

ELETROS - ELETROS PLANO CD PURO

Data-base: 29/09/2023

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 | 1.218.326.498,79 | 73,91% | | | -0,35% | 0,56% | 7,33% | 11,09% | 11,50% | 20,91% | 24,65% |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,97% | 3,22% | 6,47% | 9,93% | 13,44% | 25,80% | 29,57% |
| Renda Fixa CDI | 590.625.225,47 | 35,83% | | 0,06% | | | | | | | |
| ELETROS FIC FI MULT CRED PRIV | 590.625.225,47 | 35,83% | 42,24% | 0,06% | - | - | - | - | - | - | - |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,97% | 3,22% | 6,47% | 9,93% | 13,44% | 25,80% | 29,57% |
| CARTEIRA PRÓPRIA RF | 627.701.273,32 | 38,08% | | | | | | | | | |
| ELETROS PLANO CD PURO CARTEIRA PROPRIA RF | 627.701.273,32 | 38,08% | 100% | | - | - | - | - | - | - | - |
| Benchmark: | CDI | | | | 0,97% | 3,22% | 6,47% | 9,93% | 13,44% | 25,80% | 29,57% |
| Renda Variável | 215.121.218,23 | 13,05% | | | 0,37% | -1,10% | 15,87% | 7,97% | 5,17% | 4,03% | 20,89% |
| Benchmark: | IBrX + 2% a.a. | | | | 1,00% | -0,52% | 14,90% | 7,07% | 7,17% | 7,86% | 29,62% |
| Renda Variável Ativa | 215.121.218,23 | 13,05% | | 1,49% | | | | | | | |
| ELETROS AÇÕES FIC FIA | 215.121.218,23 | 13,05% | 25,38% | 5,40% | - | - | - | - | - | - | - |
| Benchmark: | IBrX + 2% a.a. | | | | 1,00% | -0,52% | 14,90% | 7,07% | 7,17% | 7,86% | 29,62% |
| Estruturado | 92.180.789,98 | 5,59% | | | 1,42% | 2,61% | 5,40% | 5,10% | 7,11% | 21,38% | 28,14% |
| Benchmark: | CDI + 2% a.a. | | | | 1,13% | 3,74% | 7,52% | 11,56% | 15,69% | 30,87% | 37,46% |
| Multimercados Estruturados | 92.180.789,98 | 5,59% | | 0,89% | | | | | | | |
| ELETROS MULT FIC FI MULT | 92.180.789,98 | 5,59% | 38,66% | 0,89% | - | - | - | - | - | - | - |
| Benchmark: | CDI + 2% a.a. | | | | 1,13% | 3,74% | 7,52% | 11,56% | 15,69% | 30,87% | 37,46% |
| Exterior | 55.136.531,37 | 3,34% | | | -3,58% | 1,50% | 3,93% | 6,13% | 12,00% | -6,43% | 16,85% |
| Benchmark: | MSCI WORLD (BRL) | | | | -2,78% | -0,07% | 0,75% | 5,21% | 11,10% | -12,63% | 7,00% |
| Exterior - RV | 55.136.531,37 | 3,34% | | 3,91% | | | | | | | |
| ISHARES S&P 500 FIC FUNDO DE INDICE - IE | 55.136.531,37 | 3,34% | BLACKROCK | 2,12% | 5,52% | -3,58% | 1,50% | 3,93% | 6,13% | 11,85% | -6,36% |
| Benchmark: | MSCI WORLD (BRL) | | | | -2,78% | -0,07% | 0,75% | 5,21% | 11,10% | -12,63% | 7,00% |
| Operações com Participantes | 22.497.617,29 | 1,36% | | | 0,78% | 2,36% | 4,41% | 7,42% | 4,36% | 24,51% | 46,89% |
| Benchmark: | INPC + 11.60% a.a. | | | | 0,99% | 3,05% | 6,66% | 11,69% | 16,53% | 39,40% | 72,27% |
| Imobiliário | 45.078.191,75 | 2,73% | | | 0,43% | 1,29% | 2,40% | 3,63% | 4,93% | 12,73% | 38,13% |
| Benchmark: | INPC | | | | 0,11% | 0,22% | 1,01% | 2,91% | 4,51% | 12,02% | 24,10% |
| Total | 1.648.331.918,27 | 100% | | 2,28% | -0,23% | 0,53% | 8,38% | 9,93% | 10,06% | 16,77% | 25,39% |
| Benchmark: | INPC + 5.2% a.a. | | | | 0,51% | 1,52% | 3,58% | 6,88% | 9,90% | 23,92% | 44,40% |

- 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.

