

ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/08/2023

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	122.961.310,44	100%				0,33%	2,98%	8,66%	10,69%	13,86%	23,84%	26,15%	
Benchmark:	CDI					1,14%	3,32%	6,68%	8,87%	13,55%	25,14%	28,52%	
Renda Fixa CDI	33.514.381,62	27,26%			0,04%								
ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IP	22.368.419,89	18,19%	ALFA	2,36%	0,01%	1,22%	3,56%	6,99%	9,15%	14,09%	27,00%	30,53%	
BRADESCO FI MULT IPANEMA CRED PRIV	594.260,05	0,48%	BRADESCO	2,41%	0,00%	1,14%	3,29%	6,60%	8,77%	13,39%	24,73%	28,00%	
URCA FI MULT CRED PRIV	10.551.701,68	8,58%	SANTANDER	2,29%	0,12%	1,16%	3,59%	7,38%	9,40%	14,30%	26,41%	29,67%	
Benchmark:	CDI					1,14%	3,32%	6,68%	8,87%	13,55%	25,14%	28,52%	
CARTEIRA PRÓPRIA RF	89.446.928,82	72,74%											
ELETROS PGA CARTEIRA PROPRIA RF	89.446.928,82	72,74%		100%		-	-	-	-	-	-	-	
Benchmark:	CDI					1,14%	3,32%	6,68%	8,87%	13,55%	25,14%	28,52%	
Total	122.960.268,97	100%				0,97%	0,33%	2,98%	8,66%	10,69%	13,86%	24,41%	26,73%
Benchmark:	CDI					1,14%	3,32%	6,68%	8,87%	13,55%	25,14%	28,52%	

- 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.

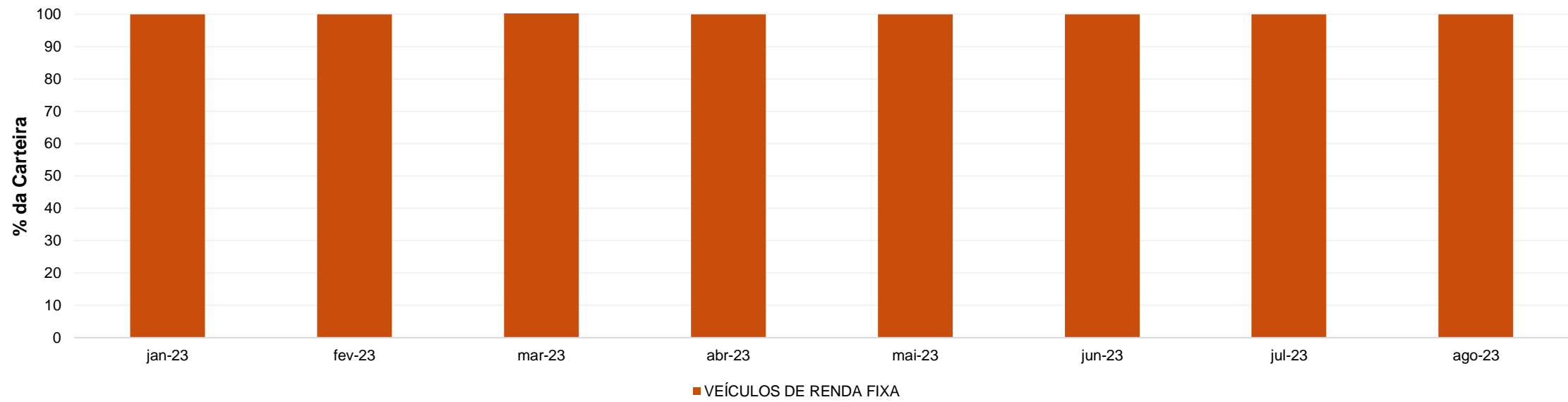
Este documento é propriedade da ADITUS Consultoria Financeira e sua reprodução requer autorização expressa da mesma.

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.

