

ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/08/2022

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	116.766.925,84	100%				0,91%	2,11%	5,66%	6,81%	8,80%	10,84%	23,59%
Benchmark:	CDI					1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	79.929.514,08	68,45%										
ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF	79.929.514,08	68,45%		100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI					1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
RF REFERENCIADO DI	36.837.411,76	31,55%										
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	23.477.268,41	20,11%	ALFA	3,17%		1,22%	3,53%	6,76%	8,56%	11,31%	14,41%	18,69%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	717.684,41	0,61%	BRADESCO	3,31%		1,15%	3,20%	6,06%	7,60%	10,00%	12,88%	17,17%
URCA FI MULT CRED PRIV	12.642.458,94	10,83%	SANTANDER	3,12%		1,34%	3,41%	6,46%	8,33%	10,60%	13,45%	18,01%
Benchmark:	CDI					1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%
Total	116.766.412,68	100%			2,33%	0,91%	2,11%	5,66%	6,81%	8,80%	10,84%	25,03%
Benchmark:	CDI					1,17%	3,25%	6,16%	7,74%	10,20%	13,18%	17,57%

- 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.

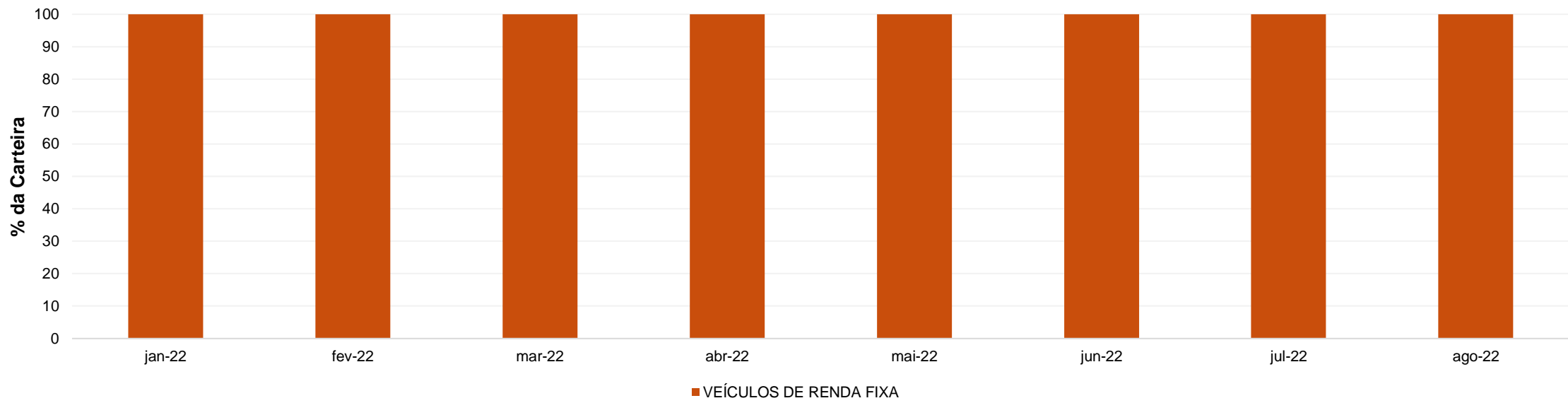
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

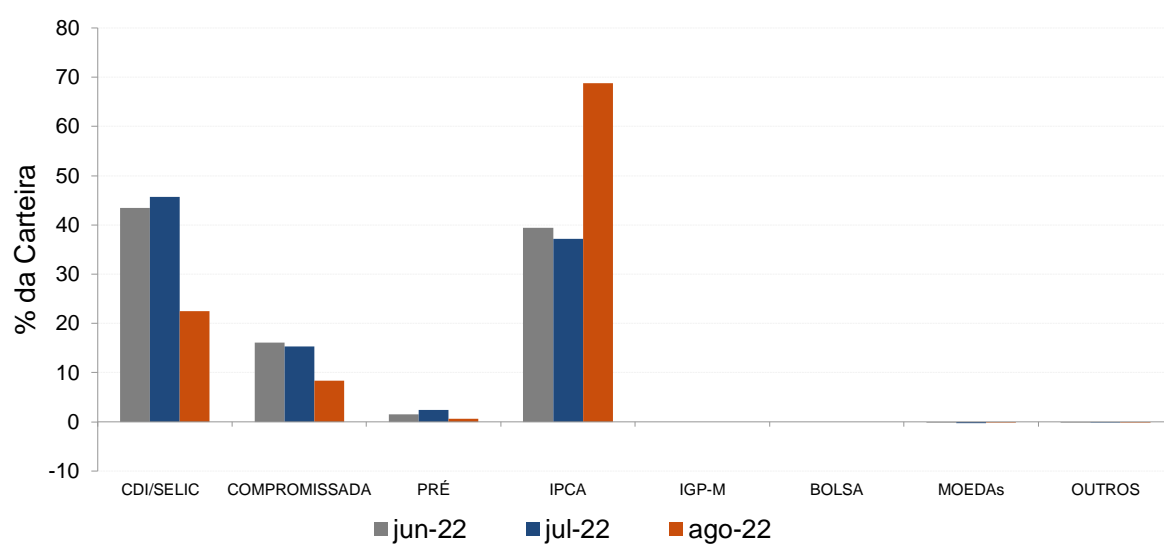
Distribuição da Carteira

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.

