | IBrX + 2% a.a. | | | | -4,83% | 7,40% | 10,47% | 6,01% | 6,23% | -0,51% | 22,66% | |
| Renda Variável Ativa | 73.703.311,68 | 11,83% | | 1,20% | | | | | | | | |
| GRUMARI FIA | 5.775.557,80 | 0,93% | AZ QUEST | 8,58% | 9,49% | -6,21% | 6,51% | 9,93% | 7,25% | 1,22% | -12,52% | -0,69% |
| FIA CONSTÂNCIA CAMBOINHAS | 13.687.090,76 | 2,20% | CONSTANCIA | 8,58% | 6,75% | -4,77% | 5,21% | 12,11% | 9,74% | 2,79% | 2,67% | 21,07% |
| ELETROS ITAUNA FIA | 10.924.541,71 | 1,75% | ELETROBRÁS | 8,58% | 7,44% | -5,37% | - | - | - | - | - | - |
| FIA SÃO CONRADO | 2.449.418,55 | 0,39% | EQUITAS | 8,58% | 8,81% | -3,80% | 6,44% | 13,06% | 23,58% | 6,19% | -26,65% | -13,94% |
| SHARP ARPOADOR IBRX ATIVO FIA | 29.887.888,50 | 4,80% | SHARP | 8,59% | 6,83% | -4,21% | 10,11% | 11,42% | 6,85% | 7,53% | 5,82% | 29,06% |
| VINCI JOATINGA FIA | 4.833.613,51 | 0,78% | VINCI | 8,58% | 8,65% | -4,52% | 9,41% | 14,49% | 10,84% | 5,00% | -5,86% | 10,66% |
| FIA PIPA | 6.145.200,84 | 0,99% | XP | 8,58% | 5,88% | -4,31% | 4,82% | 11,59% | 8,95% | 2,63% | 9,19% | 12,19% |
| Benchmark: | IBrX + 2% a.a. | | | | -4,83% | 7,40% | 10,47% | 6,01% | 6,23% | -0,51% | 22,66% | |
| Estruturado | 28.163.601,28 | 4,52% | | | -0,27% | 3,45% | 2,23% | 3,17% | 4,67% | | | |
| Benchmark: | CDI + 2% a.a. | | | | 1,32% | 3,85% | 7,76% | 10,31% | 15,81% | 30,18% | 36,36% | |
| Multimercados Estruturados | 26.135.286,23 | 4,19% | | 1,84% | | | | | | | | |
| NAVI LS ESTRUT FIC FI MULT | 8.564.746,93 | 1,37% | NAVI CAPITAL | 1,70% | 2,20% | 0,55% | 4,58% | 3,48% | 4,31% | 7,96% | 23,77% | 31,35% |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO ADVISORY FIC FI MUI | 6.099.511,86 | 0,98% | OCCAM | 0,64% | 2,76% | -1,01% | 1,89% | -2,79% | -1,81% | 1,59% | 10,40% | 12,58% |
| OCCAM RETORNO ABSOLUTO FIC FI MULT | 1.540.749,13 | 0,25% | OCCAM | 0,18% | 2,77% | -1,01% | 1,89% | -2,79% | -1,81% | 1,59% | 10,38% | 12,60% |
| QUANTITAS FI MULT ARBITRAGEM LP | 5.270.498,47 | 0,85% | QUANTITAS | 2,26% | | 1,48% | 5,66% | 9,07% | 10,81% | 17,76% | 37,32% | 47,05% |
| GIANT ZARATHUSTRA II FIC FI MULT | 4.659.779,84 | 0,75% | ZEITGEIST | 0,37% | 2,16% | -2,58% | 3,42% | 3,68% | 4,18% | 4,00% | 18,90% | 23,25% |
| Benchmark: | CDI + 2% a.a. | | | | 1,32% | 3,85% | 7,76% | 10,31% | 15,81% | 30,18% | 36,36% | |
| FIP | 2.028.315,05 | 0,33% | | | | | | | | | | |
| SIGNAL CAPITAL FICFI PARTICIPACOES | 2.028.315,05 | 0,33% | SIGNAL CAPITAL | 2,09% | | 0,13% | -0,60% | -2,76% | -2,42% | -19,50% | -23,01% | -52,86% |
| Benchmark: | IPCA | | | | | 0,23% | 0,27% | 1,83% | 3,23% | 4,61% | 13,74% | 24,75% |
| Exterior | 20.161.475,24 | 3,23% | | | 3,26% | 6,17% | 8,00% | 10,07% | 9,73% | | | |
| Benchmark: | MSCI WORLD (BRL) | | | | 1,15% | 2,98% | 3,96% | 8,22% | 8,01% | -9,04% | 9,39% | |
| Exterior - RV | 20.161.475,24 | 3,23% | | 5,20% | | | | | | | | |
| ISHARES S&P 500 FIC FUNDO DE ÍNDICE - IE | 20.161.475,24 | 3,23% | BLACKROCK | 0,72% | 6,76% | 3,26% | 6,17% | 8,00% | 10,07% | 9,58% | -2,50% | 19,55% |
| Benchmark: | MSCI WORLD (BRL) | | | | | 1,15% | 2,98% | 3,96% | 8,22% | 8,01% | -9,04% | 9,39% |
| Operações com Participantes | 16.998.972,02 | 2,73% | | | 0,73% | 7,11% | 10,46% | 13,02% | 11,33% | | | |
| Benchmark: | INPC + 11.60% a.a. | | | | 1,21% | 2,88% | 7,37% | 10,60% | 16,08% | 40,98% | 73,65% | |
| Imobiliário | 42.979.865,90 | 6,90% | | | 0,43% | 1,31% | 2,68% | 3,19% | 4,93% | | | |
| Benchmark: | INPC | | | | 0,20% | 0,01% | 1,55% | 2,80% | 4,06% | 13,24% | 25,04% | |
| Total | 623.270.258,60 | 100% | | | 1,77% | -0,16% | 4,04% | 7,96% | 8,23% | 7,69% | | |
| Benchmark: | INPC + 4.8% a.a. | | | | 0,63% | 1,23% | 3,99% | 6,06% | 9,03% | 24,35% | 43,87% | |

