

## ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 25/02/2022

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	
<b>Renda Fixa</b>	<b>107.666.583,20</b>		<b>100%</b>		<b>1,20%</b>	<b>2,31%</b>	<b>2,57%</b>	<b>3,41%</b>	<b>3,97%</b>	<b>23,02%</b>	<b>56,42%</b>	
Benchmark:	CDI				0,75%	2,26%	3,81%	1,49%	5,65%	8,15%	14,19%	
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>66.333.493,02</b>		<b>61,61%</b>									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	44.512.348,85	41,34%	ALFA	5,58%	0,04%	0,87%	2,54%	4,26%	1,68%	6,19%	8,69%	14,62%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.176.372,58	1,09%	BRADESCO	5,75%	0,00%	0,73%	2,20%	3,72%	1,46%	5,51%	7,93%	13,87%
URCA FI MULT CRED PRIV	20.644.771,59	19,17%	SANTANDER	5,40%	0,04%	0,82%	2,56%	3,89%	1,76%	5,75%	8,20%	14,40%
Benchmark:	CDI				0,75%	2,26%	3,81%	1,49%	5,65%	8,15%	14,19%	
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>41.333.090,18</b>		<b>38,39%</b>									
ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF	41.333.090,18	38,39%		100%	1,32%	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI				0,75%	2,26%	3,81%	1,49%	5,65%	8,15%	14,19%	
<b>Total</b>	<b>107.666.583,20</b>		<b>100%</b>		<b>0,51%</b>	<b>0,76%</b>	<b>1,86%</b>	<b>2,97%</b>	<b>1,09%</b>	<b>3,47%</b>	<b>7,13%</b>	<b>41,21%</b>
Benchmark:	CDI				0,75%	2,26%	3,81%	1,49%	5,65%	8,15%	14,19%	

\* 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.

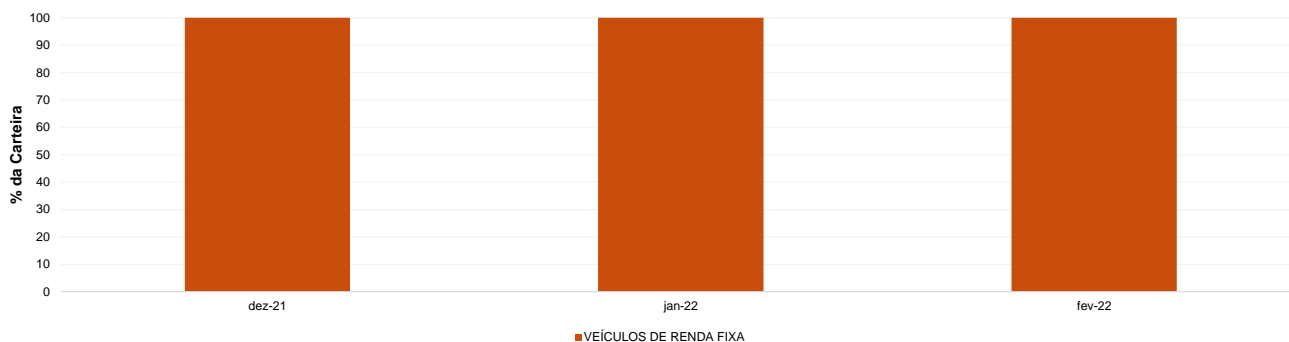
O valor total apresentado nesse relatório é o Patrimônio Líquido extraído através do arquivo XML do Plano.

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.

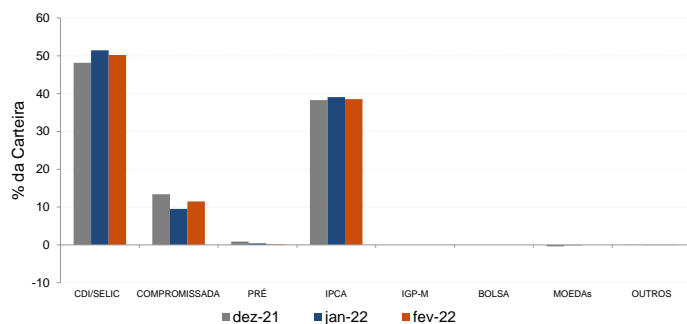
## Distribuição da Carteira

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.

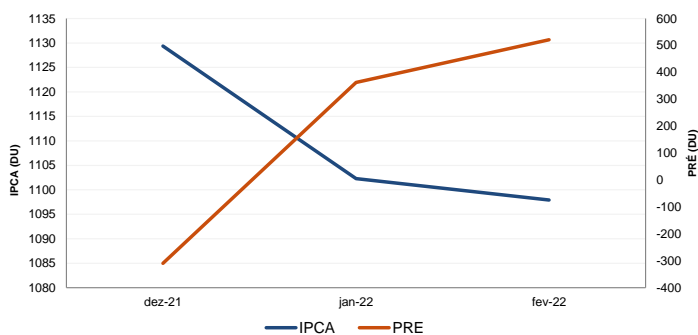
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 25/02/2022

## Análises de Contrapartes

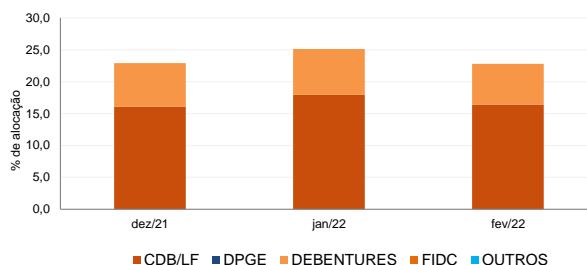
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	10.397,42	9,67	Faixa 1
BCO SAFRA SA	3.081,39	2,87	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	2.234,81	2,08	Faixa 2
BCO ITAU SA	901,67	0,84	Faixa 1
CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA ELETROB	713,59	0,66	Faixa 2
OMEGA GERACAO SA	592,62	0,55	Faixa 2
MOVIDA PARTICIPACOES	571,43	0,53	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SAC	568,25	0,53	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	555,03	0,52	Faixa 2
BCO ABC BRASIL SA	537,01	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
BCBF14	41,86	BCBF PARTICIPACOES S.A	Faixa 2	Faixa 1	22-set-25	CDI	2,65%	URCA FI MULT CRED PRIV



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 25/02/2022

## 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
TAEEC1	15-jan-27	156.773	0,15%	CDI	TRANSMISSORA ALIANCA ENERGIA ELET	01-fev-22	1,36%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2022-03-01	01-mar-22	3.178.696	2,96%	Selic		15-fev-22	0,08%	0,09%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2022-03-01	01-mar-22	223.144	0,21%	Selic		15-fev-22	0,08%	0,09%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
NTN-B 2050-08-15	15-ago-50	70.144	0,07%	IPCA		23-fev-22	5,78%	5,76%	URCA FI MULT CRED PRIV

