



# MUNICÍPIO DE TOLEDO

## Estado do Paraná

### Coordenação de Previdência – TOLEDOPREV

#### Relatório da Carteira de Investimentos - 2020

Recursos Previdenciários

SETEMBRO

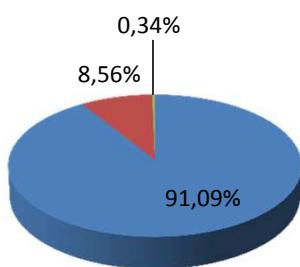
Os recursos Previdenciários são aplicados respeitando os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação e transparência.

A coordenação do TOLEDOPREV, vem buscando estratégias para que as necessidades atuariais do FAPES sejam alcançadas de acordo com os parâmetros estabelecidos na Política de Investimentos e na Resolução do Conselho Monetário Nacional 3.922/2010.

Neste mês a carteira de investimentos está distribuída da seguinte forma:

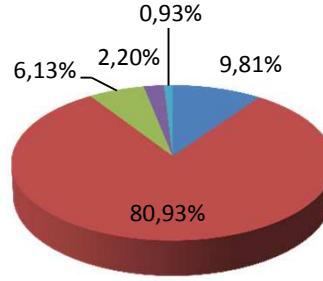
#### Distribuição dos Recursos

##### POR SEGMENTO



- RENDA FIXA
- RENDA VARIÁVEL
- INVEST NO EXTERIOR

##### POR ESTRATÉGIA



- Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"
- Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"
- Artigo 8º, Inciso II, "a"
- Artigo 8º, Inciso III
- Artigo 9º, Inciso III

#### Total da Carteira de Investimentos

R\$ 368.947.005,19

#### Histórico de Rentabilidade

Carteira	No Ano	No Mês
Carteira	2,28	-0,74
Meta Atuarial	6,50	1,35
% Meta Acumulada	35,04	-54,83

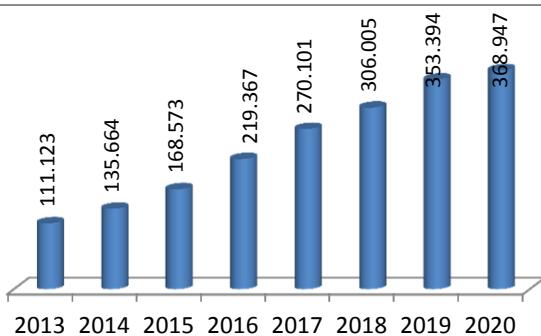
##### No Ano

2,28  
6,50  
35,04

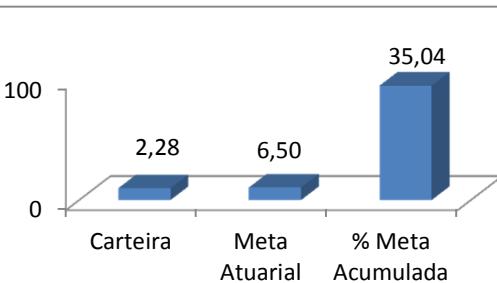
##### No Mês

-0,74  
1,35  
-54,83

#### Evolução do Patrimônio (mil)



#### Carteira x Meta Atuarial (5,87% + INPC)



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Índice de comparação : INPC + 5,87%

