

PLANO MISTO - LÂMINA AGOSTO/2020

CNPB: 1996.0051-38

Patrocinadora: CELESC Distribuição S/A

Modalidade: Contribuição Variável

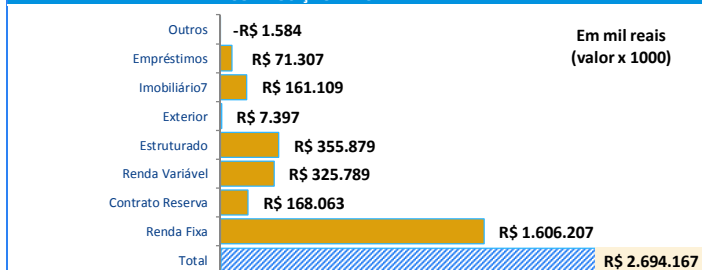


Agosto foi marcado pela contínua recuperação da atividade econômica mundial e pela valorização dos ativos de risco ao redor do mundo, apesar do aumento no número de casos de Covid-19. O índice MSCI World (mede o desempenho do mercado de empresas de grande e médio porte com presença global e em países desenvolvidos) subiu 6,7%, com destaque para o S&P500 (principal índice do EUA), que teve alta de 7,2%. No Brasil, porém, os ativos de risco tiveram desempenho negativo em meio a deterioração nas contas públicas e incertezas em relação a política fiscal. A Bolsa brasileira teve queda de 3,44% no mês. A continuação do auxílio emergencial tem dado fôlego a economia e o último Boletim Focus do mês apontou projeção de queda de 5,28% do PIB para o ano ante uma projeção de queda de 5,66% há 4 semanas atrás. O Real desvalorizou-se 5,12% em relação ao Dólar. Diante deste cenário, o Plano Misto fechou o mês com alta de 0,51% vs 0,76% de sua meta atuarial, porém segue superando a meta no ano de 2020 com 5,91% vs 4,91% da meta. Destaque para a performance de 12,72% do segmento Exterior com boa performance do ETF (fundo de índice) IVVB11, que reflete o desempenho do S&P500 + variação cambial. Resultado positivo também para o segmento de Renda Fixa (+0,87%) com contribuição positiva das NTN-Bs marcadas na curva (+0,79%) e das NTN-Cs (+3,14%). Apesar do resultado negativo mais expressivo do índice Ibovespa e dos Fundos de Renda Variável, o segmento obteve resultado negativo, de -0,23%, mas amenizado pela alta de 15,72% nas ações ordinárias da CELESC. Resultado negativo também para o segmento Estruturado (-0,17%) com performance negativa dos FIPs e do mandato Multimercado Alta Vol.

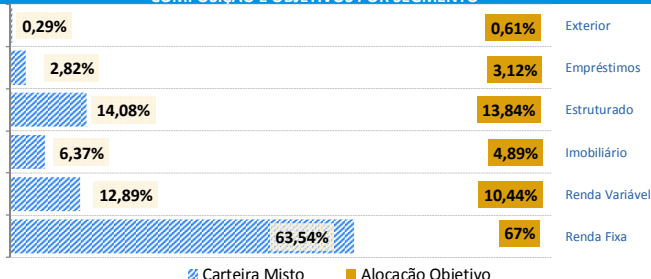
RENTABILIDADES

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acumulado Ano	
													Rentab.	Atuarial ¹
2015	0,93%	0,52%	0,02%	1,34%	1,34%	0,33%	-0,91%	-0,94%	-0,19%	1,43%	0,87%	0,62%	5,45%	16,24%
2016	1,34%	1,33%	1,08%	1,21%	0,22%	1,45%	-3,25%	0,63%	-1,37%	0,87%	-2,14%	-2,01%	-0,78%	12,57%
2017	0,10%	0,76%	-1,28%	0,04%	-0,29%	0,26%	1,38%	0,95%	-0,50%	-0,54%	0,68%	0,99%	2,56%	8,15%
2018	0,84%	1,10%	1,13%	0,69%	-0,19%	0,31%	0,66%	0,25%	0,56%	3,18%	1,03%	0,43%	10,42%	9,38%
2019	1,85%	0,13%	0,94%	0,52%	1,25%	1,34%	0,76%	-0,21%	0,74%	1,06%	0,27%	1,96%	11,13%	8,44%
2020	1,94%	0,22%	-3,52%	1,66%	1,29%	1,26%	2,51%	0,51%					5,91%	4,91%