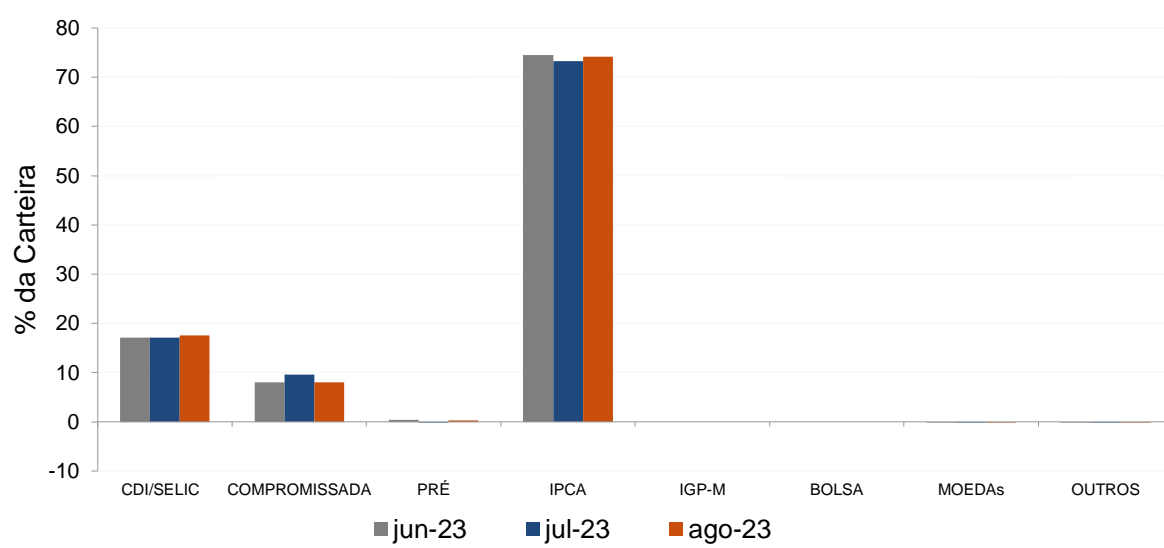
Distribuição da Carteira

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.

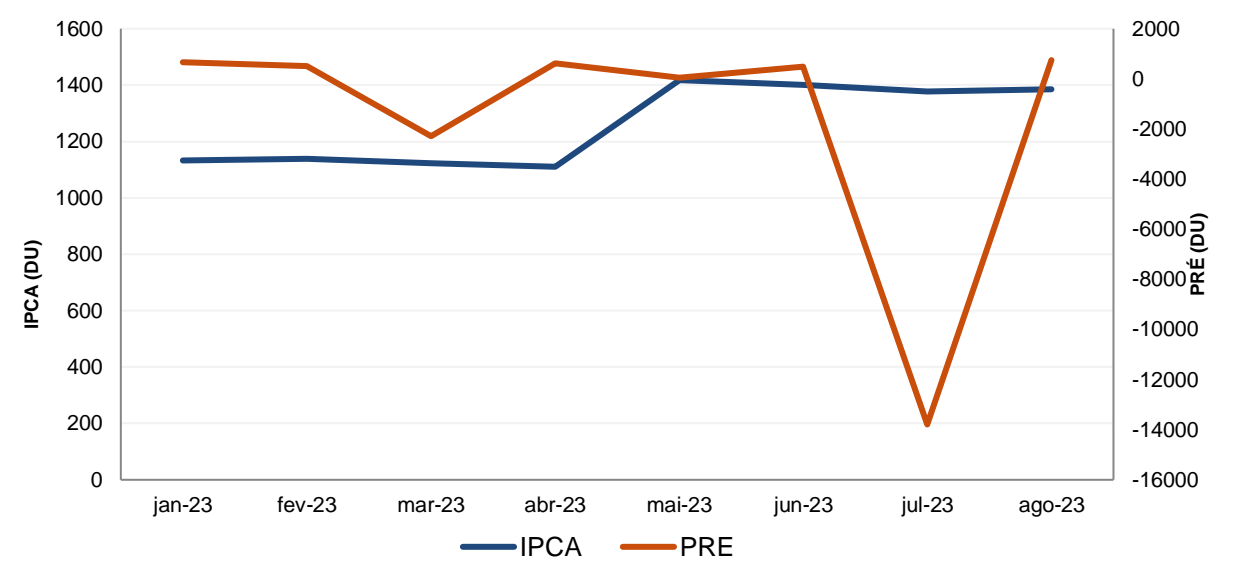
Evolução do Patrimônio Líquido



Exposição Por Fator de Risco (Ativos a Mercado)