Posição de Ativos															Conversão de Cotas para Resgate
GESTOR	ADMINISTRADOR	CNPJ	ATIVO	VOL a.a.	RETORNO MÊS %	ÍNDICE	% CDI	% INPC+5,87	ACUM. ANO%	ÚLT. 12M%	VALOR R\$ 30/09/2020	% Carteira do RPPS	PL DO FUNDO	% NO PL DO FUNDO	
<b>RENDIMENTO FIXO E REFERENCIADO EM DI</b>															
CEF	CEF	05.164.356/0001-84	CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,34	-0,18	CDI	-72,72	-80,26	1,98	3,21	15.284.037,87	4,14	5.784.897.306,60	0,26	D+0
CEF	CEF	03.737.206/0001-97	CAIXA FI BRASIL REF DI LONGO PRAZO	0,33	0,00	CDI	-1,04	-1,15	1,77	2,90	10.865.679,53	2,95	4.760.770.417,77	0,23	D+0
CEF	CEF	35.536.532/0001-22	CAIXA FIC BRASIL RF ATIVA LP	4,84	-0,59	IPCA			2,01		10.030.296,64	2,72	547.986.362,75	1,83	
<b>Sub-total Art. 7º, Inciso IV "a" - FI Renda Fixa - Limite para alocação dos recursos: 40%</b>												36.180.014,04	9,81		
<b>RENDIMENTO FIXO</b>															
CEF	CEF	23.215.097/0001-55	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	5,95	-0,50	IPCA	-201,28	-222,16	4,53	6,41	65.652.659,06	17,79	13.535.810.678,86	0,49	D+0
CEF	CEF	10.740.658/0001-93	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	12,76	-1,53	IMA B	-613,32	-676,95	1,00	1,68	58.613.629,17	15,89	5.834.527.804,73	1,00	D+0
CEF	CEF	11.060.913/0001-10	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	5	-0,16	IMA B5	-63,72	-70,33	4,29	6,91	27.797.568,56	7,53	17.747.142.317,32	0,16	D+0
CEF	CEF	10.577.503.0001-88	CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	19,71	-2,64	IMA B5+	-1057,20	-1166,89	-4,82	-2,10	6.261.160,38	1,70	1.755.979.575,38	0,36	D+0
CEF	CEF	10.740.670/0001-06	CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF	0,55	0,13	IRF M1	53,32	58,85	2,97	4,34	39.321.890,68	10,66	10.130.144.603,43	0,39	D+0
CEF	CEF	14.508.605/0001-00	CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	5,99	-0,61	IRF M	-245,08	-270,51	4,41	6,31	48.052.039,76	13,02	11.234.342.142,99	0,43	D+0
CEF	CEF	14.386.926/0001-71	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	4,08	0,04	IDKA IPCA2	14,68	16,20	4,84	7,35	23.566.393,65	6,39	9.208.011.978,57	0,26	D+0
CEF	CEF	19.768.682/0001-05	FI BRASIL 2024 V TP RF	9,19	-0,77	IMA B5	-308,00	-339,96	-0,11	2,77	9.092.700,00	2,58	175.099.648,53	5,19	D+0
BB DTVM	BBDTVM	25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	6,22	-0,75	IMA	-301,00	-332,23	1,86	3,70	20.220.685,98	5,48	10.452.752.168,75	0,19	D+0
<b>Sub-total Art. 7º, Inciso IV "a" - FI Renda Fixa - Limite para alocação dos recursos: 40%</b>												298.578.727,24	80,93		
<b>RENDIMENTO VARIÁVEL - AÇÕES</b>															
