

ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 29/07/2022

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	116.352.380,20	100%				0,48%	1,75%	5,50%	5,85%	7,37%	9,59%	22,47%
Benchmark:	CDI					1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
RF REFERENCIADO DI	73.472.078,85	63,15%										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	46.768.451,73	40,20%	ALFA	6,50%		1,19%	3,41%	6,40%	7,25%	10,46%	13,20%	17,85%
BRANCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	1.436.915,16	1,23%	BRANCO	6,70%		1,01%	3,06%	5,62%	6,38%	9,20%	11,77%	16,41%
URCA FI MULT CRED PRIV	25.266.711,95	21,72%	SANTANDER	6,33%		1,08%	3,19%	5,91%	6,91%	9,59%	12,12%	16,99%
Benchmark:	CDI					1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	42.880.301,35	36,85%										
ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF	42.880.301,35	36,85%		100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%
Total	116.352.380,20	100%				0,74%	1,75%	5,50%	5,85%	7,37%	9,59%	24,62%
Benchmark:	CDI					1,03%	3,11%	5,72%	6,49%	9,39%	12,05%	16,79%

- 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.

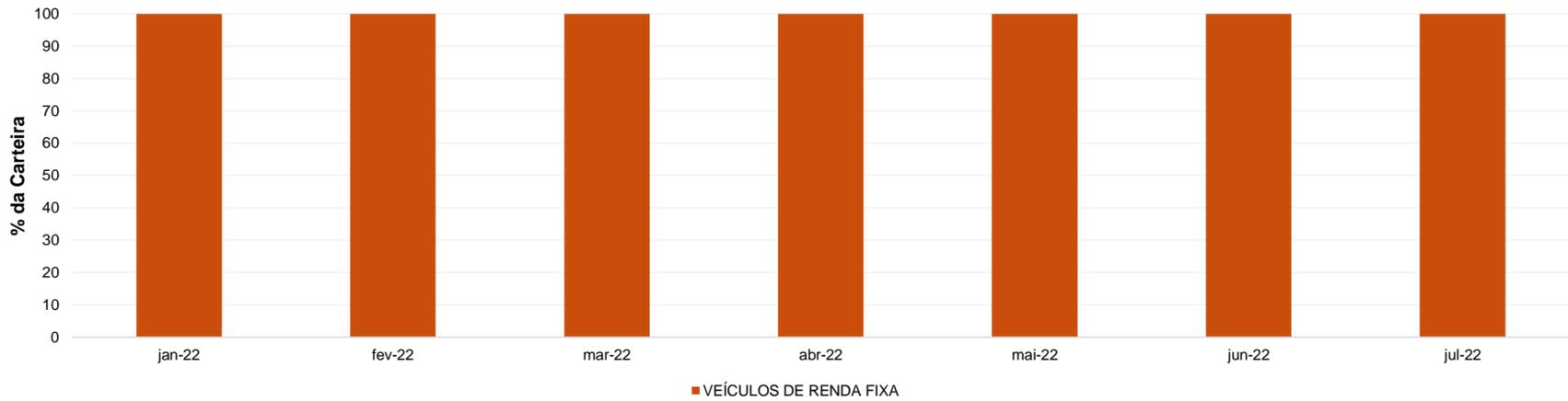
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

