

ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/10/2022

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	118.363.113,90	100%			1,28%	3,22%	5,03%	9,26%	11,39%	13,81%	26,42%
Benchmark:	CDI				1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%
CARTEIRA PRÓPRIA RF	81.779.005,03	69,09%									
ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF	81.779.005,03	69,09%	100%		-	-	-	-	-	-	-
Benchmark:	CDI				1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%
RF REFERENCIADO DI	36.584.108,87	30,91%									
ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP	23.118.911,97	19,53%	ALFA	3,15%	1,08%	3,48%	7,01%	10,98%	12,71%	16,79%	20,21%
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	721.762,25	0,61%	BRADESCO	3,26%	1,01%	3,26%	6,41%	9,84%	11,28%	14,88%	18,49%
URCA FI MULT CRED PRIV	12.743.434,64	10,77%	SANTANDER	3,08%	1,16%	3,68%	6,98%	10,84%	12,54%	16,06%	19,37%
Benchmark:	CDI				1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%
Total	118.362.311,19	100%			0,86%	1,31%	3,29%	5,10%	9,33%	11,46%	26,68%
Benchmark:	CDI				1,02%	3,30%	6,51%	10,00%	11,49%	15,20%	18,91%

- 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.

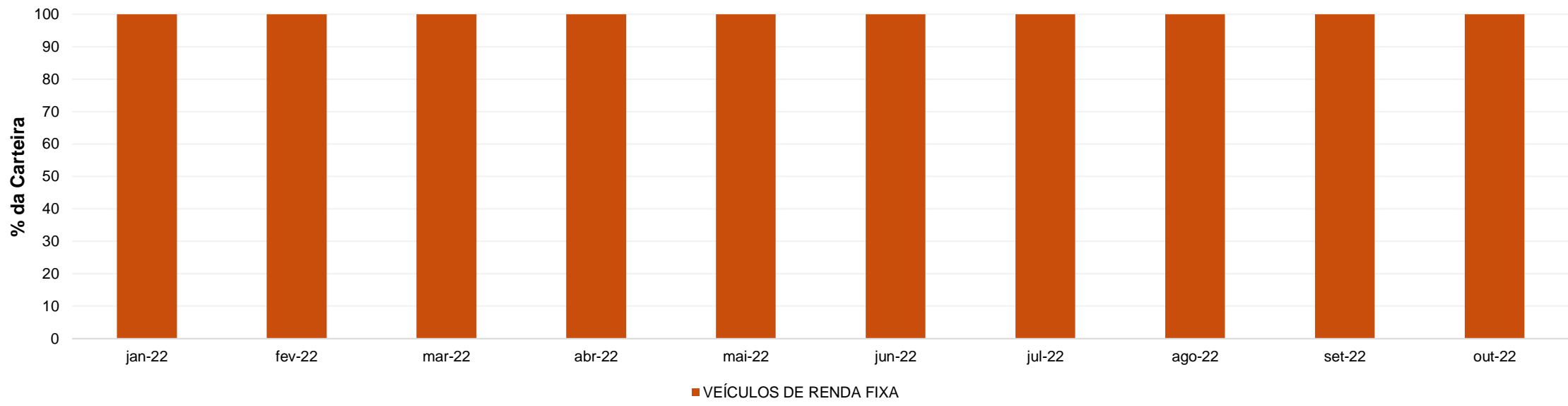
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