CEF	CEF	30.068.224/0001-04	CAIXA FIC AÇÕES MULTIGESTOR (25/06/2019)	43,38	-5,38	IBOVESPA	-2151,08	-2374,26	-14,86	-2,46	3.721.702,08	1,01	829.854.206,90	0,45	D+23
VINCI EQUITIES	CEF	15.154.441/0001-15	FIC AÇÕES VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,43	-4,93	IDIV	-1972,00	-2176,60	-17,58	-6,98	3.457.468,69	0,94	783.577.685,83	0,44	D+30
CEF	CEF	15.154.220/0001-47	CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	46,46	-5,93	SMLL	-2370,72	-2616,69	-20,37	-4,18	1.558.858,12	0,42	1.156.431.775,09	0,13	D+1
CEF	CEF	10.551.375/0001-01	CAIXA FI AÇOES CONSTRUÇÃO CIVIL	58,99	-8,11	IMOB11	-3242,16	-3578,54	-36,98	-21,21	1.219.455,40	0,33	472.017.380,08	0,26	D+1
CEF	CEF	10.577.512/0001-79	CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	44,58	-4,06	ICON	-1622,88	-1791,26	-10,05	-1,18	1.433.606,73	0,39	718.937.900,79	0,20	D+1
ITAÚ	ITAÚ	24.571.992/0001-75	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	42,71	-4,96	IBOVESPA	-1984,00	-2189,85	-20,69	-10,53	3.943.640,61	1,07	3.159.975.144,49	0,12	D+21
ITAÚ	ITAÚ	16.718.302/0001-30	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30	40,85	-4,00	IBOVESPA	-1600,00	-1766,00	-11,63	-0,77	2.819.361,92	0,76	1.846.376.502,59	0,15	D+21
BAHIA RV	BEM DTVM	09.635.172/0001-06	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	43,49	-4,45	IBOVESPA	-1780,00	-1964,68	-15,69	-5,14	4.476.265,94	1,21	844.202.491,55	0,53	D+30
<b>Sub-total Art. 8º, Inciso II, "a" - Ações - Limite para alocação dos recursos: 20%</b>												22.630.359,49	6,13		
<b>RENDIMENTO VARIÁVEL - MULTIMERCADO</b>															
CEF	CEF		FIC CAP PROT BRASIL IBOVESPA II MULT	-	0,00	IBOVESPA	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	-	D+0
CEF	CEF	29.388.994/0001-47	FIC CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT (13/08/2018)	1,76	-0,45	IBOVESPA	-178,72	-197,26	1,41	2,97	3.516.560,93	0,95	505.717.833,93	0,70	D+0
CEF	CEF	08.070.841/0001-87	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	7,73	-0,91	CDI	-363,76	-401,50	-0,69	3,05	4.597.112,49	1,25	5.019.584.079,54	0,09	D+1
<b>Sub-total Art. 8º, Inciso III - Multimercado - Limite para alocação dos recursos: 10%</b>												8.113.673,42	2,20		
<b>INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>															
CEF	CEF	17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	28,47	-1,99	AÇÕES	-796,00	-878,59	52,76	61,21	3.444.231,00	0,93	1.671.279.124,17	0,21	D+1
<b>Sub-total Art. 9º, Inciso III - Ações BDR Nível I - Limite para alocação dos recursos: 10%</b>												3.444.231,00	0,93		
<b>TOTAL</b>												368.947.005,19	100,00		

