

ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 28/04/2023

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 | 115.333.112,29 | 100% | | | | 1,39% | 4,55% | 5,93% | 5,34% | 11,21% | 18,04% | 24,01% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,92% | 3,04% | 6,44% | 4,20% | 13,37% | 21,40% | 24,00% |
| Renda Fixa CDI | 31.344.058,06 | 27,18% | | | 0,12% | | | | | | | |
| ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP | 19.764.218,50 | 17,14% | ALFA | 2,57% | 0,02% | 0,91% | 3,00% | 6,51% | 4,17% | 13,98% | 23,04% | 25,80% |
| BRANDESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV | 620.207,21 | 0,54% | BRANDESCO | 2,63% | 0,00% | 0,91% | 3,01% | 6,37% | 4,15% | 13,19% | 21,03% | 23,53% |
| URCA FI MULT CRED PRIV | 10.959.632,35 | 9,50% | SANTANDER | 2,50% | 0,20% | 0,98% | 3,14% | 6,46% | 4,26% | 13,90% | 22,20% | 25,21% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,92% | 3,04% | 6,44% | 4,20% | 13,37% | 21,40% | 24,00% |
| CARTEIRA PRÓPRIA RF | 83.989.054,23 | 72,82% | | | | | | | | | | |
| ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF | 83.989.054,23 | 72,82% | | 100% | | - | - | - | - | - | - | - |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,92% | 3,04% | 6,44% | 4,20% | 13,37% | 21,40% | 24,00% |
| Total | 115.332.089,02 | 100% | | | 0,69% | 1,59% | 4,76% | 6,14% | 5,55% | 11,95% | 18,82% | 24,83% |
| Benchmark: | CDI | | | | | 0,92% | 3,04% | 6,44% | 4,20% | 13,37% | 21,40% | 24,00% |

- 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.

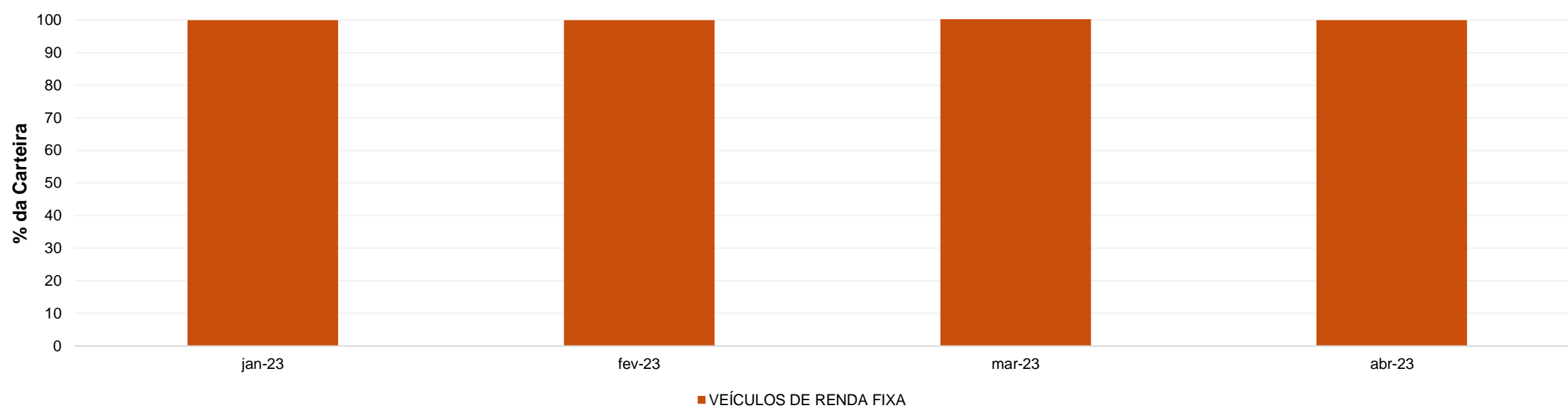
Os dados aqui apresentados foram obtidos junto a fontes públicas, nas quais a ADITUS deposita sua confiança. A ADITUS não se responsabiliza pela acurácia de tais dados.

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

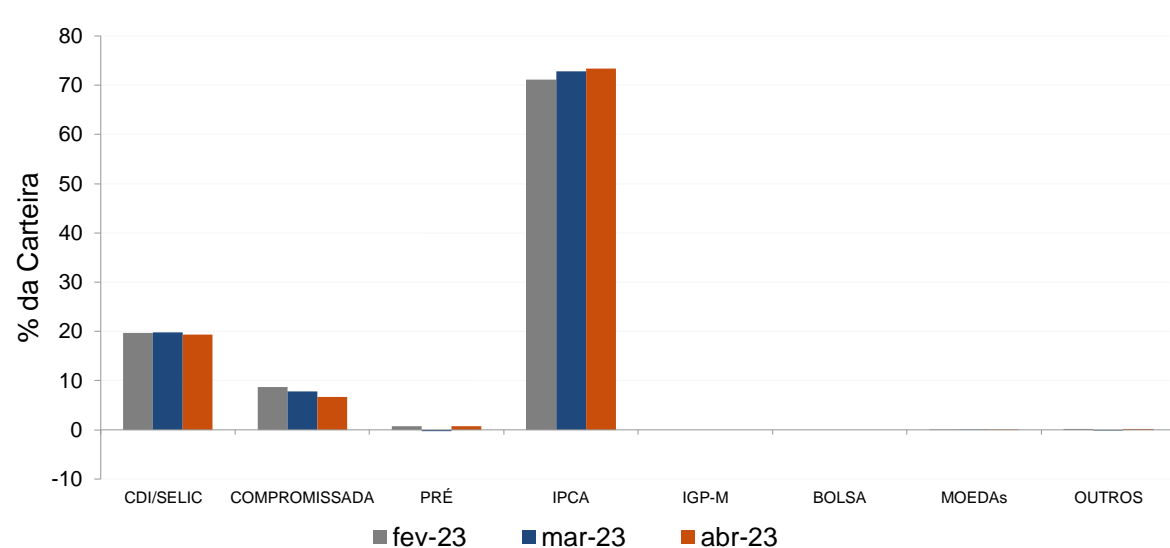
Distribuição da Carteira

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.

