

## ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 30/09/2022

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
<b>Renda Fixa</b>	<b>117.830.589,29</b>	<b>100%</b>			<b>1,00%</b>	<b>2,41%</b>	<b>4,79%</b>	<b>7,88%</b>	<b>9,50%</b>	<b>12,45%</b>	<b>24,82%</b>
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
<b>CARTEIRA PRÓPRIA RF</b>	<b>80.657.960,35</b>	<b>68,45%</b>									
ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF	80.657.960,35	68,45%		100%	-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
<b>RF REFERENCIADO DI</b>	<b>37.172.628,94</b>	<b>31,55%</b>									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	23.529.932,40	19,97%	ALFA	3,21%	1,14%	3,59%	6,73%	9,80%	12,05%	15,73%	19,49%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	732.314,25	0,62%	BRADESCO	3,34%	1,06%	3,26%	6,22%	8,74%	10,69%	13,91%	17,87%
URCA FI MULT CRED PRIV	12.910.382,29	10,96%	SANTANDER	3,16%	1,14%	3,60%	6,57%	9,57%	11,38%	14,85%	18,65%
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%
<b>Total</b>	<b>117.829.662,55</b>	<b>100%</b>			<b>1,33%</b>	<b>2,44%</b>	<b>4,82%</b>	<b>7,92%</b>	<b>9,54%</b>	<b>12,48%</b>	<b>25,68%</b>
Benchmark:	CDI				1,07%	3,31%	6,31%	8,89%	10,90%	14,21%	18,28%

- 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.

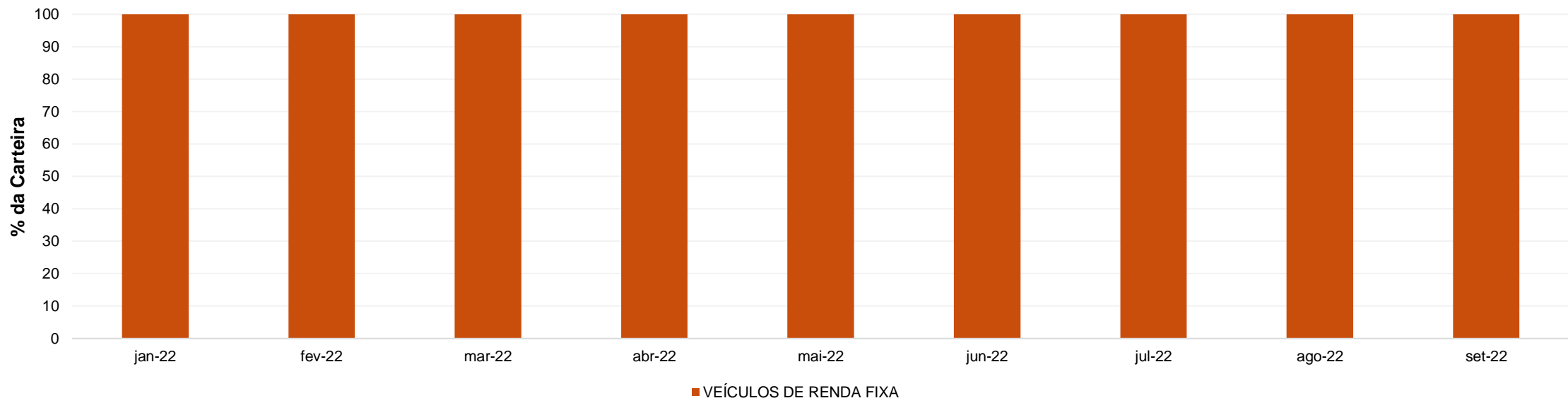
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

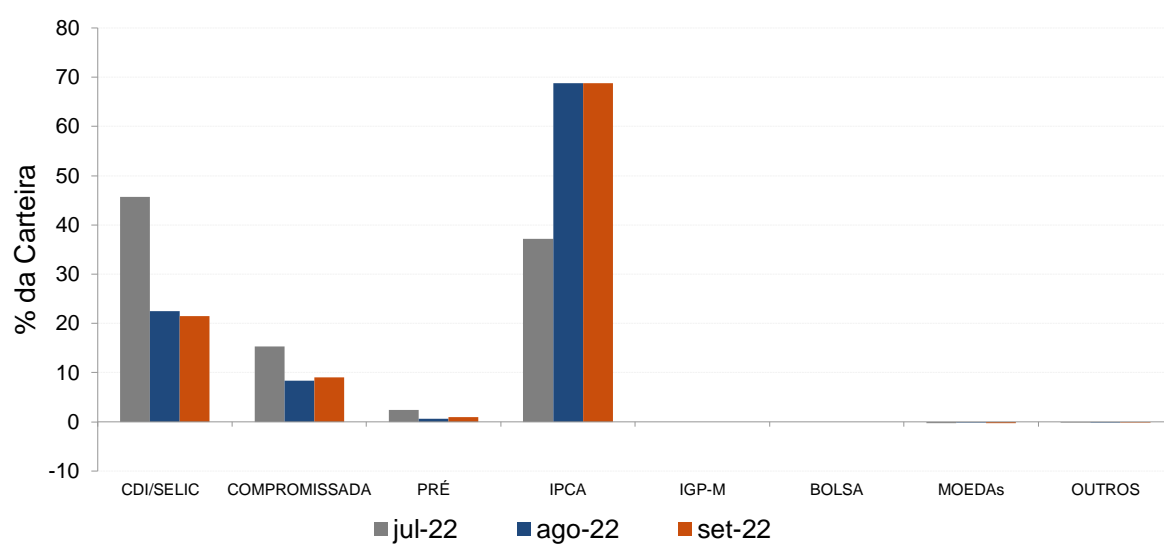
## Distribuição da Carteira

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.