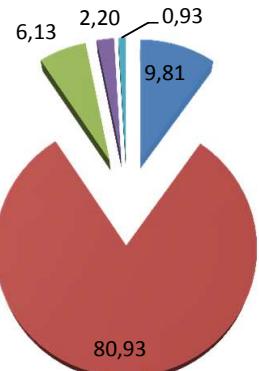
# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Índice de comparação : INPC + 5,87%

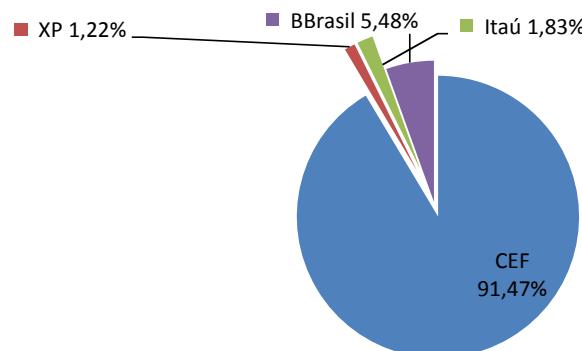
ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA							
ARTIGO	TIPO DE ATIVO	VALOR (R\$)	% CARTEIRA	POLÍTICA DE INVESTIMENTO	LIMITE PL DO FUNDO	ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE RES. 3922/2010
<strong>RENDA FIXA</strong>							
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	FI Renda Fixa	36.180.014,04	9,81	40%	15%	10%	40%
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	FI 100% Títulos TN	298.578.727,24	80,93	100%	15%	73%	100%
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso VII, Alinea "b"	FI Renda Fixa - Credito Privado	0,00	0,00	5%	5%	1%	5%
	<strong>Total Renda Fixa</strong>	<strong>334.758.741,28</strong>	<strong>90,73</strong>				
<strong>RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</strong>							
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso I, "a"	FI Ações - Índices c/ min 50 ações	0,00	0,00	15%	15%	2%	30%
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"	FI Ações Livres	22.630.359,49	6,13	20%	15%	8%	20%
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	Multimercado	8.113.673,42	2,20	10%	5%	5%	10%
	<strong>Total Renda Variável</strong>	<strong>30.744.032,91</strong>	<strong>8,33</strong>				
<strong>INVESTIMENTO NO EXTERIOR</strong>							
CMN 3922 - Artigo 9º-A, Inciso II	Investimento no Exterior	0,00	0,0%	10%	15%	0,50%	10%
CMN 3922 - Artigo 9º-A, Inciso III	Investimento no Exterior	3.444.231,00	0,93	10%	15%	0,50%	10%
	<strong>Total Investimentos no Exterior</strong>	<strong>3.444.231,00</strong>	<strong>0,93</strong>				
	<strong>TOTAL</strong>	<strong>368.947.005,19</strong>	<strong>100,00</strong>				
<strong>GANHOS FINANCEIROS</strong>							
ESTRATÉGIA	GANHO BRUTO NO MÊS (R\$)		GANHO BRUTO NO ANO R\$				
	-78.925,87	511.297,16					
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	-1.915.263,29	8.155.860,26					
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	-1.189.680,30	-4.630.096,91					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"	-57.969,81	18.279,26					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	-49.736,83	364.251,79					
	<strong>TOTAL</strong>	<strong>-3.291.576,10</strong>	<strong>4.419.591,56</strong>				