Evolução da Duration



ELETROS - ELETROS PGA

Data-base: 31/08/2023

Análises de Contrapartes

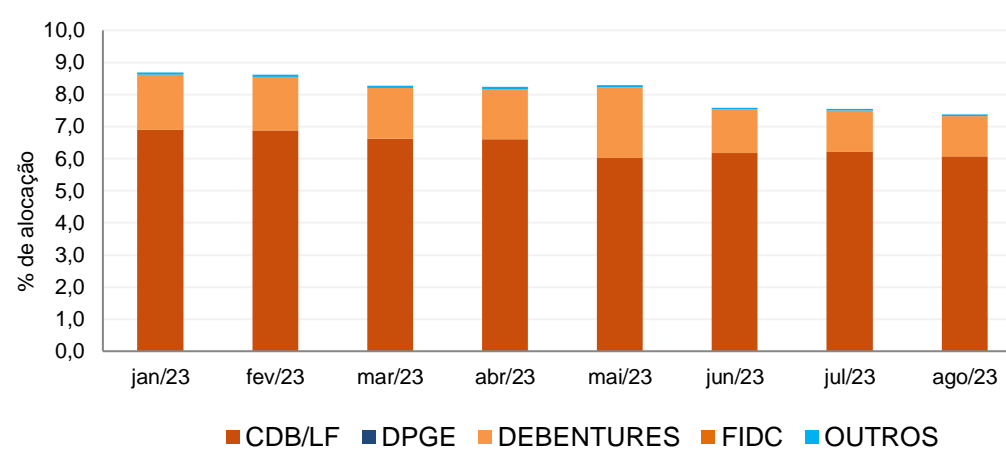
A tabela seguinte apresenta as 10 maiores contrapartes privadas da carteira, incluindo emissores de crédito privado e de ações e suas respectivas faixas de risco de crédito. O gráfico de alocação mostra a evolução da exposição da carteira a crédito e a distribuição desses ativos, por tipo, ao longo do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

Empresas Emissoras e Distribuição por Faixa de Risco de Crédito

Nome	MtM*	%	Faixa de Risco de Crédito
BCO BRADESCO SA	3.272,30	2,68	Faixa 1
BCO ALFA INVEST SA (EX BCO REAL INVEST SA	2.225,26	1,83	Faixa 2
BCO SAFRA SA	1.085,82	0,89	Faixa 1
BCO ITAU SA	585,05	0,48	Faixa 1
BCO ABC BRASIL SA	225,59	0,19	Faixa 2
MOVIDA PARTICIPACOES	213,85	0,18	Faixa 2
COMPANHIA LOCAÇÃO AMÉRICAS	154,58	0,13	Faixa 1
SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	153,17	0,13	Faixa 1
REDE D OR SAO LUIZ SA	130,75	0,11	Faixa 1
ENERGISA SA	116,38	0,10	Faixa 2

* 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: 31/08/2023

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 2023-09-01	01-set-23	368.113	0,30%	Selic	22-ago-23	6,00%	0,05%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
LFT 2026-03-01	01-mar-26	627.782	0,52%	Selic	01-ago-23	0,08%	0,00%	URCA FI MULT CRED PRIV
LFT 2027-03-01	01-mar-27	1.613.898	1,32%	Selic	23-ago-23	0,12%	0,13%	ALFA ITAIPAVA-FI MULT - CRED PRIV - IF
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	247.116	0,20%	IPCA	08-ago-23	5,54%	5,47%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2025-05-15	15-mai-25	18.957	0,02%	IPCA	28-ago-23	5,60%	5,56%	URCA FI MULT CRED PRIV
NTN-B 2026-08-15	15-ago-26	11.320	0,01%	IPCA	28-ago-23	5,07%	5,05%	URCA FI MULT CRED PRIV