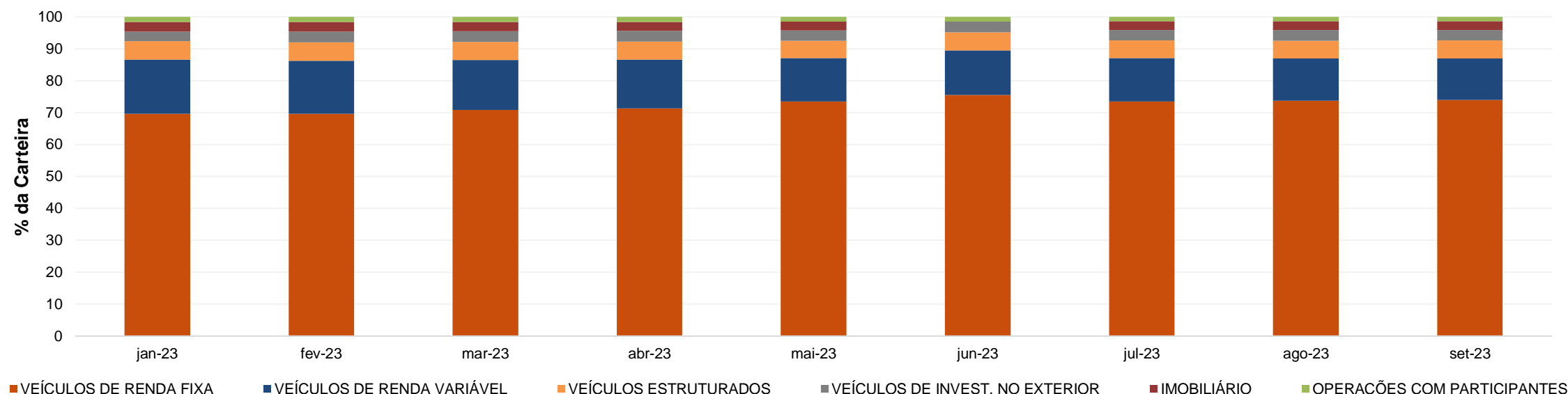
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

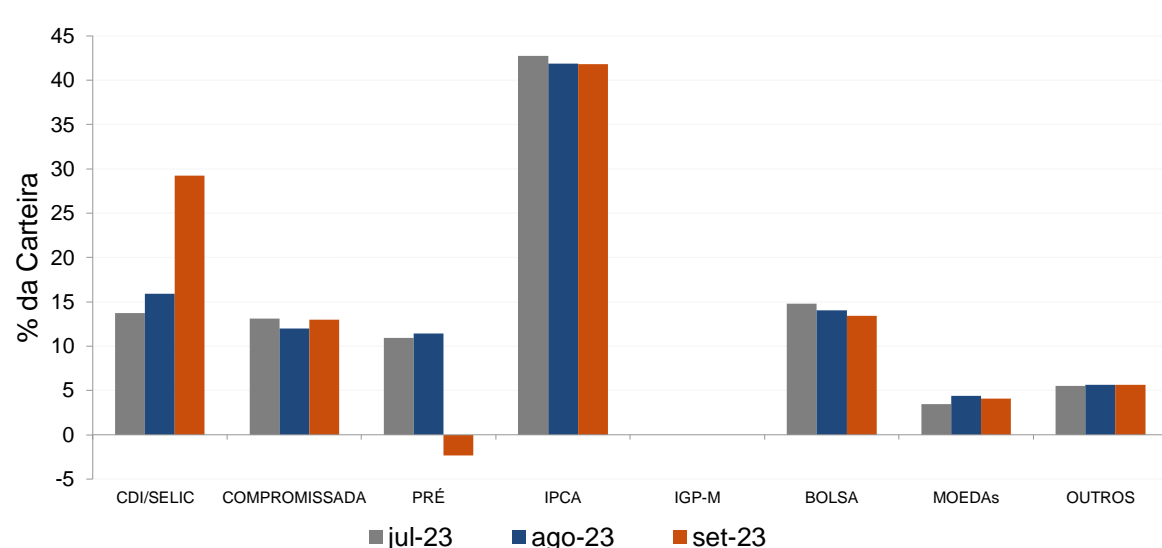
Distribuição da Carteira

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.

