

PLANO MISTO - LÂMINA OUTUBRO/2021

CNPB: 1996.0051-38

Patrocinadora: CELESC Distribuição S/A

Modalidade: Contribuição Variável



O destaque no mês foi a retomada dos retornos positivos nas principais bolsas globais, influenciadas pelos resultados do terceiro trimestre das empresas, principalmente nos EUA, apesar das preocupações relacionadas com o crescimento global, principalmente da economia chinesa, e do comportamento da inflação, demonstrado pelos principais Bancos Centrais no mundo. O índice de ações globais MSCI subiu 5,6% no mês. No Brasil, os ativos de risco tiveram nova queda expressiva em outubro e o índice Ibovespa recuou 6,7% no mês, 4º mês consecutivo de queda e maior queda mensal desde março de 2020. Além do cenário global desafiador para as economias emergentes, a piora no cenário fiscal, a maior preocupação com a trajetória da inflação e menor expectativa de crescimento influenciaram negativamente a bolsa, a curva de juros e a taxa de câmbio no Brasil. O real desvalorizou-se 3,57% em relação ao dólar e as taxas de juros apresentaram expressiva elevação, com títulos públicos apresentando quedas de até 9,91%, como a NTN-B 2055. O IPCA registrou alta de 1,25% no período. Ao final do mês, o Copom elevou a taxa básica de juros (Selic) para 7,75% a.a. Diante deste cenário, o Plano Misto teve queda de 0,20% no mês vs. +1,56% de sua meta atuarial e acumula alta de 10,48% no ano vs. 12,75% de sua meta. O destaque negativo do mês foi o segmento de renda variável, que teve queda de 10,62%, com os fundos de ações recuando 9,55% e as ações da Celesc caindo 15,58% no período. Na renda fixa, as expressivas quedas nos títulos públicos marcados a mercado (-2,91%) ofuscaram a performance dos títulos marcados na curva (1,35%). O segmento imobiliário também apresentou queda (-0,84%) com retorno negativo dos fundos imobiliários e dos créditos imobiliários da Infrasec. Destaque positivo para o segmento estruturado (+3,52%), puxado pelo retorno positivo do FIP Energia PCH (+9%), em função de novo laudo de avaliação, apesar do retorno negativo do mandato multimercado alta volatilidade. O segmento exterior rendeu 10,80% devido a boa performance da bolsa americana e pela desvalorização do real frente ao dólar no mês. Os segmentos contrato reserva e empréstimos também obtiveram bons resultados, +1,63% e +1,36%, respectivamente.

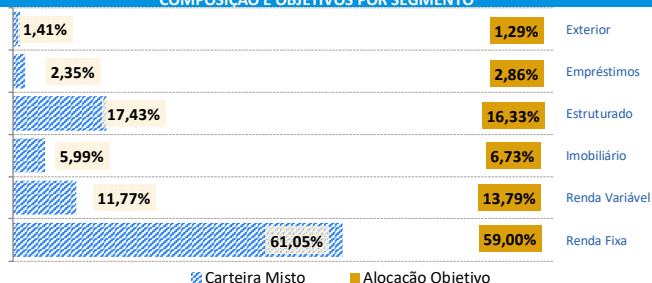
RENTABILIDADES

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acumulado Ano	
													Rentab.	Atuarial ¹
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%	-0,84%	0,86%	2,84%	2,04%	11,15%	9,42%
2021	0,34%	0,22%	4,19%	1,42%	2,44%	0,73%	0,97%	0,87%	-0,86%	-0,20%			10,48%	12,75%

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

Outros	R\$ 1.101	Em mil reais (valor x 1000)	
Empréstimos	R\$ 66.769		
Imobiliário ⁷	R\$ 169.749		
Exterior	R\$ 40.125		
Estruturado	R\$ 494.307		
Renda Variável	R\$ 333.678		
Contrato Reserva	R\$ 168.704		
Renda Fixa	R\$ 1.731.203		
Total	R\$ 3.005.635		

