

## ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 30/09/2021

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	
<b>Renda Fixa</b>	<b>109.002.928,47</b>	<b>100%</b>			<b>-0,76%</b>	<b>-3,09%</b>	<b>1,75%</b>	<b>5,49%</b>	<b>11,49%</b>	<b>43,34%</b>	<b>56,30%</b>	
Benchmark:	CDI				0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%	
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>67.319.064,70</b>	<b>61,76%</b>										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	41.479.234,81	38,05%	ALFA	3,91%	0,01%	0,48%	1,33%	2,17%	2,62%	3,29%	6,64%	13,33%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	6.515.879,46	5,98%	BRADESCO	4,05%	0,00%	0,43%	1,20%	1,97%	2,44%	2,90%	6,48%	13,09%
URCA FI MULT CRED PRIV	19.323.950,43	17,73%	SANTANDER	3,86%	0,22%	0,43%	1,17%	2,06%	2,31%	3,11%	6,53%	13,98%
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>41.683.863,77</b>	<b>38,24%</b>										
ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF	41.683.863,77	38,24%		100%	1,82%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%
<b>Total</b>	<b>109.002.928,47</b>	<b>100%</b>			<b>0,73%</b>	<b>0,35%</b>	<b>0,05%</b>	<b>0,90%</b>	<b>0,04%</b>	<b>2,28%</b>	<b>31,35%</b>	<b>42,13%</b>
Benchmark:	CDI					0,44%	1,22%	2,01%	2,51%	2,99%	6,65%	13,35%

- 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.

Esse documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

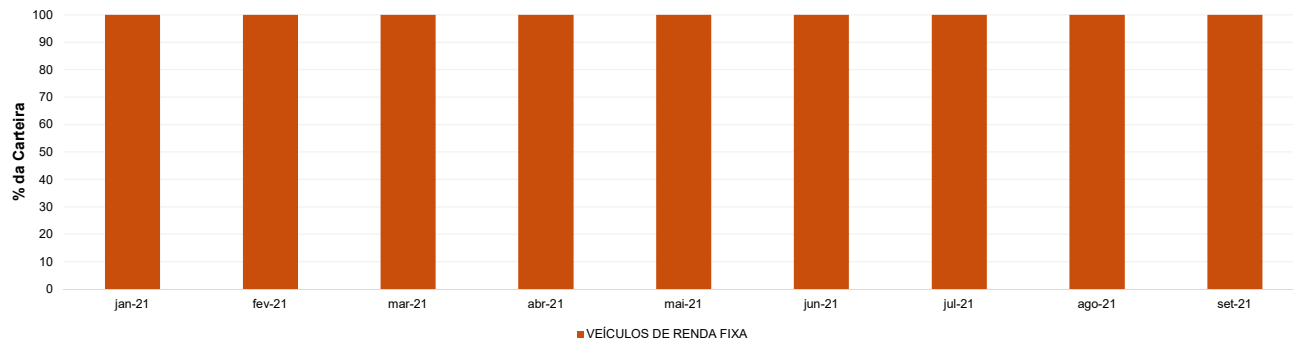
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

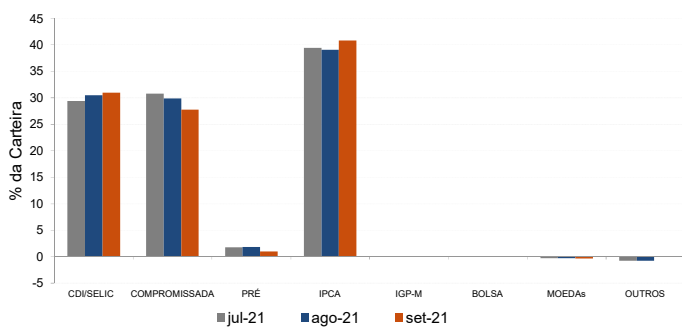
## Distribuição da Carteira

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.