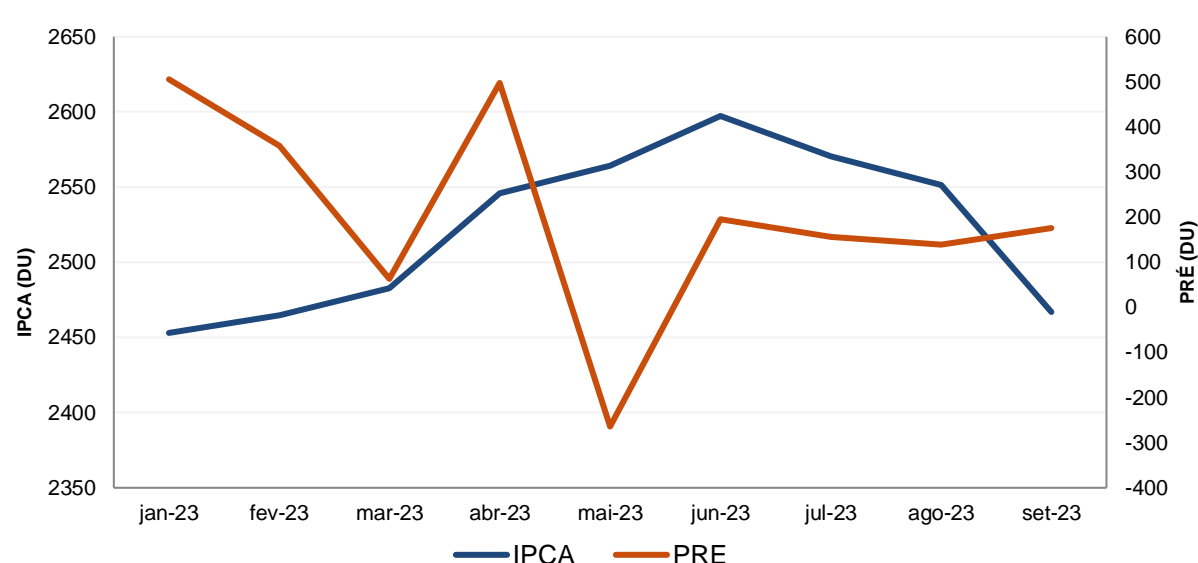
Evolução do Patrimônio Líquido



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* | % |
|--------|---------------------------------|-----------|-------|-----------|------|
| PETRA | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 21.600,61 | 10,46 | 18.232,33 | 7,97 |
| VALE3 | Mineração | 17.658,10 | 8,55 | 19.987,27 | 8,74 |
| EQLT3 | Energia Elétrica | 9.981,69 | 4,83 | 11.326,89 | 4,95 |
| ELET3 | Energia Elétrica | 8.629,11 | 4,18 | 8.628,60 | 3,77 |
| ITSA4 | Intermediários Financeiros | 8.574,16 | 4,15 | 8.898,51 | 3,89 |
| PRI03 | Petróleo, Gás e Biocombustíveis | 7.748,10 | 3,75 | 8.756,13 | 3,83 |
| ITUB4 | Intermediários Financeiros | 7.430,64 | 3,60 | 9.118,37 | 3,99 |
| BBAS3 | Intermediários Financeiros | 6.033,51 | 2,92 | 5.758,24 | 2,52 |
| BPAC11 | Intermediários Financeiros | 5.931,63 | 2,87 | 6.742,74 | 2,95 |
| RAIL3 | Transporte | 5.456,32 | 2,64 | 6.602,81 | 2,89 |

* em mil R\$

Liquidez da Carteira de Ações

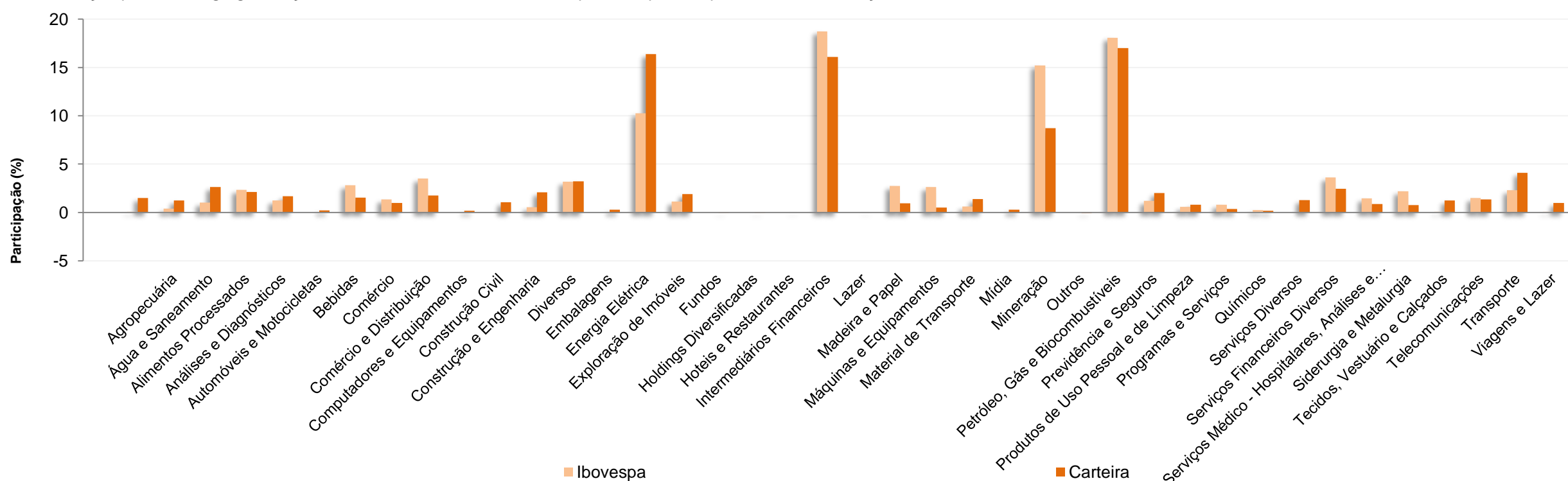
A análise de liquidez das ações apresenta as posições com menor liquidez da carteira, admitindo-se como parâmetro 20% do volume médio de negociação do último mês.

