

ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/08/2021

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	ALOCÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*							
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M	
Renda Fixa	110.681.620,05	100%			-2,29%	-1,19%	1,37%	6,30%	13,63%	45,45%	59,26%	
Benchmark:	CDI				0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%	
RF REFERENCIADO DI	69.088.467,52	62,42%										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	43.499.615,92	39,30%	ALFA	3,89%	0,02%	0,45%	1,19%	1,85%	2,14%	2,78%	6,63%	13,32%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	6.452.700,43	5,83%	BRADESCO	4,02%	0,00%	0,42%	1,07%	1,72%	2,00%	2,62%	6,52%	13,13%
URCA FI MULT CRED PRIV	19.136.151,18	17,29%	SANTANDER	3,83%	0,24%	0,41%	1,10%	1,79%	1,87%	2,58%	6,69%	14,02%
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	41.593.152,53	37,58%										
ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF	41.593.152,53	37,58%		100%	2,63%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%
Total	110.681.620,05	100%			1,02%	-0,42%	0,06%	0,49%	-0,31%	1,47%	31,56%	42,38%
Benchmark:	CDI					0,42%	1,09%	1,77%	2,06%	2,70%	6,68%	13,38%

- 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.

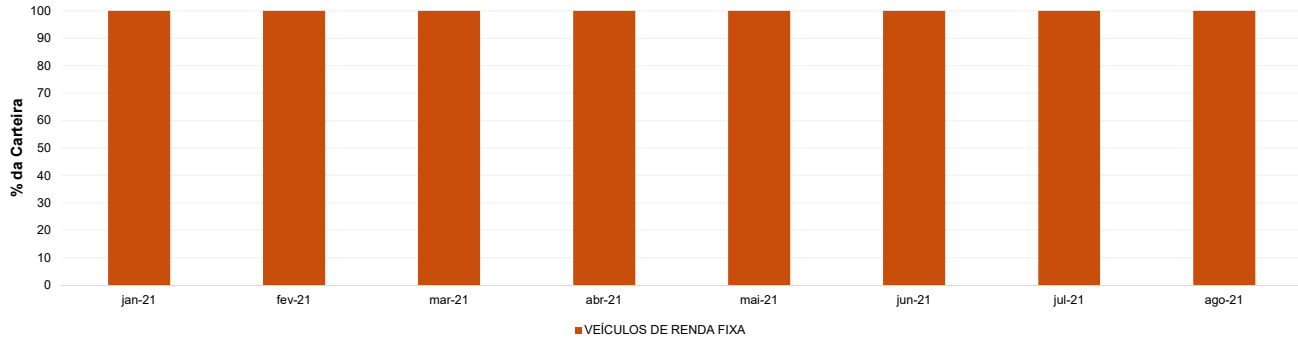
ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/08/2021

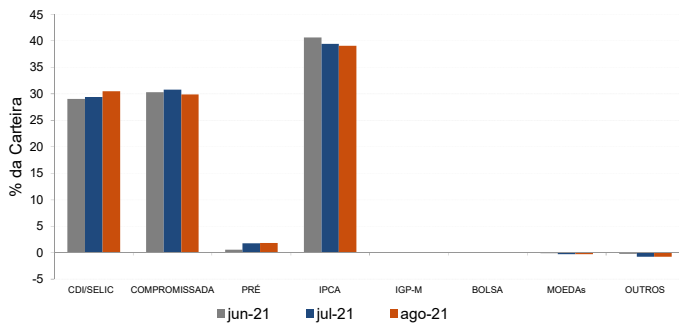
Distribuição da Carteira

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.