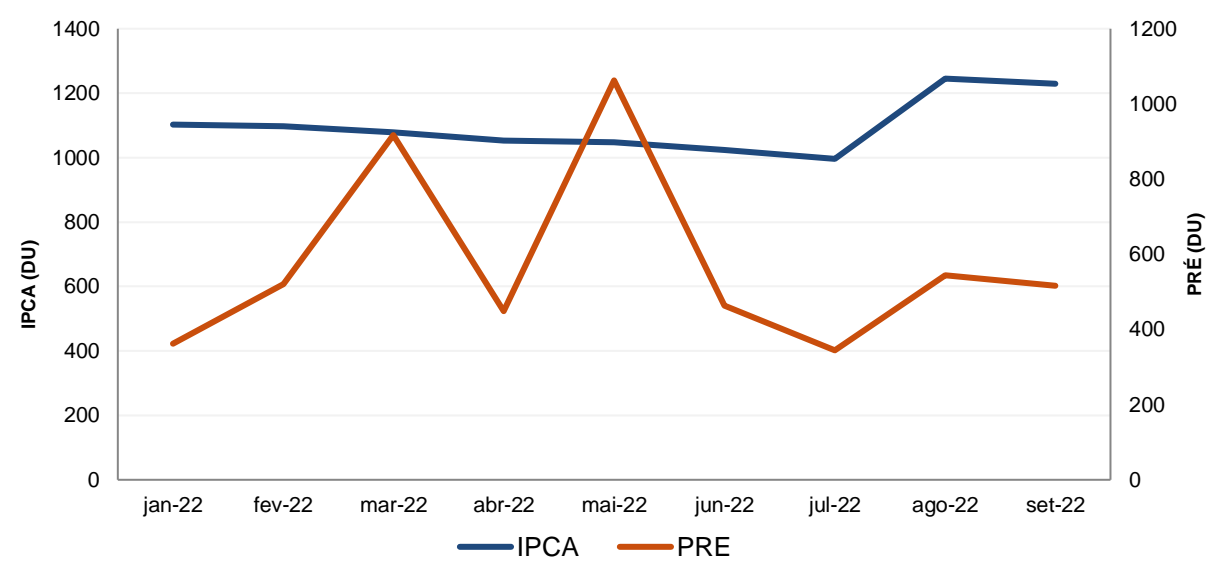
### Evolução do Patrimônio Líquido



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



### Evolução da Duration



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 30/09/2022

## Análises de Contrapartes

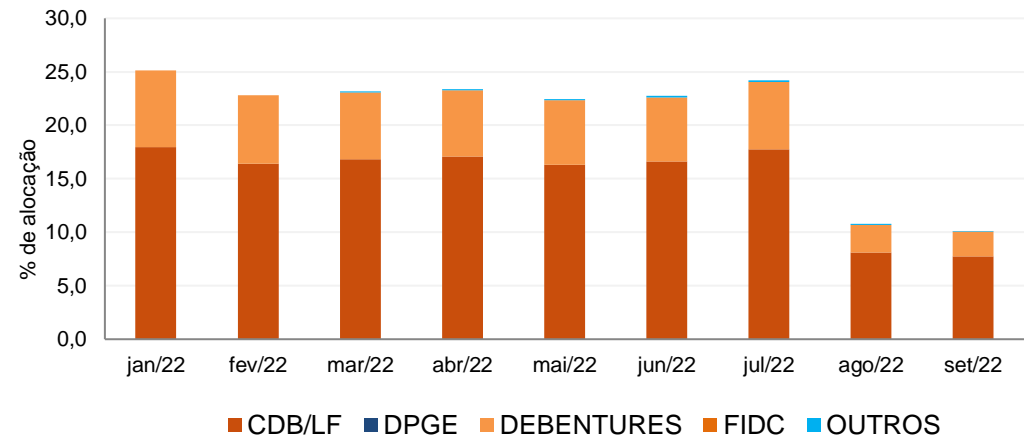
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e de suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo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

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

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	4.539,60	3,87	Faixa 1
BCO SAFRA SA	1.763,58	1,50	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	1.409,53	1,20	Faixa 2
BCO ITAU SA	755,28	0,64	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA	311,16	0,27	Faixa 2
BCO CITIBANK SA	294,11	0,25	Faixa 1
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SA	276,56	0,24	Faixa 1
MOVIDA PARTICIPACOES	268,70	0,23	Faixa 2
OMEGA GERACAO SA	258,14	0,22	Faixa 2
REDE D OR SAO LUIZ SA	237,93	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: 30/09/2022

## 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 Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador	Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	71.741	0,06%	Selic	06-set-22	0,01%	0,01%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	570.958	0,49%	Selic	01-set-22	5,00%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	176.342	0,15%	Selic	29-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	48.200	0,04%	Selic	29-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2024-09-01	01-set-24	13.716	0,01%	Selic	23-set-22	0,03%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	410.656	0,35%	Selic	22-set-22	0,09%	0,09%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	195.551	0,17%	Selic	05-set-22	0,10%	0,10%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2028-03-01	01-mar-28	47.833	0,04%	Selic	23-set-22	0,17%	0,17%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