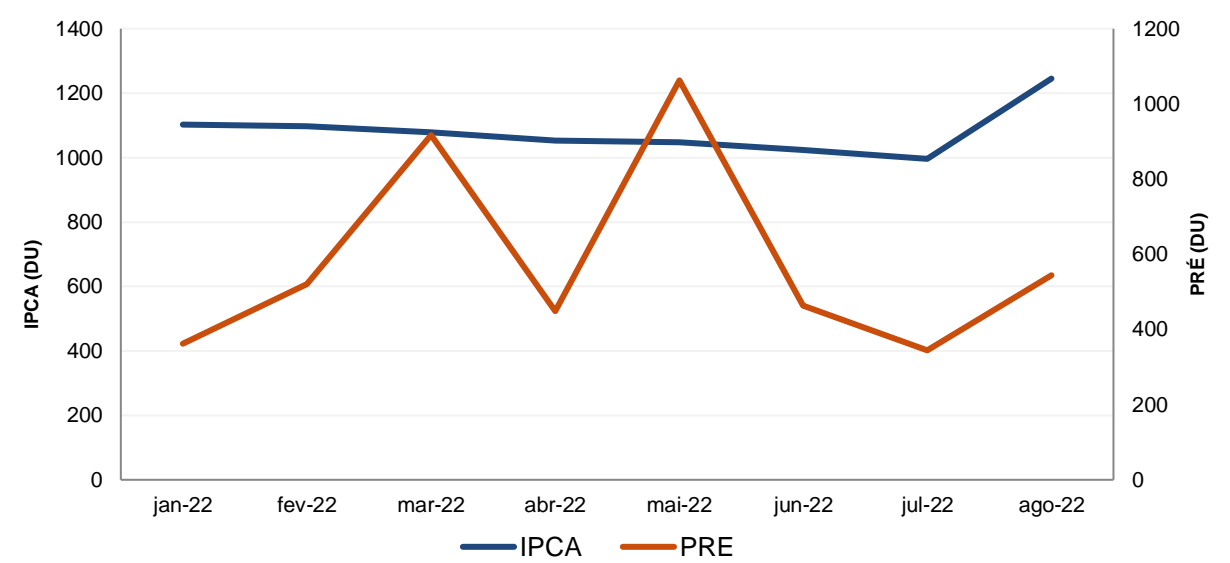
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/08/2022

Análises de Contrapartes

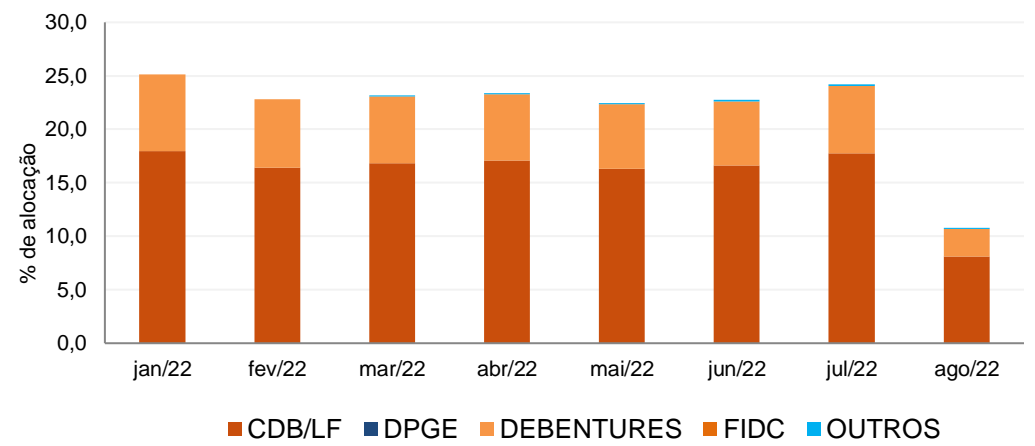
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	4.940,78	4,25	Faixa 1
BCO SAFRA SA	1.743,46	1,50	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	1.393,00	1,20	Faixa 2
BCO ITAU SA	743,33	0,64	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA	307,89	0,26	Faixa 2
BCO CITIBANK SA	291,18	0,25	Faixa 1
OMEGA GERACAO SA	270,02	0,23	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SA	269,93	0,23	Faixa 1
MOVIDA PARTICIPACOES	269,81	0,23	Faixa 2
REDE D OR SAO LUIZ SA	232,71	0,20	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: 31/08/2022

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
BSA316	05-ago-27	63.164	0,05%	CDI	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	09-ago-22	1,30%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
CSBR11	10-dez-25	13.561	0,01%	CDI	CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÔES	04-ago-22	3,02%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
ITSA15	08-ago-25	56.864	0,05%	CDI	ITAUSA INVESTS ITAU SA	10-ago-22	1,12%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV
ITSA25	08-ago-25	22.707	0,02%	CDI	ITAUSA INVESTS ITAU SA	10-ago-22	1,12%	Faixa 2	URCA FI MULT CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2025-09-01	01-set-25	664.154	0,57%	Selic		03-ago-22	0,11%	0,11%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	5.948.983	5,12%	IPCA		29-ago-22	5,81%	5,90%	ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	5.303.048	4,56%	IPCA		29-ago-22	5,81%	5,90%	ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	6.820.517	5,87%	IPCA		30-ago-22	5,78%	5,85%	ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	4.149.349	3,57%	IPCA		30-ago-22	5,78%	5,85%	ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF
NTN-B 2030-08-15	15-ago-30	281.176	0,24%	IPCA		30-ago-22	5,78%	5,85%	ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF
NTN-B 2032-08-15	15-ago-32	15.002.074	12,91%	IPCA		30-ago-22	5,86%	5,91%	ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF