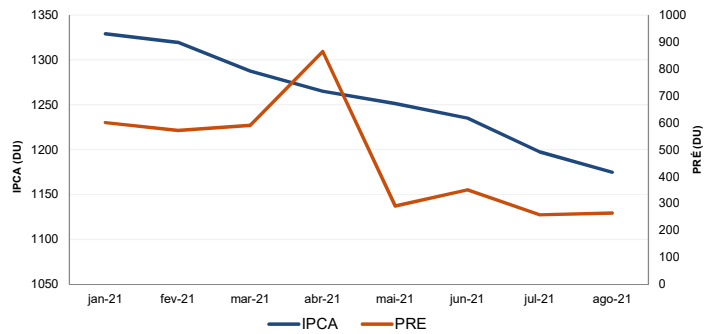
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



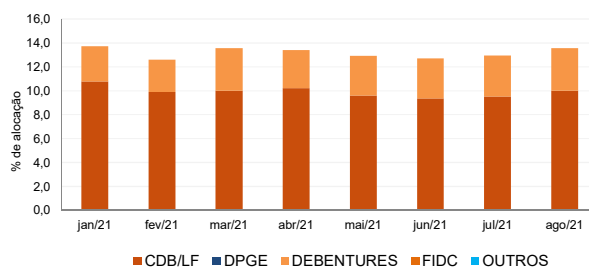
Análises de Contrapartes

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	7.231,77	6,52	Faixa 1
BCO SAFRA SA	1.805,53	1,63	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	1.560,10	1,41	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	597,03	0,54	Faixa 2
BCO ITAU SA	476,91	0,43	Faixa 1
OMEGA GERACAO SA	438,77	0,40	Faixa 2
MOVIDA PARTICIPACOES	397,05	0,36	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	393,66	0,35	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	364,78	0,33	Faixa 1
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	362,15	0,33	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
CEED11	36,57	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA ELETRIC/	Sem Faixa	Faixa 2	15-ago-26	CDI	1,45%	URCA FI MULT CRED PRIV
ITSA14	249,39	ITAUSA SA	Sem Faixa	Faixa 2	15-jun-27	CDI	1,40%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/08/2021

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
CEED11	15-ago-26	36.573	0,03%	CDI	CIA ESTADUAL DISTRIBUICAO ENERGIA I	25-ago-21	1,45%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI	20-ago-24	1.559.565	1,41%	CDI	BCO SAFRA SA	20-ago-21	1,20%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LF CDI Mensal	19-ago-24	1.560.097	1,41%	CDI	BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVI	18-ago-21	1,50%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LF CDI Mensal	19-ago-24	1.559.729	1,41%	CDI	BCO BRADESCO SA	19-ago-21	0,75%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	65.671	0,06%	IPCA		19-ago-21	3,61%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	54.799	0,05%	IPCA		19-ago-21	3,56%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	43.780	0,04%	IPCA		19-ago-21	3,57%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	43.780	0,04%	IPCA		19-ago-21	3,60%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	32.909	0,03%	IPCA		20-ago-21	3,67%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	32.909	0,03%	IPCA		18-ago-21	3,55%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	32.909	0,03%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	32.909	0,03%	IPCA		20-ago-21	3,65%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	32.909	0,03%	IPCA		20-ago-21	3,66%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	32.762	0,03%	IPCA		19-ago-21	3,52%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	32.762	0,03%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	25.122	0,02%	IPCA		24-ago-21	3,72%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	21.890	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,67%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	21.890	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,69%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	21.890	0,02%	IPCA		20-ago-21	3,71%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	21.890	0,02%	IPCA		18-ago-21	3,50%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	21.890	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	21.890	0,02%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	21.743	0,02%	IPCA		24-ago-21	3,73%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	12.488	0,01%	IPCA		24-ago-21	3,72%	3,68%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	11.019	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,57%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	11.019	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,53%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	11.019	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,46%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	11.019	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,53%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	11.019	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,58%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	11.019	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,73%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	11.019	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,54%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	11.019	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,51%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	10.872	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,72%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	10.872	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,54%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	10.872	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,50%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	10.872	0,01%	IPCA		19-ago-21	3,57%	3,62%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	10.872	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,64%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	10.872	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,66%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	10.872	0,01%	IPCA		20-ago-21	3,68%	3,59%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	8.227	0,01%	IPCA		18-ago-21	3,60%	3,58%	URCA FI MULT CRED PRIV