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### ALOCAÇÃO POR ESTRATÉGIA

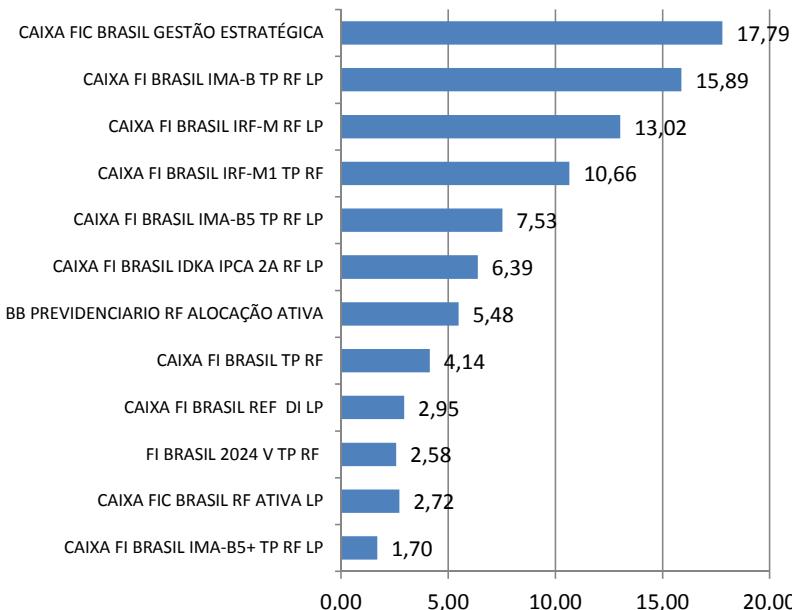


### ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

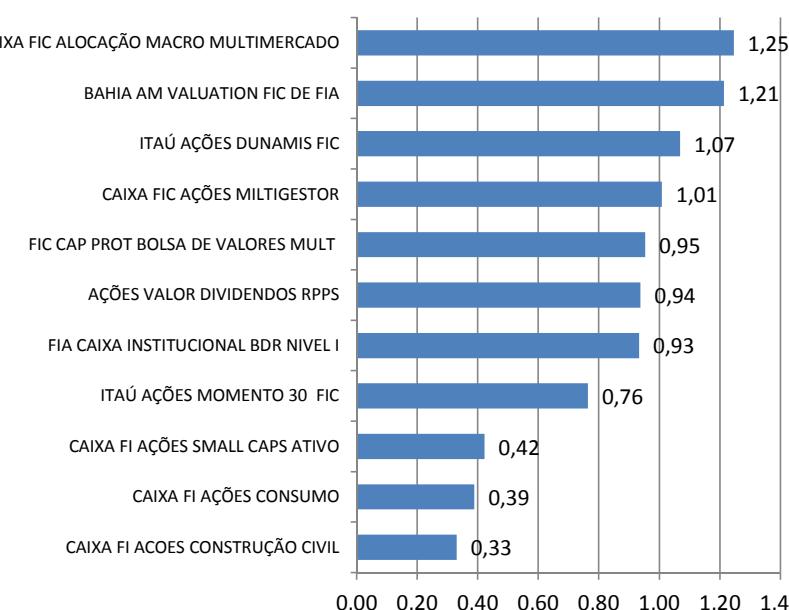


## ALOCAÇÃO POR ATIVOS

### RENDA FIXA