| Nome | Valor* | % | % Free Float | Dias para Desmonte |
|-------|----------|------|--------------|--------------------|
| CRIV4 | 69,11 | 0,03 | 0,07 | 39 |
| MTSA4 | 231,44 | 0,11 | 0,21 | 6 |
| ALLD3 | 140,62 | 0,07 | 0,15 | 6 |
| EALT4 | 62,73 | 0,03 | 0,11 | 4 |
| AGXY3 | 131,17 | 0,06 | 0,04 | 3 |
| SCAR3 | 88,06 | 0,04 | 0,03 | 3 |
| MATD3 | 1.017,22 | 0,49 | 0,19 | 2 |
| ELMD3 | 610,01 | 0,30 | 0,11 | 2 |
| EMAE4 | 37,67 | 0,02 | 0,01 | 2 |
| BEES3 | 29,97 | 0,01 | 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: 29/09/2023

Análises de Contrapartes

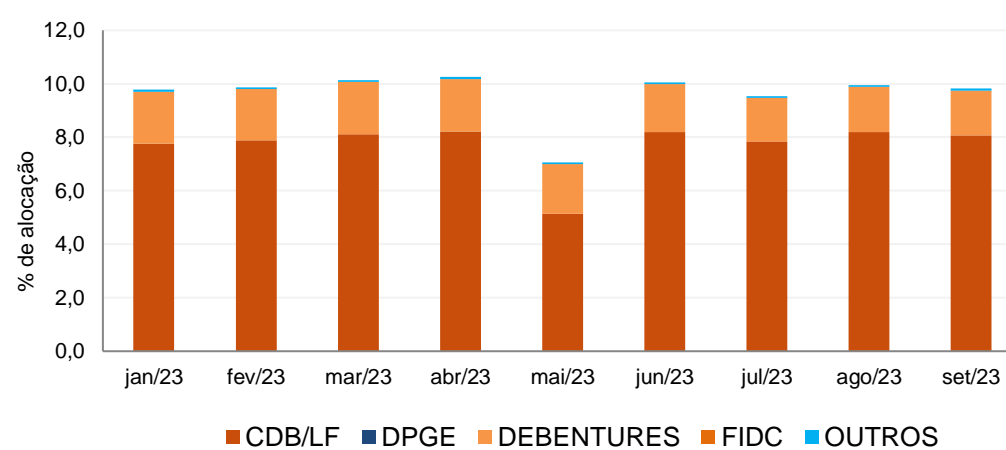
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|---|-----------|------|---------------------------|
| BCO BRADESCO SA | 62.107,90 | 3,98 | Faixa 1 |
| BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA | 38.950,25 | 2,49 | Faixa 2 |
| PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS | 21.202,57 | 1,36 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 18.997,47 | 1,22 | Faixa 1 |
| VALE SA | 17.658,10 | 1,13 | Faixa 1 |
| CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROE | 11.025,56 | 0,71 | Faixa 2 |
| BCO ITAU SA | 10.294,20 | 0,66 | Faixa 1 |
| EQUATORIAL ENERGIA SA | 9.981,69 | 0,64 | Faixa 1 |
| ITAUSA INVESTS ITAU SA | 8.969,95 | 0,57 | Faixa 1 |
| PETRO RIO SA | 7.748,10 | 0,50 | 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: 29/09/2023

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. Nenhuma operação feita no último mês.