* 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.

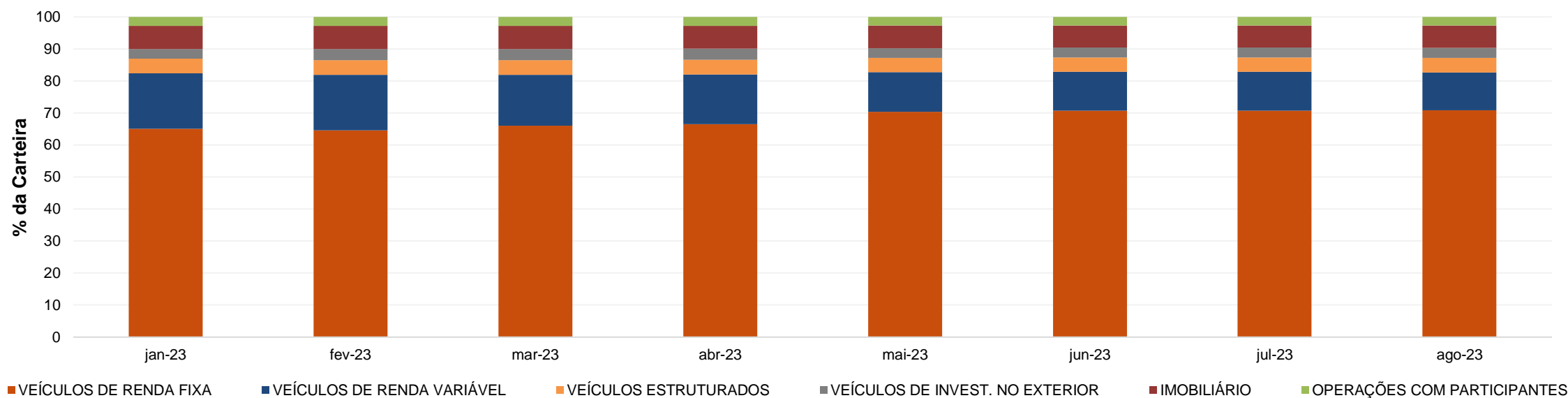
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