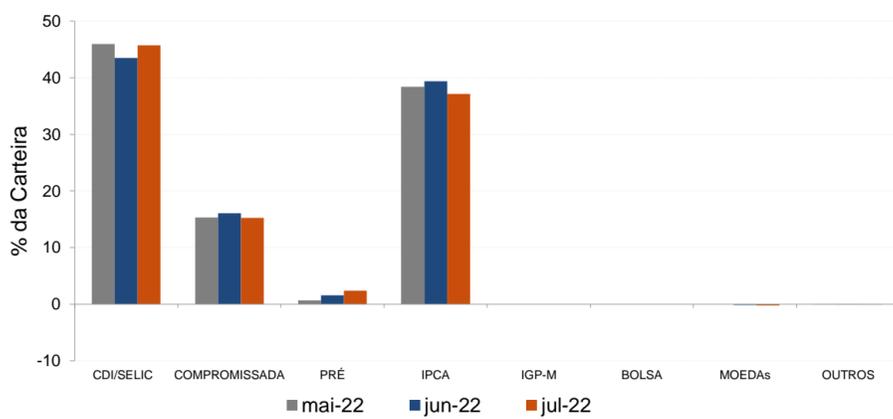
Distribuição da Carteira

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.

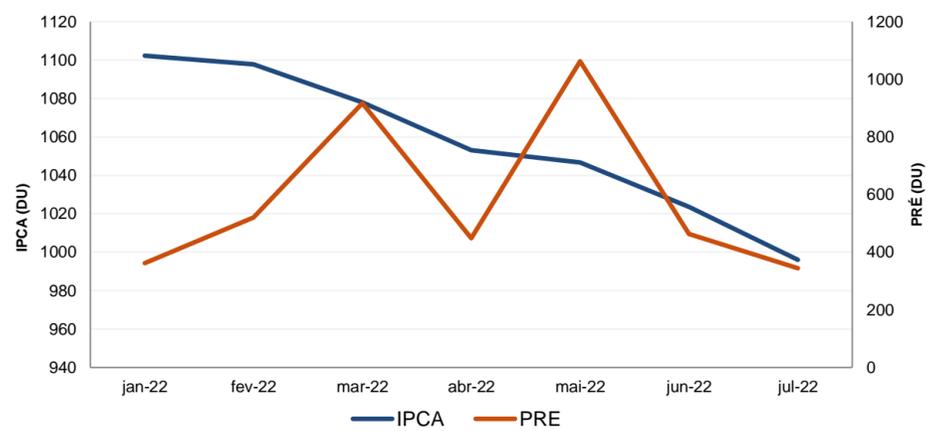
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 29/07/2022

Análises de Contrapartes

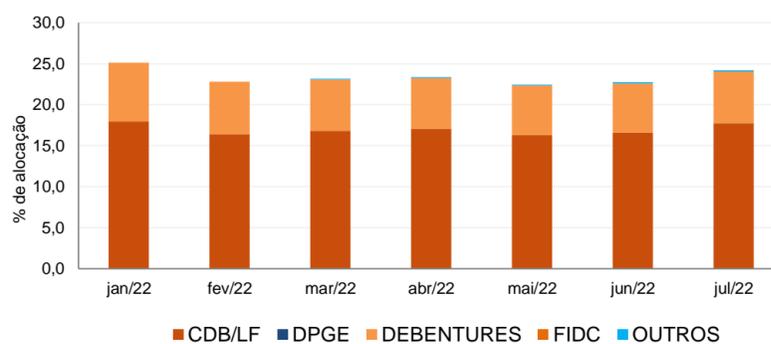
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	11.357,67	9,84	Faixa 1
BCO SAFRA SA	3.567,89	3,09	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	2.853,93	2,47	Faixa 2
BCO ITAU SA	1.495,67	1,30	Faixa 1
B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	715,32	0,62	Faixa 1
PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	681,81	0,59	Faixa 2
BCO ABC BRASIL SA	623,54	0,54	Faixa 2
BCO CITIBANK SA	589,57	0,51	Faixa 1
CIA LOCACAO AMERICAS	581,50	0,50	Faixa 1
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SA	546,64	0,47	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
TLPP27	79,79	TELEFONICA BRASIL SA	Sem Faixa	Faixa 1	12-jul-27	CDI	1,35%	URCA FI MULT CRED PRIV



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 29/07/2022

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
TLPP27	12-jul-27	79.786	0,07%	CDI	TELEFONICA BRASIL SA	14-jul-22	1,35%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

