

## ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 29/10/2021

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>105.406.407,12</b>		<b>100%</b>		<b>-0,57%</b>	<b>-3,58%</b>	<b>0,44%</b>	<b>4,90%</b>	<b>8,94%</b>	<b>41,28%</b>	<b>53,72%</b>	
Benchmark:	CDI				0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>64.485.524,99</b>		<b>61,18%</b>									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	36.994.285,76	35,10%	ALFA	4,33%	0,02%	0,49%	1,41%	2,49%	3,12%	3,62%	6,66%	13,26%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	5.993.129,66	5,69%	BRADESCO	4,50%	0,00%	0,47%	1,33%	2,25%	2,93%	3,24%	6,48%	13,02%
URCA FI MULT CRED PRIV	21.498.109,56	20,40%	SANTANDER	4,29%	0,38%	0,12%	0,96%	1,99%	2,43%	3,13%	6,07%	13,23%
Benchmark:	CDI				0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>40.920.882,13</b>		<b>38,82%</b>									
ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF	40.920.882,13	38,82%		100%	2,22%	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	
<b>Total</b>	<b>105.406.407,12</b>		<b>100%</b>		<b>0,94%</b>	<b>-0,43%</b>	<b>-0,50%</b>	<b>0,08%</b>	<b>-0,39%</b>	<b>1,77%</b>	<b>30,13%</b>	<b>40,28%</b>
Benchmark:	CDI				0,48%	1,35%	2,29%	3,00%	3,32%	6,65%	13,28%	

- 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.

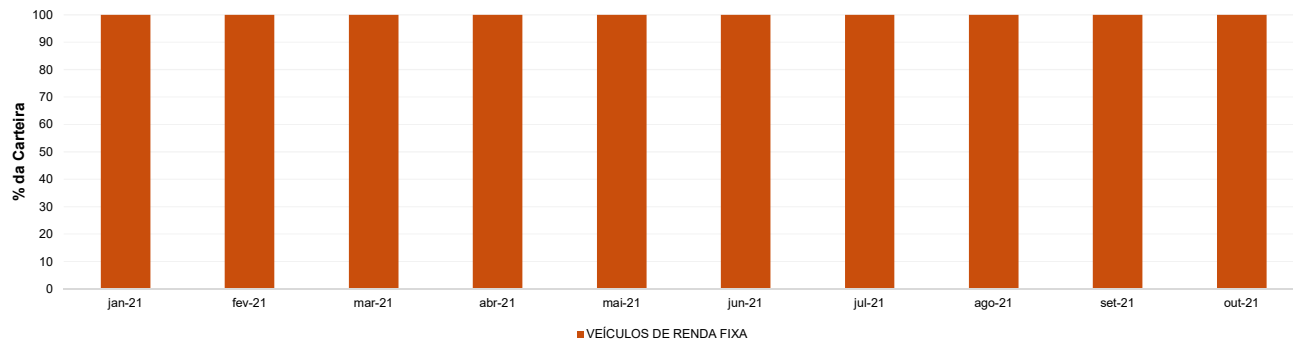
## ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 29/10/2021

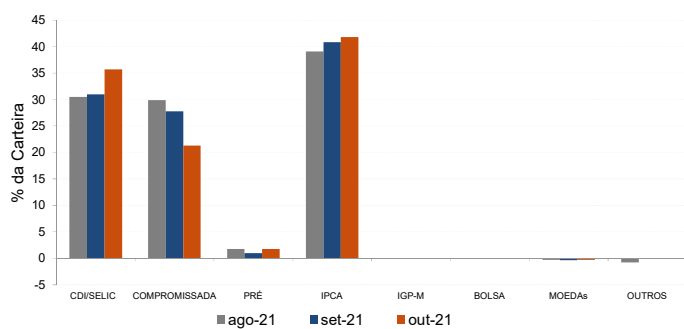
### Distribuição da Carteira

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.

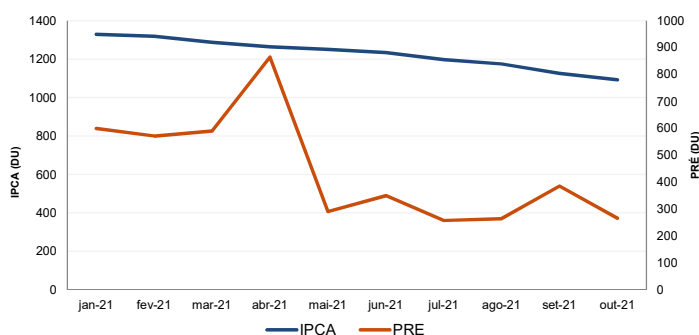
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 29/10/2021

## Análises de Contrapartes

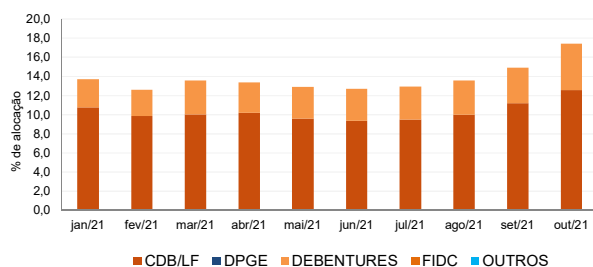
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	8.111,35	7,68	Faixa 1
BCO SAFRA SA	2.398,57	2,27	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	1.735,26	1,64	Faixa 2
MAGAZINE LUIZA SA	552,37	0,52	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROBI	542,94	0,51	Faixa 2
OMEGA GERACAO SA	486,17	0,46	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	445,51	0,42	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	443,19	0,42	Faixa 1
MOVIDA PARTICIPACOES	430,79	0,41	Faixa 2
BCO ABC BRASIL SA	422,91	0,40	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
MGLUA0	62,61	MAGAZINE LUIZA SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-26	CDI	1,25%	URCA FI MULT CRED PRIV
MGLUA0	489,77	MAGAZINE LUIZA SA	Sem Faixa	Faixa 1	15-out-26	CDI	1,25%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 29/10/2021

## 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
CSBR11	10-dez-25	14.692	0,01%	CDI	CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÃO	14-out-21	3,00%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
ENGIB5	15-out-26	230.823	0,22%	CDI	ENERGISA SA	29-out-21	1,64%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
ITSA14	15-jun-27	60.503	0,06%	CDI	ITAUSA INVESTS ITAU SA	18-out-21	1,25%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	15-out-26	489.766	0,46%	CDI	MAGAZINE LUIZA SA	15-out-21	1,25%	Faixa 1	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
MGLUA0	15-out-26	62.607	0,06%	CDI	MAGAZINE LUIZA SA	15-out-21	1,25%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2024-03-01	01-mar-24	478.404	0,45%	Selic		29-out-21	0,11%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