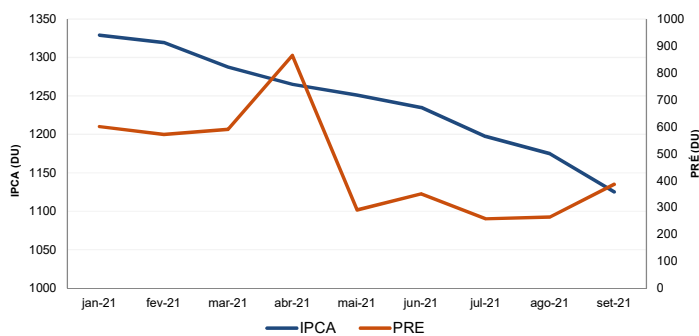
## Evolução do Patrimônio Líquido



## Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



## Evolução da Duration



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 30/09/2021

## Análises de Contrapartes

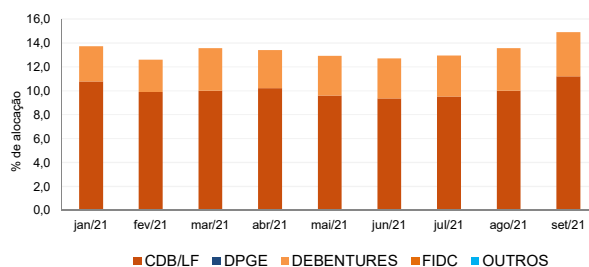
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

### Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	7.293,58	6,68	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.163,75	1,98	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	1.567,48	1,44	Faixa 2
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	499,83	0,46	Faixa 2
BCO ITAU SA	482,33	0,44	Faixa 1
OMEGA GERACAO SA	436,83	0,40	Faixa 2
MOVIDA PARTICIPACOES	401,17	0,37	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	398,36	0,37	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	398,17	0,36	Faixa 2
BCO ABC BRASIL SA	380,30	0,35	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 PGA

Data-base: 30/09/2021

## 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
DASAA4	20-out-25	57.145	0,05%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	28-set-21	1,65%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LF CDI	02-out-23	349.311	0,32%	CDI	BCO SAFRA SA	29-set-21	1,05%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	290.410	0,27%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	56.146	0,05%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	10-jul-23	11.616	0,01%	CDI	BCO CITIBANK SA	29-set-21	0,89%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI Mensal	28-set-23	380.297	0,35%	CDI	BCO ABC BRASIL SA	28-set-21	1,10%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
RDORB7	20-dez-26	74.952	0,07%	CDI	REDE D OR SÃO LUIZ SA	03-set-21	1,42%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
SBSPC7	15-dez-27	29.508	0,03%	CDI	COMPANHIA SANEAMENTO BASICO EST/	20-set-21	1,76%	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
LFT 2022-03-01	01-mar-22	112.968	0,10%	Selic		15-set-21	4,00%	0,03%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	96.750	0,09%	Selic		20-set-21	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	43.000	0,04%	Selic		20-set-21	0,16%	0,16%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	3.010	0,00%	Selic		15-set-21	0,15%	0,15%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	226.740	0,21%	Selic		15-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	44.920	0,04%	Selic		23-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	42.781	0,04%	Selic		23-set-21	0,21%	0,21%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	290.435	0,27%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	290.435	0,27%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	153.733	0,14%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	96.812	0,09%	IPCA		14-set-21	3,69%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	96.812	0,09%	IPCA		14-set-21	3,71%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	96.065	0,09%	IPCA		23-set-21	3,54%	3,54%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	96.065	0,09%	IPCA		23-set-21	3,52%	3,54%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	10.906	0,01%	IPCA		14-set-21	3,70%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	10.906	0,01%	IPCA		14-set-21	3,69%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2023-05-15	15-mai-23	3.137	0,00%	IPCA		14-set-21	3,71%	3,47%	URCA FI MULT CRED PRIV