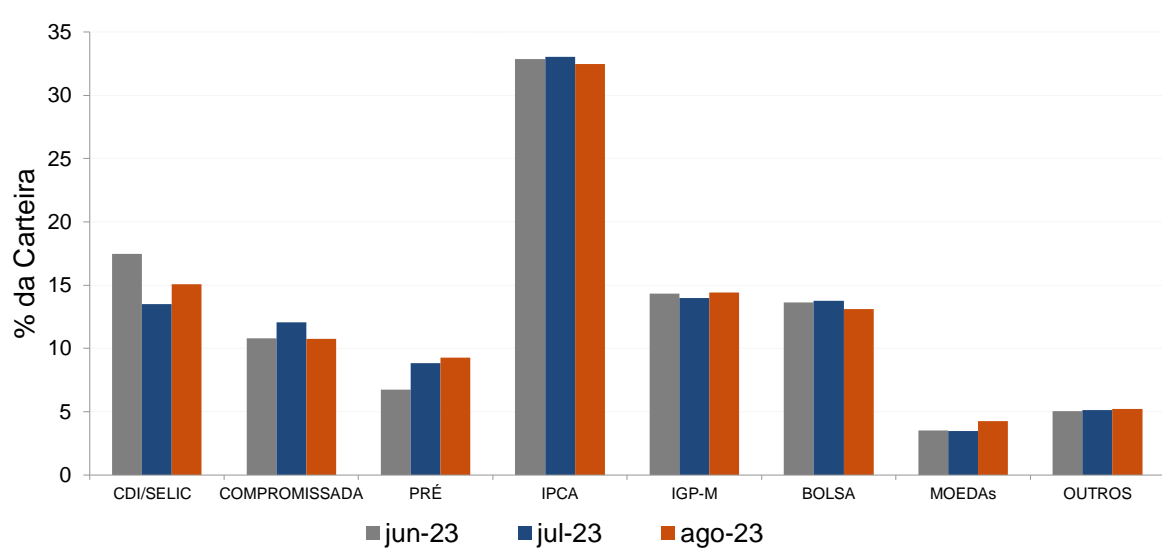
Distribuição da Carteira

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.