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA



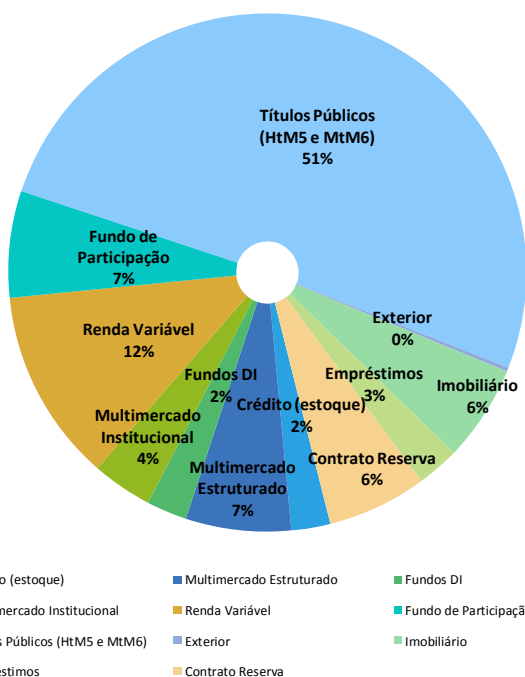
COMPOSIÇÃO E OBJETIVOS POR SEGMENTO²



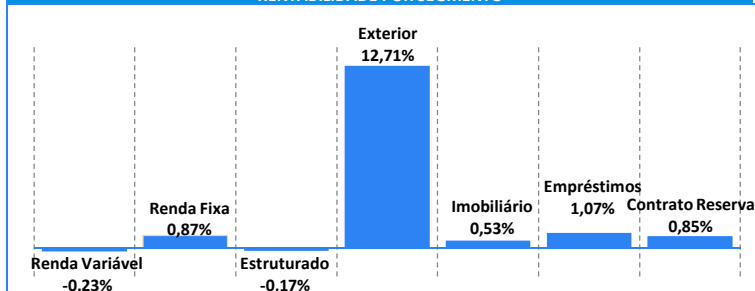
RENTABILIDADES DO PERÍODO

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES
IGPM ³	2,74%	9,64%	13,02%	18,63%	29,20%
INPC ³	0,36%	1,16%	2,94%	6,32%	10,19%
CDI ⁴	0,16%	2,12%	3,86%	10,38%	17,92%
IPCA ³	0,24%	0,70%	2,44%	5,95%	10,39%
IBOVESPA	-3,44%	-14,07%	-1,75%	29,59%	43,02%
Plano Misto	0,51%	5,91%	10,24%	23,91%	30,77%
Meta atuarial ¹	0,76%	4,91%	7,35%	16,41%	27,89%

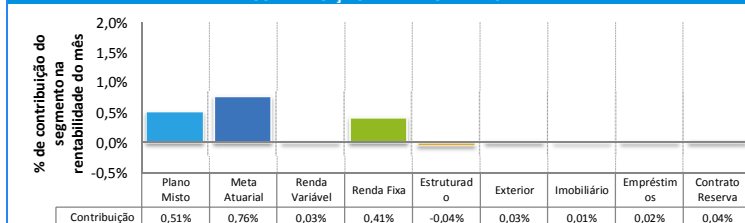
PARTICIPAÇÃO POR MANDATO



RENTABILIDADE POR SEGMENTO



CONTRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE



ESTRUTURA DE INVESTIMENTOS CELOS

Administrador e Custodiante Bradesco

Consultoria Aditus



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.

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

****As despesas relativas à manutenção da área de investimentos são custeadas pela taxa de administração dos planos de benefícios, de 0,66% a.a.**