

ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/05/2022

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	ALOCAÇÃO (R\$)	GESTOR	% PL FUNDO	RISCO DE MERCADO	RENTABILIDADE*						
					1M	3M	6M	ANO	12M	24M	36M
Renda Fixa	112.808.021,56	100%			0,85%	4,20%	6,61%	7,75%	5,61%	29,63%	58,41%
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%
RF REFERENCIADO DI	69.717.033,49	61,80%									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	46.003.613,80	40,78%	ALFA	5,87%	1,10%	3,12%	5,74%	4,86%	8,79%	11,26%	16,41%
BRANCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.276.304,66	1,13%	BRANCO	6,07%	1,01%	2,77%	5,03%	4,27%	7,73%	9,99%	15,27%
URCA FI MULT CRED PRIV	22.437.115,03	19,89%	SANTANDER	5,72%	1,12%	2,95%	5,58%	4,76%	8,13%	10,68%	15,86%
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	43.090.988,07	38,20%									
ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF	43.090.988,07	38,20%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%
Total	112.808.021,56	100%			0,57%	3,48%	5,40%	4,61%	6,62%	10,45%	42,56%
Benchmark:	CDI				1,03%	2,81%	5,14%	4,34%	7,89%	10,24%	15,63%

- 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.

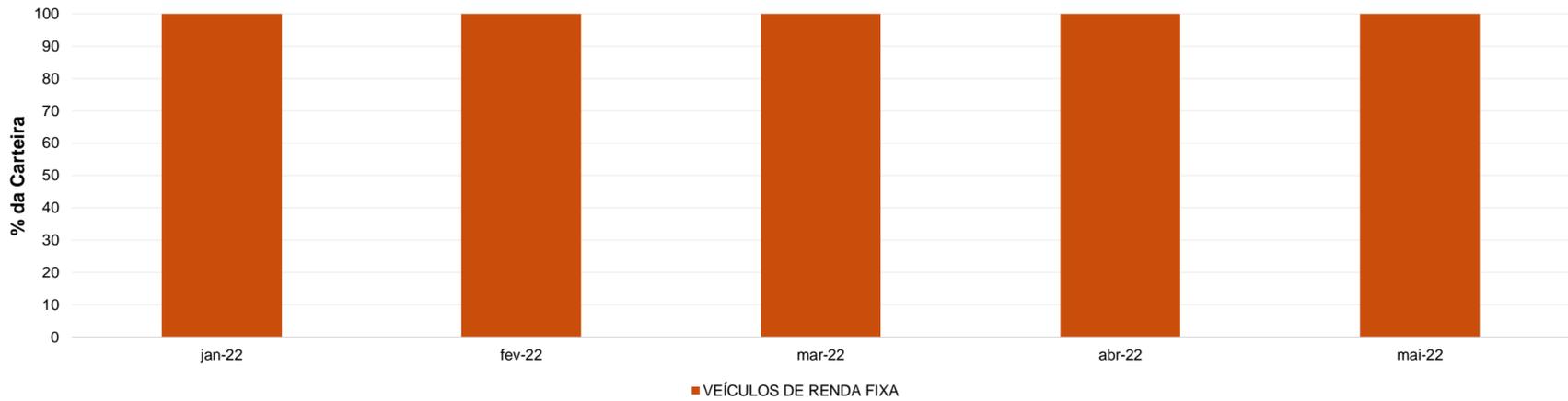
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