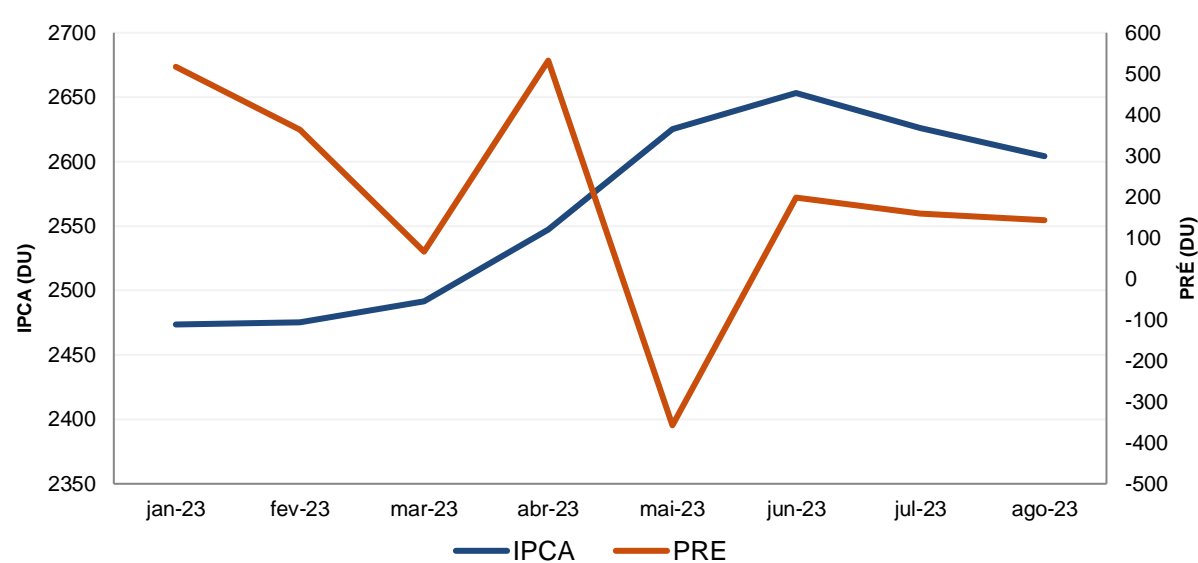
Evolução do Patrimônio Líquido



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 | 6.689,44 | 8,84 | 5.917,73 | 7,55 |
| PETR4 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 6.032,52 | 7,98 | 4.965,85 | 6,33 |
| EQTL3 | Energia Elétrica | 3.644,71 | 4,82 | 3.940,15 | 5,03 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 2.974,43 | 3,93 | 3.072,77 | 3,92 |
| ITSA4 | Intermediários Financeiros | 2.944,41 | 3,89 | 3.114,60 | 3,97 |
| PRI03 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 2.853,49 | 3,77 | 2.826,85 | 3,61 |
| ELET3 | Energia Elétrica | 2.843,68 | 3,76 | 3.234,39 | 4,13 |
| RENT3 | Diversos | 2.404,90 | 3,18 | 2.568,39 | 3,28 |
| BPAC11 | Intermediários Financeiros | 2.205,05 | 2,92 | 2.488,29 | 3,17 |
| RAIL3 | Transporte | 2.186,23 | 2,89 | 1.861,36 | 2,37 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

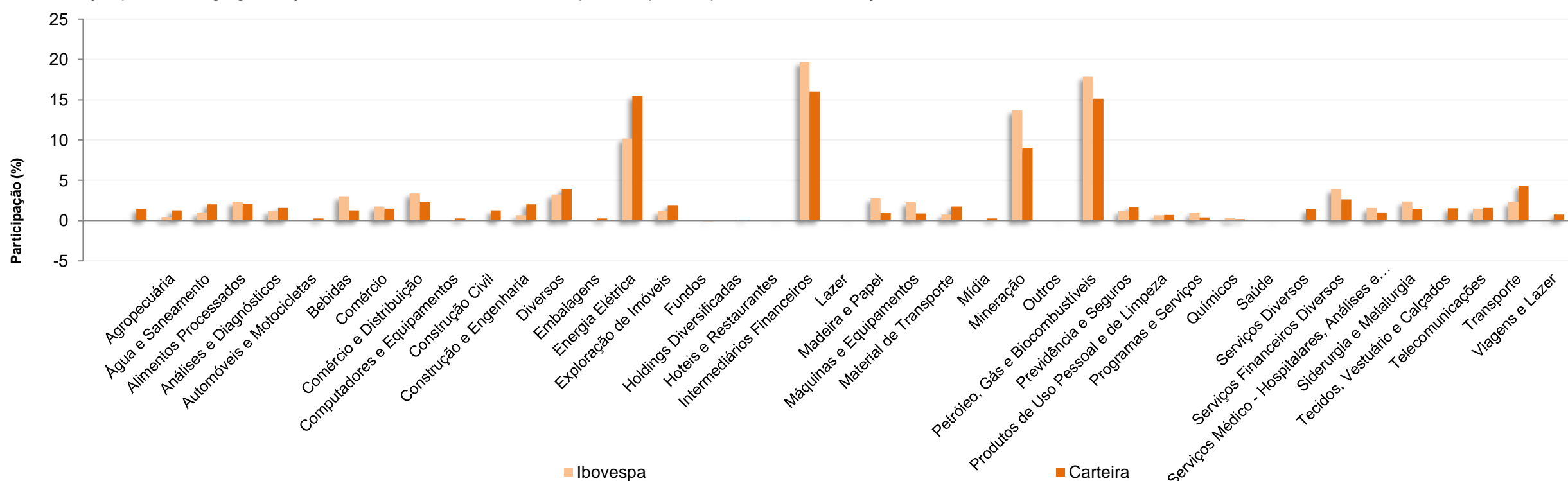
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|-------|----------|------|--------------|--------------------|
| CRIV4 | 21,73 | 0,03 | 0,02 | 8 |
| MTSA4 | 83,14 | 0,11 | 0,07 | 4 |
| SCAR3 | 28,08 | 0,04 | 0,01 | 2 |
| VALE3 | 6.689,44 | 8,84 | 0,00 | 1 |
| PETR4 | 6.032,52 | 7,98 | 0,00 | 1 |
| EQTL3 | 3.644,71 | 4,82 | 0,01 | 1 |
| ITUB4 | 2.974,43 | 3,93 | 0,00 | 1 |
| ITSA4 | 2.944,41 | 3,89 | 0,01 | 1 |
| PRI03 | 2.853,49 | 3,77 | 0,01 | 1 |
| ELET3 | 2.843,68 | 3,76 | 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 EBRASI