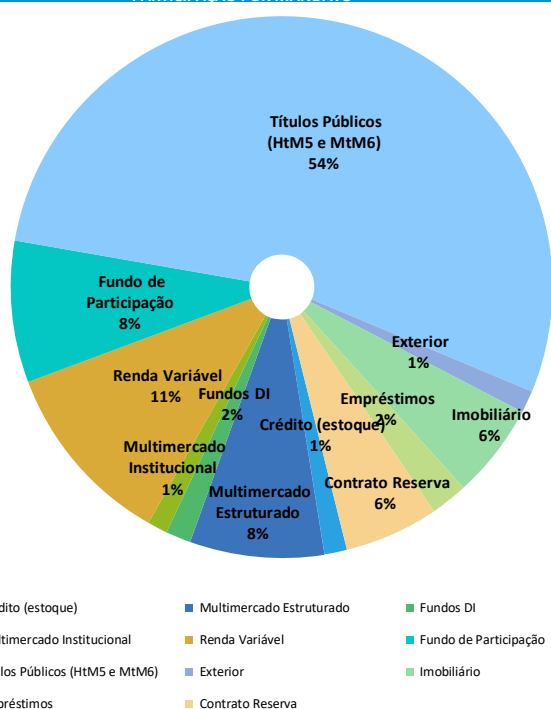
COMPOSIÇÃO E OBJETIVOS POR SEGMENTO²



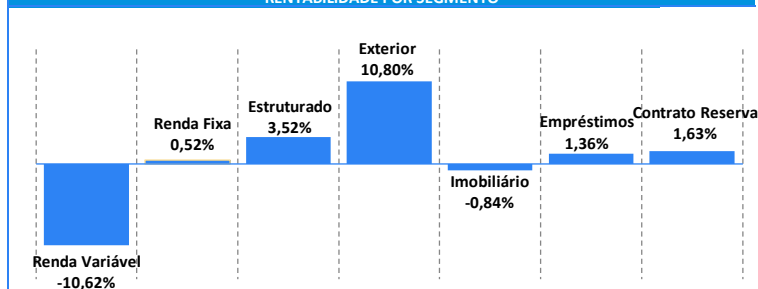
RENTABILIDADES DO PERÍODO

	MÊS	ANO	12 MESES	24 MESES	36 MESES
IGPM ³	0,64%	16,75%	21,74%	47,21%	51,88%
INPC ³	1,16%	8,45%	10,93%	16,22%	19,19%
CDI ⁴	0,49%	3,02%	3,34%	6,66%	13,28%
IPCA ³	1,25%	8,24%	10,67%	15,01%	17,92%
IBOVESPA	-6,74%	-13,03%	10,17%	-3,46%	18,40%
Plano Misto	-0,20%	10,48%	15,93%	25,54%	38,46%
Meta atuarial ¹	1,56%	12,75%	15,65%	25,14%	35,23%

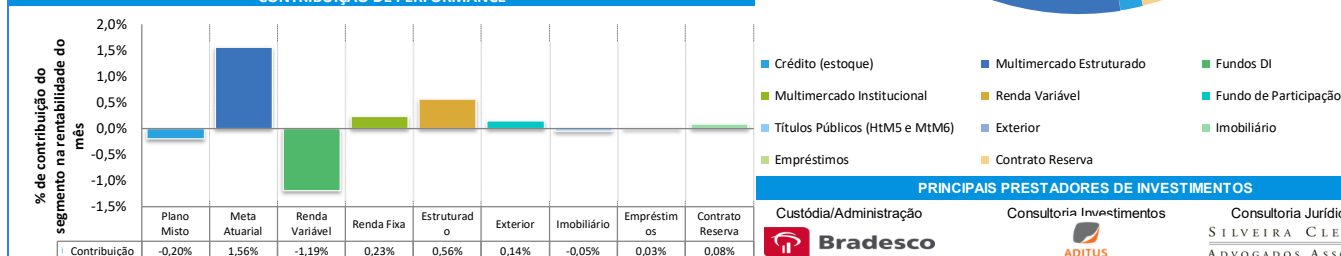
PARTICIPAÇÃO POR MANDATO



RENTABILIDADE POR SEGMENTO



CONTRIBUIÇÃO DE PERFORMANCE



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 HIM: 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 466/2018. 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.**