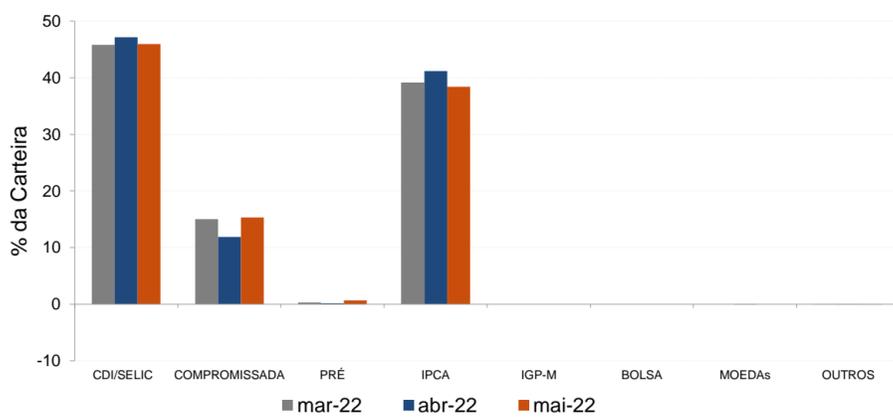
Distribuição da Carteira

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.

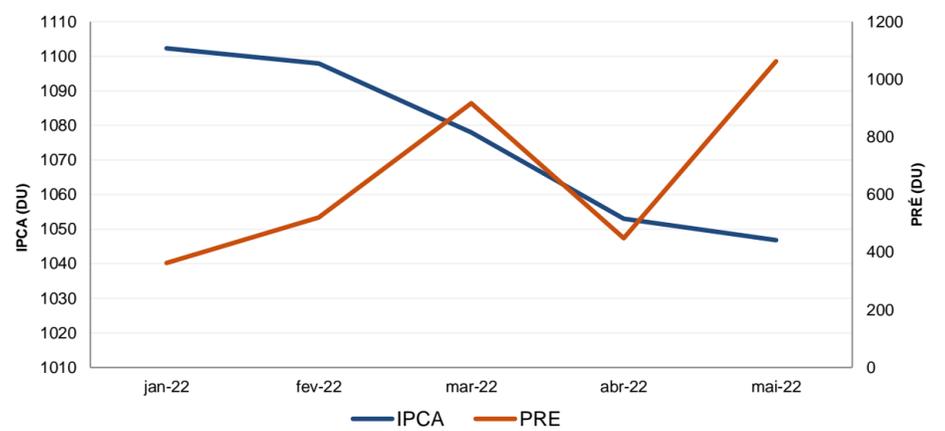
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/05/2022

Análises de Contrapartes

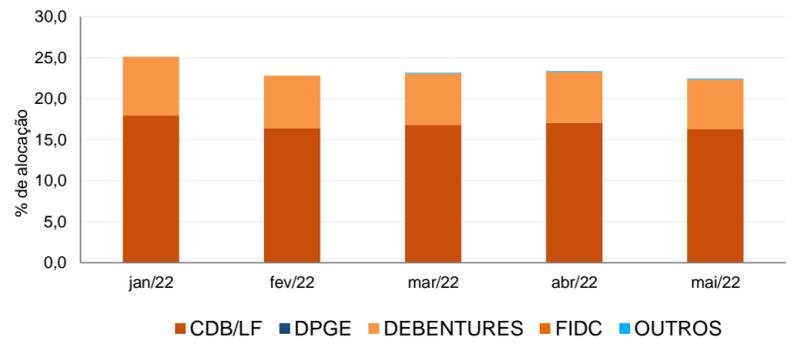
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	10.087,81	8,99	Faixa 1
BCO SAFRA SA	3.221,99	2,87	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	2.576,63	2,30	Faixa 2
BCO ITAU SA	1.337,32	1,19	Faixa 1
OMEGA GERACAO SA	617,52	0,55	Faixa 2
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	604,00	0,54	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SA	580,00	0,52	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA	563,75	0,50	Faixa 2
CIA LOCACAO AMERICAS	536,86	0,48	Faixa 2
BCO CITIBANK SA	533,18	0,48	Faixa 1

* 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: 31/05/2022

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
MRVEA8	24-ago-25	185.205	0,17%	CDI	MRV ENGENHARIA PARTICIPACOES SA	11-mai-22	1,84%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	61.868	0,06%	Selic		13-mai-22	7,00%	0,07%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	295.137	0,26%	Selic		13-mai-22	0,12%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	17.804	0,02%	Selic		12-mai-22	0,15%	0,15%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