Data-base: 31/08/2023

Análises de Contrapartes

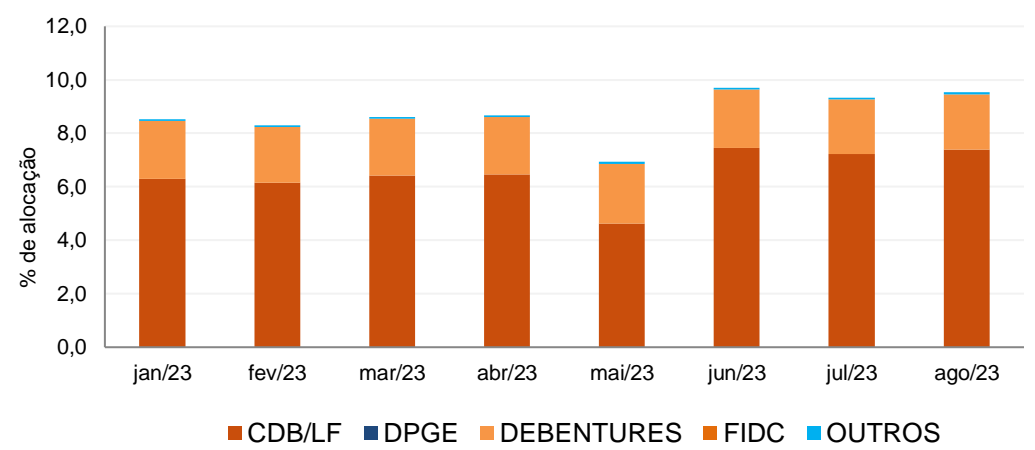
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|---|-----------|------|---------------------------|
| BCO BRADESCO SA | 20.157,65 | 3,61 | Faixa 1 |
| BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA | 12.392,87 | 2,22 | Faixa 2 |
| VALE SA | 9.771,71 | 1,75 | Faixa 1 |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 6.096,02 | 1,09 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 6.047,10 | 1,08 | Faixa 1 |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 3.644,71 | 0,65 | Faixa 1 |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE | 3.552,68 | 0,64 | Faixa 2 |
| BCO ITAU SA | 3.258,24 | 0,58 | Faixa 1 |
| ITAUSA SA | 3.182,35 | 0,57 | Faixa 2 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA | 2.975,19 | 0,53 | 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 EBRASI

Data-base: 31/08/2023

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 2023-09-01 | 01-set-23 | 2.050.084 | 0,37% | Selic | 22-ago-23 | 6,00% | 0,05% | ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF |
| LFT 2026-03-01 | 01-mar-26 | 3.496.219 | 0,63% | Selic | 01-ago-23 | 0,08% | 0,00% | URCA FI MULT CRED PRIV |
| LFT 2027-03-01 | 01-mar-27 | 8.988.067 | 1,61% | Selic | 23-ago-23 | 0,12% | 0,13% | ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 1.376.229 | 0,25% | IPCA | 08-ago-23 | 5,54% | 5,47% | URCA FI MULT CRED PRIV |
| NTN-B 2025-05-15 | 15-mai-25 | 105.574 | 0,02% | IPCA | 28-ago-23 | 5,60% | 5,56% | URCA FI MULT CRED PRIV |
| NTN-B 2026-08-15 | 15-ago-26 | 63.044 | 0,01% | IPCA | 28-ago-23 | 5,07% | 5,05% | URCA FI MULT CRED PRIV |