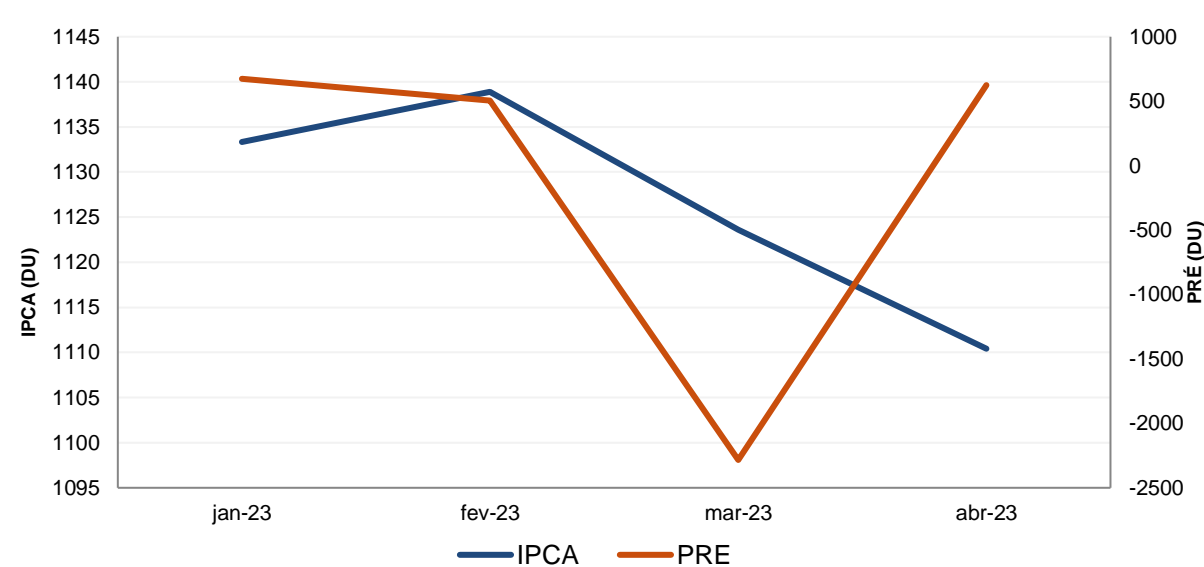
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 28/04/2023

Análises de Contrapartes

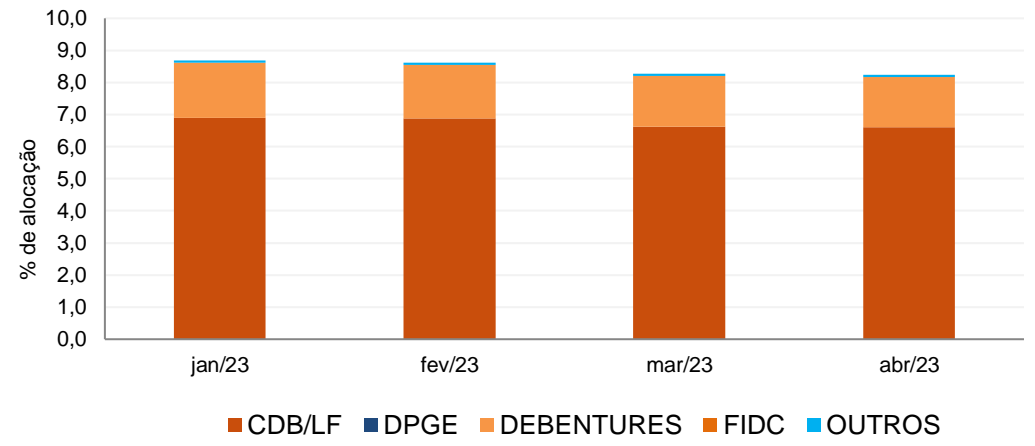
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

| Nome | MtM* | % | Faixa de Risco de Crédito |
|---|----------|------|---------------------------|
| BCO BRADESCO SA | 4.149,49 | 3,62 | Faixa 1 |
| BCO SAFRA SA | 1.181,01 | 1,03 | Faixa 1 |
| BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA | 1.125,85 | 0,98 | Faixa 2 |
| BCO ITAU SA | 622,42 | 0,54 | Faixa 1 |
| BCO ABC BRASIL SA | 248,91 | 0,22 | Faixa 2 |
| BCO CITIBANK SA | 232,69 | 0,20 | Faixa 1 |
| COMPANHIA SANEAMENTO BASICO ESTADO SA | 189,39 | 0,17 | Faixa 1 |
| SENDAS DISTRIBUIDORA S.A. | 180,93 | 0,16 | Faixa 1 |
| CS BRASIL PARTICIPAÇÕES E LOCAÇÕES LTDA | 168,10 | 0,15 | Sem Faixa |
| COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS | 166,38 | 0,15 | 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: 28/04/2023

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 2024-09-01 | 01-set-24 | 627.338 | 0,55% | Selic | 13-abr-23 | 0,02% | 0,00% | URCA FI MULT CRED PRIV |
| LFT 2024-09-01 | 01-set-24 | 258.555 | 0,23% | Selic | 06-abr-23 | 0,02% | 0,00% | ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF |