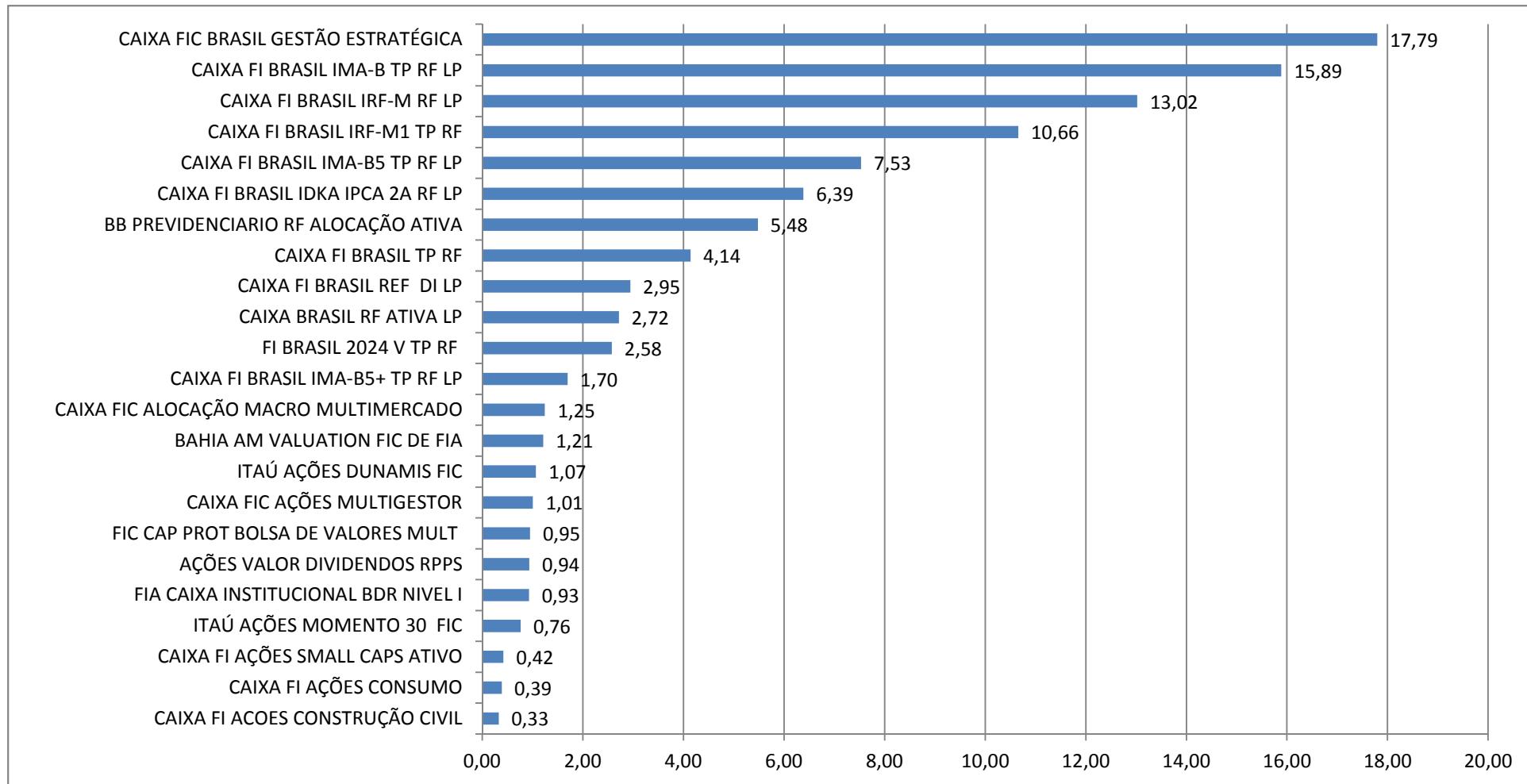


### RENDA VÁRIAVEL



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### ALOCAÇÃO POR ATIVOS



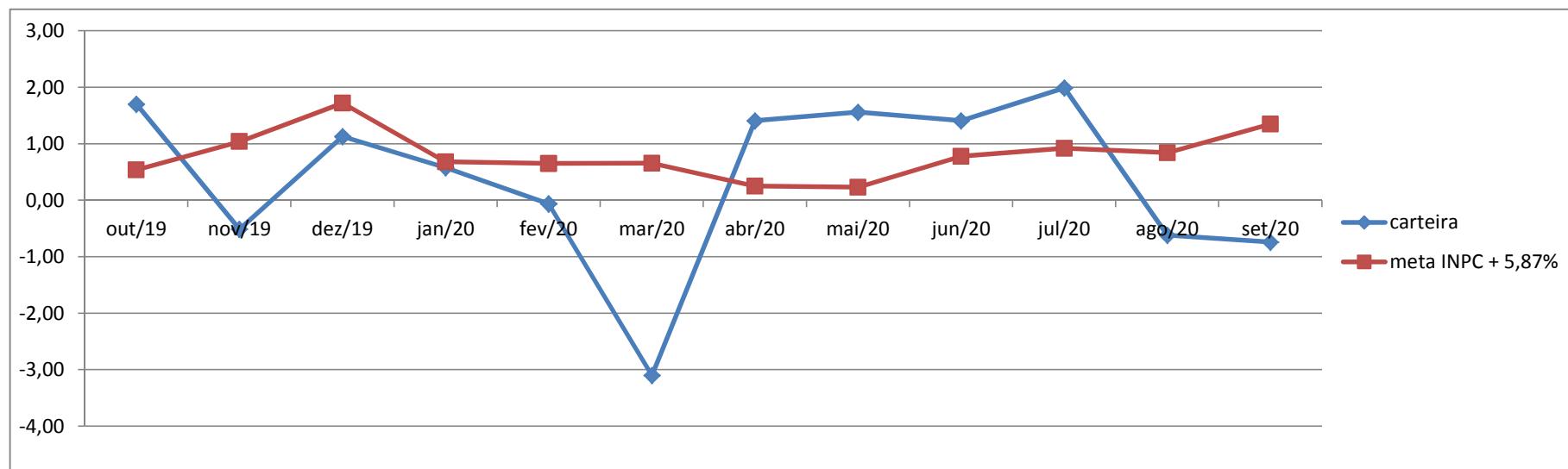
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### RENTABILIDADE DA CARTEIRA

	jan	fev	março	abril	maio	junho	julho	agosto	setembro	outubro	novembro	dezembro		
	2018	0,70	0,55	0,73	0,46	0,02	0,50	0,76	0,33	0,61	1,26	0,50	0,71	7,34
INPC + 6 %		0,73	0,68	0,57	0,71	0,93	1,93	0,75	0,50	0,80	0,90	0,25	0,64	9,43
p.p. Meta		-0,03	-0,13	0,16	-0,25	-0,91	-1,43	0,01	-0,17	-0,19	0,36	0,25	0,07	-2,09
% da Meta no Mês		95,89	80,88	128,07	64,79	2,15	25,91	101,33	66,00	76,25	140,00	200,00	110,94	77,84
2019		0,86	0,47	0,54	0,71	1,28	1,43	0,94	0,13	1,58	1,70	-0,51	1,13	10,745
INPC + 6 %		0,86	1,04	1,27	1,10	0,66	0,51	0,60	0,62	0,45	0,54	1,04	1,72	10,749
p.p. Meta		0	-0,57	-0,73	-0,39	0,62	0,92	0,34	-0,49	1,13	1,16	-1,55	-0,59	-0,0038
% da Meta no Mês		100,00	44,81	42,38	64,87	196,91	281,01	156,46	20,25	352,12	315,55	-48,43	65,94	99,97
2020		0,58	-0,06	-3,10	1,41	1,56	1,41	1,99	-0,62	-0,74				
INPC+5,87%		0,67	0,65	0,66	0,25	0,23	0,78	0,92	0,84	1,35				
p.p. Meta		-0,09	-0,71	-3,76	1,16	1,33	0,63	1,07	-1,46	-2,09				
% da Meta no Mês		86,94	-9,77	-479,51	570,78	692,03	181,30	216,36	-74,02	-54,83				

### RENTABILIDADE MENSAIS - 12 ÚLTIMOS MESES

25.078.994/0001-90



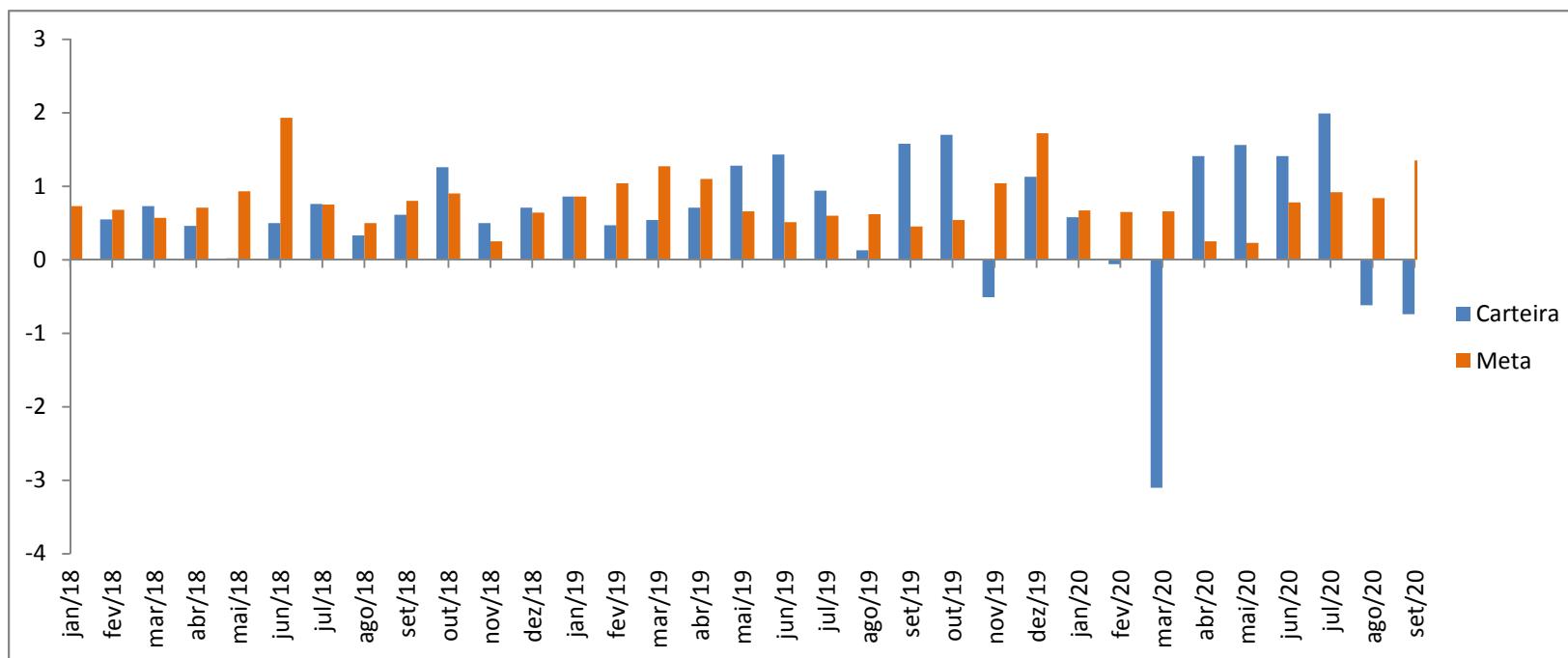
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Posição 31/08/2020 - índice de comparação INPC + 6,00% (2018, 2019) INPC + 5,87% (2020)**

### Análise de Risco/Retorno da Carteira

	Qtd.	%	Período	Rentabilidade			Vol. Anual
				Carteira	INPC + 5,87%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	15	45%	03 meses	0,63	3,11	-2,48	5,34
Meses abaixo do Benchmark	18	55%	06 meses	5,01	4,37	0,64	4,13
	Rentab.	Mês	12 meses	4,75	9,65	-4,90	5,10
<b>Maior</b> Rentabilidade da Carteira	1,99%	jul/20	24 meses	15,16	15,55	-0,39	3,77
<b>Menor</b> Rentabilidade da Carteira	-3,10%	mar/20	36 meses				
			Desde jan/18	19,82	26,15	-4,29	3,23

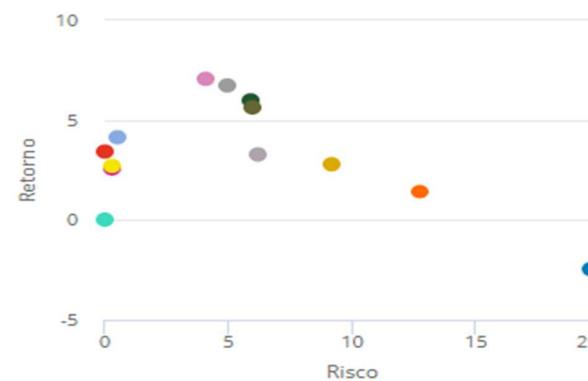
### Retorno Mensal - Carteira vs Meta



## Volatilidade Ativos de Renda Fixa

Fundo	12 meses	Desde o início
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,71%	12,53%
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,76%	7,96%
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95%	4,26%
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	-%	4,88%
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP	0,33%	0,20%
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,34%	0,29%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,00%	3,05%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55%	0,49%
FI CAIXA BRASIL IRF M TÍTULOS PUBLICOS RF LP	5,99%	3,82%
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,08%	2,75%
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9,19%	8,24%
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22%	4,41%
CDI	0,07	0,4

## Gráfico de Risco X Retorno



## Volatilida Ativos de Renda Variável

Fundo	12 meses	Desde o início
FIC FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	43,38%	38,85%
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,43%	19,90%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	46,46%	23,30%
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	58,99%	30,62%
FIA CAIXA CONSUMO	44,58%	22,95%
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	40,85%	21,68%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	42,71%	27,12%
BAHIA AM VALUATION FIC FIA	43,49%	22,88%
FIC FI CAIXA CAPITAL PROT BOLSA VALORES MULT	1,76%	1,83%
FIC FI CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	7,73%	2,92%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	28,47%	18,57%

## Gráfico de Risco X Retorno

