

PLANO TRANSITÓRIO - LÂMINA AGOSTO/2020

CNPB: 1996.0052-19

Patrocinadora: CELESC Distribuição S/A

Modalidade: Benefício Definido

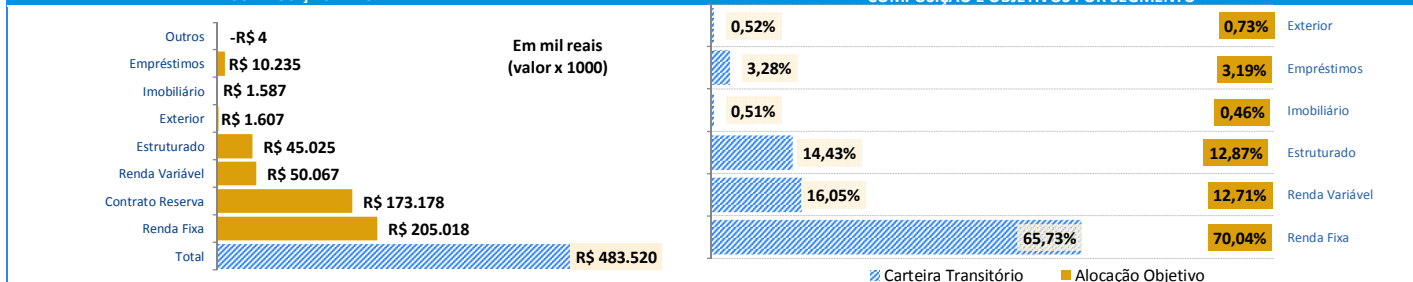


Agosto foi marcado pela contínua recuperação da atividade econômica mundial e pela valorização dos ativos de risco ao redor do mundo, apesar do aumento no número de casos de Covid-19. O índice MSCI World (mede o desempenho do mercado de empresas de grande e médio porte com presença global e em países desenvolvidos) subiu 6,7%, com destaque para o S&P500 (principal índice de 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 Transitório fechou o mês com alta de 0,50% vs 0,76% de sua meta atuarial. No ano, o Plano tem 4,27% de rentabilidade vs. 4,91% de sua 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 (+0,68%) com contribuição positiva das NTN-Bs marcadas na curva (+0,79%) e das NTN-Cs (+3,14%). Apesar do resultado negativo do índice Ibovespa e dos Fundos de Renda Variável, o segmento obteve resultado positivo de +0,11% devido a alta de 15,72% nas ações ordinárias da CELESC. Destaque negativo para o segmento Estruturado (-0,45%) com performance negativa dos FIPs e do mandato Multimercado Alta Vol.

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acumulado Ano	
													Rentab.	Atuarial ¹
2015	-0,37%	0,84%	0,88%	1,07%	1,54%	0,63%	-0,09%	-0,09%	0,43%	1,21%	0,72%	0,68%	8,39%	14,46%
2016	1,08%	1,50%	2,23%	1,36%	0,47%	1,36%	-2,02%	0,64%	-0,83%	0,35%	-0,48%	0,53%	6,31%	12,42%
2017	0,75%	0,53%	-0,42%	0,49%	0,46%	0,59%	0,86%	0,72%	0,68%	-0,06%	0,81%	1,21%	6,80%	8,30%
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%					4,27%	4,91%

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

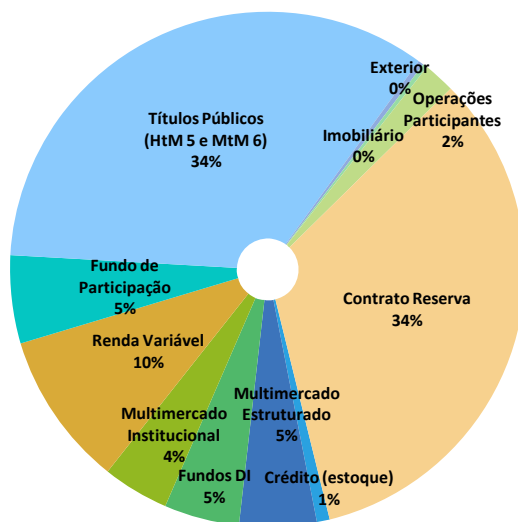
COMPOSIÇÃO E OBJETIVOS POR SEGMENTO ²



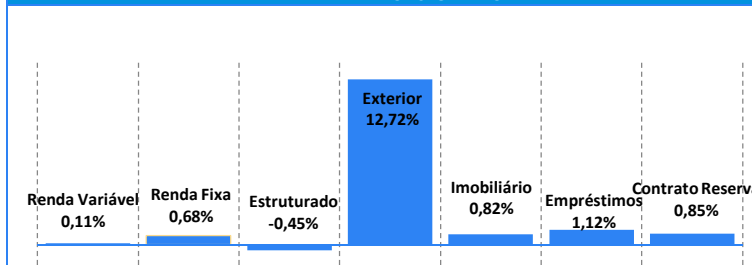
RENTABILIDADES DO PERÍODO

PARTICIPAÇÃO POR MANDATO

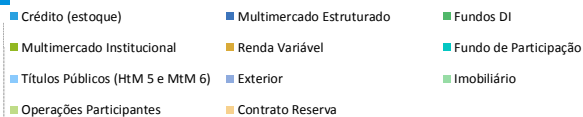
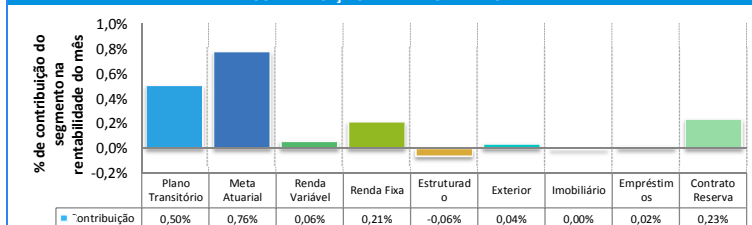
	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES
IGPM ³	2,74%	9,64%	13,02%	18,63%	29,20%
INPC ³	0,36%	1,16%	2,94%	6,32%	10,19%
CDI ⁴	0,16%	2,12%	3,86%	10,38%	17,92%
IPCA ³	0,24%	0,70%	2,44%	5,95%	10,39%
IBOVESPA	-3,44%	-14,07%	-1,75%	29,59%	43,02%
Plano Transitório	0,50%	4,27%	7,39%	18,16%	29,22%
Meta atuarial¹	0,76%	4,91%	7,35%	16,48%	28,23%



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.**