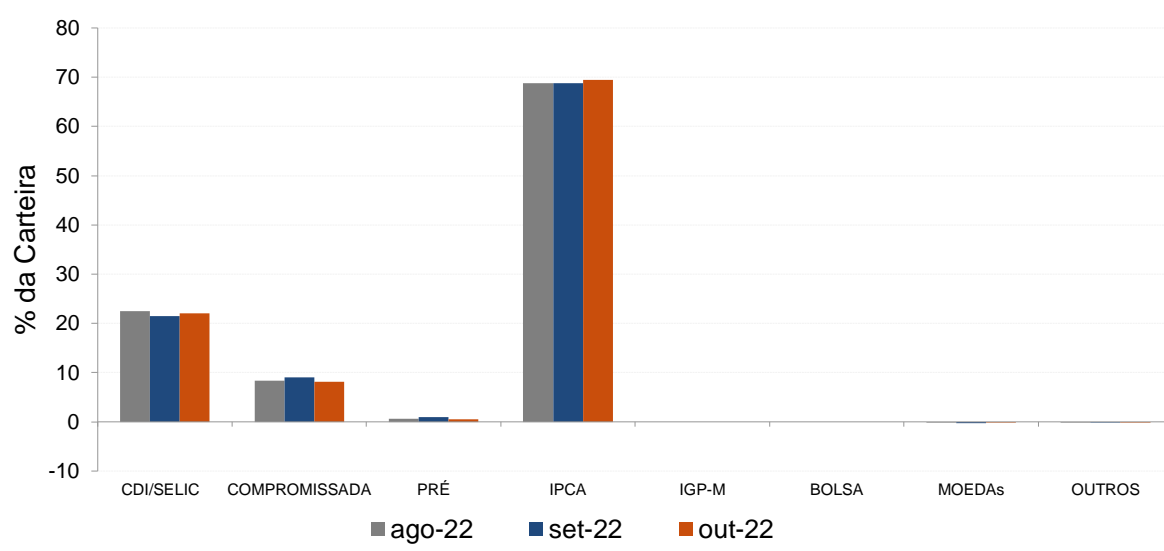
Distribuição da Carteira

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.

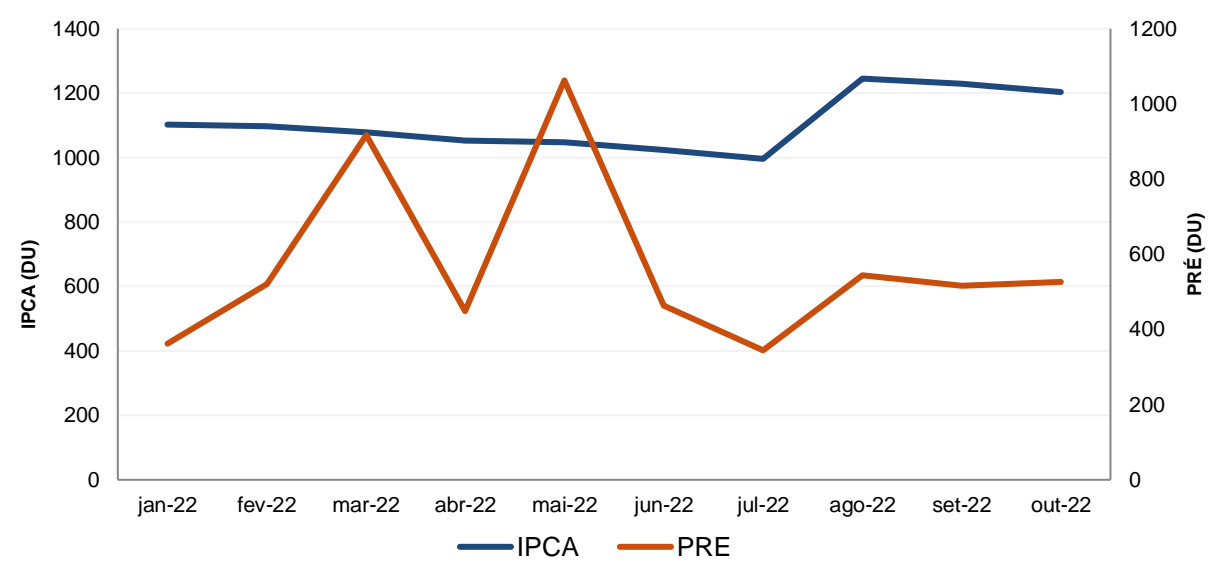
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/10/2022

