

PLANO TRANSITÓRIO - LÂMINA JUNHO/2022

CNPB: 1996.0052-19

Patrocinadora: CELESC Distribuição S/A

Modalidade: Benefício Definido

O mês foi marcado pela forte queda nas principais bolsas globais devido às preocupações com o ritmo de crescimento global e a persistência do cenário inflacionário. O índice de ações americano, S&P500 caiu 8,4% no período, enquanto o índice de ações europeu Stoxx600 teve queda de 8,2%. Exceção para a China, que afrouxou as medidas restritivas em função da melhora em relação a onda de contágio da Covid-19. No Brasil, os ativos de risco também tiveram resultado negativo no mês. Além do cenário externo, a perspectiva de piora nas contas públicas devido ao avanço da PEC dos Combustíveis, com impacto em torno de R\$ 40 bilhões aos cofres públicos, piorou ainda mais o mercado doméstico. Com isso, o índice Ibovespa caiu 11,5% no mês e o real apresentou desvalorização de 11% em relação ao dólar no período. O IPCA subiu 0,67% no mês e acumula alta de 11,9% nos últimos 12 meses. A taxa Selic é de 13,25% a.a. Diante deste cenário, o Plano Transitório caiu 0,15% no mês contra alta de 0,86% de sua meta atuarial e acumula retorno de 4,93% no ano versus 8,06% da meta. O destaque negativo e principal responsável pelo retorno negativo do plano no mês foi o segmento de renda variável, com queda de 8,5%, com os fundos de ações acompanhando este movimento de queda do Ibovespa. Destaque para o segmento de renda fixa (0,78%), com boa performance dos títulos públicos marcados na curva (1,01%), e para o segmento estruturado, com bom retorno dos fundos multimercado. Apesar da má performance da bolsa americana, o segmento exterior também teve resultado positivo (1,09%), pela alta valorização do dólar frente ao real no mês. O segmento imobiliário apresentou desvalorização (-1,40%) nos fundos imobiliários da carteira. Empréstimos e Contrato Reserva fecharam o mês positivos, 1,57% e 0,95%, respectivamente.

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acumulado Ano	
													Rentab.	Atuarial¹
2018	1,28%	1,04%	1,22%	0,95%	-0,27%	0,44%	1,34%	0,37%	0,37%	2,01%	0,98%	0,47%	10,65%	9,61%
2019	1,58%	0,28%	0,89%	0,62%	0,99%	0,74%	0,41%	0,28%	0,59%	0,62%	0,45%	1,31%	9,10%	8,44%
2020	1,10%	0,30%	-2,19%	1,12%	0,84%	1,10%	1,47%	0,50%	-1,00%	0,59%	2,11%	1,96%	8,11%	9,42%
2021	0,78%	-0,04%	3,75%	1,25%	1,71%	1,13%	0,94%	1,17%	-0,21%	0,41%	0,73%	0,98%	13,29%	16,16%
2022	1,28%	0,28%	1,63%	0,61%	1,18%	-0,15%							4,93%	8,06%

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

Outros

Empréstimos

Imobiliário

Exterior

Estruturado

Renda Variável

Contrato Reserva

Renda Fixa

Total

R\$ 1.072

R\$ 7.795

R\$ 4.228

R\$ 4.938

R\$ 38.804

R\$ 47.548

R\$ 151.914

R\$ 290.094

R\$ 546.392

Em mil reais

(valor x 1000)

COMPOSIÇÃO E OBJETIVOS POR SEGMENTO ²

1,26%

1,98%

1,07%

9,86%

12,09%

73,74%

1,19%

2,28%

1,41%

9,84%

22,60%

62,68%

Exterior

Empréstimos

Imobiliário

Estruturado

Renda Variável

Renda Fixa

Carteira Transitório

Alocação Objetivo

8 Exterior + BDR de ETF (consta como Renda Variável, por questão legal) =

2,56%

RENTABILIDADES DO PERÍODO

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES	60 MESES
IGPM³	0,59%	8,17%	10,70%	50,30%	61,29%	83,74%
INPC³	0,62%	5,61%	11,92%	22,07%	24,94%	33,63%
CDI⁴	1,02%	5,42%	8,69%	11,16%	16,28%	32,71%
IPCA³	0,67%	5,49%	11,89%	21,23%	23,81%	33,60%
IBOVESPA	-11,50%	-5,99%	-22,29%	3,68%	-2,39%	59,74%
Plano Transitório	-0,15%	4,93%	9,21%	25,69%	33,27%	61,79%
Meta atuarial¹	0,86%	8,06%	17,16%	32,80%	42,00%	69,38%

RENTABILIDADE POR SEGMENTO

Renda Fixa

Estruturado

Exterior

Imobiliário

Empréstimos

Contrato Reserva

Renda Variável

0,78%

0,55%

1,09%

-1,40%

1,57%

0,95%

-8,50%

CONTRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE

% de contribuição do segmento na rentabilidade do mês

Plano Transitório

Meta Atuarial

Renda Variável

Renda Fixa

Estruturado

Exterior

Imobiliário

Empréstimos

Contrato Reserva

-0,15%

0,86%

-0,76%

0,28%

0,12%

0,01%

-0,01%

0,02%

0,20%

PARTICIPAÇÃO POR MANDATO

Títulos Públicos

Contrato Reserva

RV Ativa

RV Passiva

RV Investimento no Exterior - BDRs

Fundos DI

Crédito (estoque)

48%

28%

4%

1%

1%

3%

0%

PRINCIPAIS PRESTADORES DE INVESTIMENTOS

Custódia/Administração

Consultoria Investimentos

Consultoria Jurídica

Bradesco

ADITUS

SILVEIRA CLEMENTE

ADVOGADOS ASSOCIADOS

¹ Meta atuarial: Valor presente, calculado atuarialmente, dos benefícios acumulados pelos participantes até a data da avaliação.

² Comparativo entre objetivo estabelecido na Política de Investimentos e Carteira do Plano. Não considera o Contrato de Reserva como Segmento.

³ Índices de inflação calculados com base em uma cesta de consumo, que diferem para cada índice.

⁴ CDI: Certificado de depósito interbancário. Este certificado é negociado exclusivamente entre bancos e resultam na taxa CDI.

⁵ HTM: Títulos públicos marcados na curva, com taxa definida no ato de investimento. Deve permanecer na carteira até o vencimento.

⁶ MtM: Títulos públicos marcados a mercado, cujos valores dos ativos oscilam de acordo com as condições de mercado

⁷ Segmento imobiliário: imóveis + ativos com lastro imobiliário (CCI, CRI, FII...), conforme resolução CMN 4661/2018. Cálculo de rentabilidade considerando esse agrupamento com início 07/2019.

⁸ Por questões de regulação, o BDR de ETF BACW39 é considerado como sendo do segmento de Renda Variável, porém, gerencialmente, é considerado como Investimento no Exterior.

***As despesas dos fundos de investimento são cobradas diariamente e descontadas do valor da cota do fundo.**