

ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/01/2022

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	106.735.014,26	100%			2,18%	2,71%	-0,97%	2,18%	4,13%	22,08%	56,04%	
Benchmark:	CDI				0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%	
RF REFERENCIADO DI	64.957.617,76	60,86%										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	41.080.766,69	38,49%	ALFA	6,06%	0,03%	0,80%	2,37%	3,82%	0,80%	5,40%	7,98%	14,19%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.288.219,85	1,21%	BRADESCO	6,34%	0,01%	0,72%	2,04%	3,39%	0,72%	4,88%	7,45%	13,60%
URCA FI MULT CRED PRIV	22.588.631,22	21,16%	SANTANDER	5,97%	0,04%	0,94%	2,49%	3,48%	0,94%	4,90%	7,56%	14,04%
Benchmark:	CDI				0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	41.777.396,50	39,14%										
ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF	41.777.396,50	39,14%		100%	1,85%	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%	
Total	106.735.014,26	100%			0,73%	0,33%	2,28%	1,77%	0,33%	2,14%	21,55%	41,07%
Benchmark:	CDI				0,73%	2,10%	3,47%	0,73%	5,00%	7,66%	13,90%	

- 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.

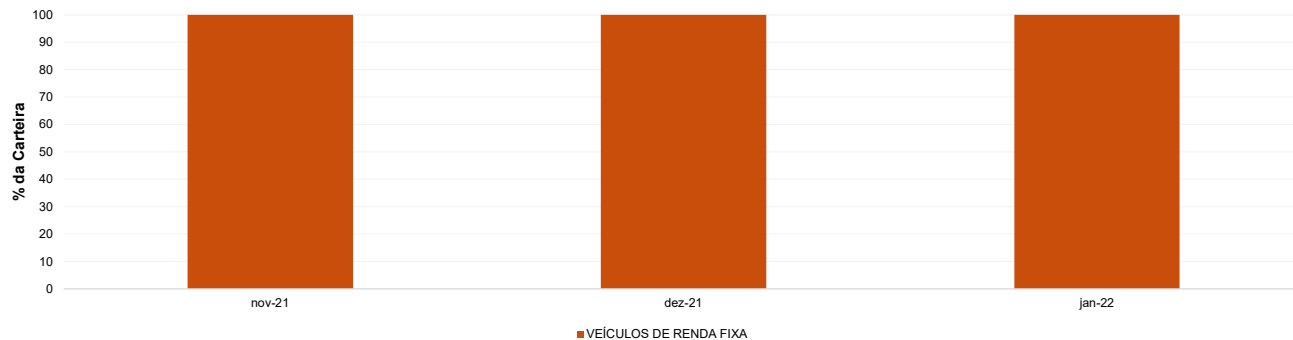
ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/01/2022

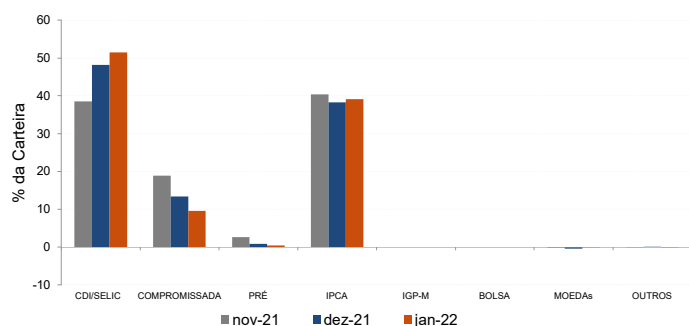
Distribuição da Carteira

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.

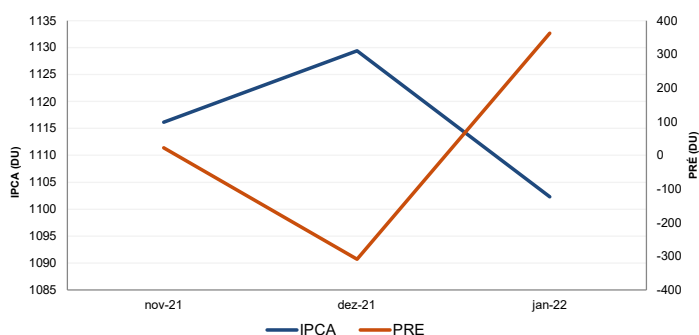
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/01/2022

Análises de Contrapartes

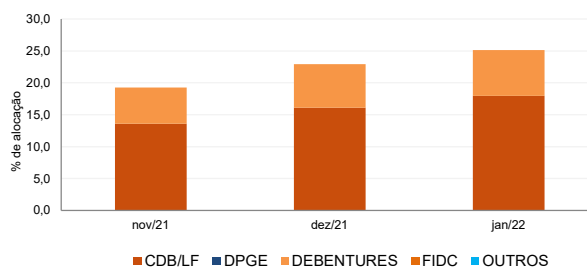
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	11.252,96	10,53	Faixa 1
BCO SAFRA SA	3.357,17	3,14	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	2.430,80	2,27	Faixa 2
BCO ITAU SA	987,52	0,92	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	778,19	0,73	Faixa 2
OMEGA GERACAO SA	670,86	0,63	Faixa 2
MOVIDA PARTICIPACOES	660,86	0,62	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	652,36	0,61	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	632,04	0,59	Faixa 2
CIA LOCACAO AMERICAS	590,51	0,55	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: 31/01/2022

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
LF CDI	01-fev-24	346.418	0,32%	CDI	BCO ITAU SA	26-jan-22	0,65%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
LF CDI	01-abr-24	346.807	0,32%	CDI	BCO ITAU SA	21-jan-22	0,66%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