Análises de Contrapartes

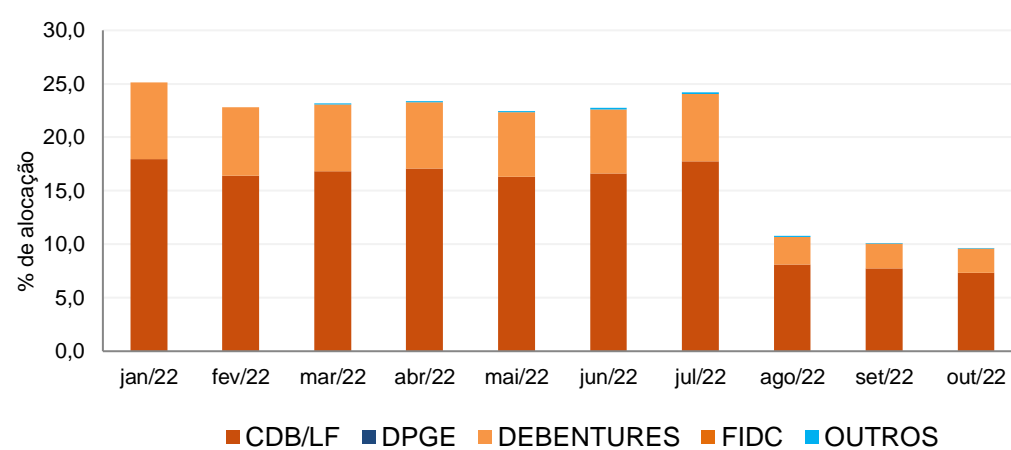
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	4.490,67	3,81	Faixa 1
BCO SAFRA SA	1.451,60	1,23	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA)	1.382,92	1,17	Faixa 2
BCO ITAU SA	741,78	0,63	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA	303,79	0,26	Faixa 2
CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÕES LTDA	289,94	0,25	Sem Faixa
BCO CITIBANK SA	287,30	0,24	Faixa 1
DIAGNOSTICOS AMERICA SA	272,00	0,23	Faixa 1
OMEGA GERACAO SA	256,70	0,22	Faixa 2
COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SA	235,02	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: 31/10/2022

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
ASAI14	26-nov-27	13.379	0,01%	CDI	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	17-out-22	1,62%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ASAI14	26-nov-27	13.344	0,01%	CDI	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	17-out-22	1,62%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ASAI22	20-mai-28	15.197	0,01%	CDI	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	19-out-22	1,69%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ASAI22	20-mai-28	11.001	0,01%	CDI	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	17-out-22	1,70%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
CSBR11	10-dez-25	66.484	0,06%	CDI	CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÃO	06-out-22	2,74%	Faixa 2	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
DASAA5	30-out-26	52.534	0,04%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	19-out-22	1,44%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
DASAA5	30-out-26	23.574	0,02%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	24-out-22	1,43%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
DASAA5	30-out-26	11.191	0,01%	CDI	DIAGNOSTICOS AMERICA SA	20-out-22	1,44%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ELET22	25-abr-24	10.573	0,01%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EL	20-out-22	0,95%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ELET22	25-abr-24	10.573	0,01%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EL	20-out-22	0,95%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ELET22	25-abr-24	10.573	0,01%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EL	20-out-22	0,95%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV
ELET22	25-abr-24	6.666	0,01%	CDI	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRA SA EL	21-out-22	0,96%	Faixa 1	URCA FI MULT CRED PRIV

Títulos Públicos	Vencimento	Valor	Valor (% Cart.)	Indexador		Data Compra	Tx de Compra	Tx Ind. Anbima	Veículo
LFT 2023-09-01	01-set-23	316.225	0,27%	Selic		18-out-22	0,01%	0,01%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2023-09-01	01-set-23	233.377	0,20%	Selic		07-out-22	0,01%	0,01%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	759.465	0,64%	Selic		21-out-22	7,00%	0,07%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2025-09-01	01-set-25	475.636	0,40%	Selic		06-out-22	0,08%	0,08%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2026-03-01	01-mar-26	387.729	0,33%	Selic		18-out-22	0,11%	0,00%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP
LFT 2026-09-01	01-set-26	387.540	0,33%	Selic		18-out-22	0,11%	0,10%	ALFA ITAIPAVA FI MULT CRED PRIV IP

