



MUNICÍPIO DE TOLEDO

Estado do Paraná

Coordenação de Previdência – TOLEDOPREV

Relatório da Carteira de Investimentos - 2020

Recursos Previdenciários

JANEIRO

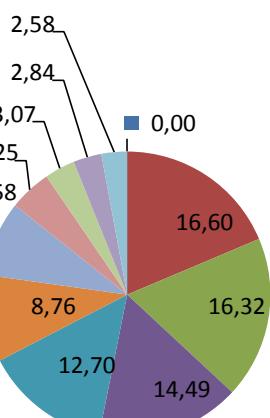
Os recursos Previdenciários são aplicados respeitando os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação e transparência.

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:

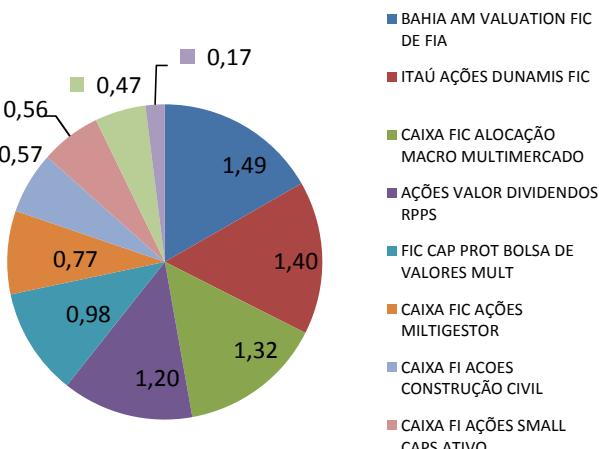
Distribuição dos Recursos

RENDA FIXA



- CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA
- CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP
- CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF
- CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP
- CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP
- CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP
- CAIXA FI BRASIL TP RF
- CAIXA FI BRASIL REF DI LP
- BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA
- FI BRASIL 2024 V TP RF

RENDA VARIÁVEL



Histórico de Rentabilidade

Carteira
Meta Atuarial
% Meta Acumulada

No Ano

0,58

0,68

85,32

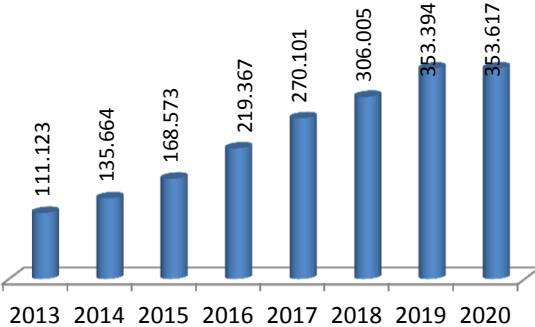
No Mês

0,58

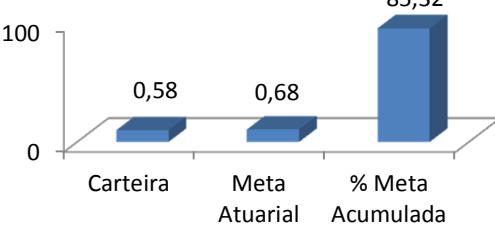
0,68

85,32

Evolução do Patrimônio (mil)



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



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

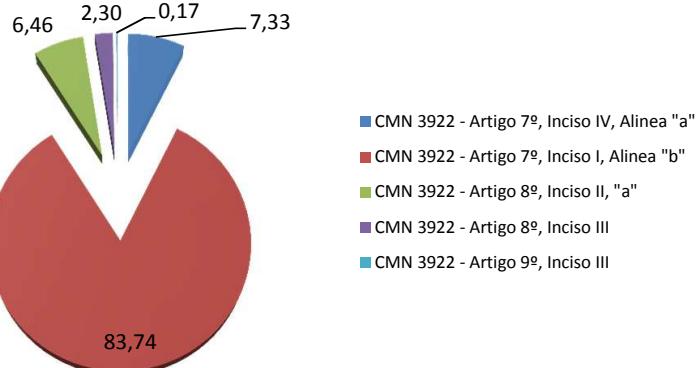
Índice de comparação : INPC + 5,87%

Posição de Ativos														
GESTOR	ADMINISTRADOR	ATIVO	VOL (A.A)	RETORNO MÊS %	ÍNDICE	% CDI	% INPC+5,87	ACUM. ANO%	ÚLT. 12M%	VALOR R\$ 31/01/2020	% Carteira do RPPS	PL DO FUNDO	% NO PL DO FUNDO	Conversão de Cotas para Resgate
RENDA FIXA E REFERENCIADO EM DI														
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,0652	0,39	CDI	102,58	56,81	0,39	5,76	15.044.817,19	4,25	3.449.563.810,54	0,44	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LONGO PRAZO	0,0254	0,37	CDI	98,46	54,53	0,37	5,55	10.861.225,21	3,07	5.345.385.558,02	0,20	D+0
Sub-total Art. 7º, Inciso IV "a" - FI Renda Fixa - Limite para alocação dos recursos: 40%										25.906.042,40	7,33			
RENDA FIXA														
CEF	CEF	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	1,3071	0,82	IPCA	217,55	120,49	0,82	14,10	58.711.989,07	16,60	9.094.359.000,50	0,65	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	3,4273	0,25	IMA B	65,51	36,28	0,25	17,72	57.692.821,49	16,32	6.604.088.892,56	0,87	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	1,3182	0,54	IMA B5	144,48	80,01	0,54	11,76	26.799.961,38	7,58	10.136.705.212,45	0,26	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	5,3983	-0,04	IMA B5+	-10,22	-5,66	-0,04	21,74	6.575.715,50	1,86	2.270.256.483,13	0,29	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF	0,1848	0,42	IRF M1	112,19	62,13	0,42	6,40	51.246.990,21	14,49	10.529.932.746,92	0,49	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	1,3084	0,84	IRF M	222,41	123,18	0,84	11,12	44.921.039,34	12,70	15.527.608.259,67	0,29	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	1,132	0,46	IDKA IPCA2	121,40	67,24	0,46	10,30	30.972.794,85	8,76	8.791.015.868,25	0,35	D+0
CEF	CEF	FI BRASIL 2024 V TP RF	0,7977	0,80	IMA B5	212,43	117,65	0,80	15,10	9.175.134,00	2,58	176.687.041,18	5,19	D+0
BB DTVM	BBDTVM	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	1,4877	0,49	IMA	129,00	71,44	0,49	11,38	10.031.085,50	2,84	10.446.730.359,40	0,10	D+0
Sub-total Art. 7º, Inciso I, "b" - FI 100% Títulos TN - Limite para alocação dos recursos: 100%										296.127.531,34	83,74			
RENDA VARIÁVEL - AÇÕES														
CEF	CEF	CAIXA FIC ACÕES MILTIGESTOR (25/06/2019)	-	3,17	IBOVESPA	842,64	466,68	3,17	-	2.705.376,01	0,77	788.946.693,79	0,34	D+23
VINCI EQUITIES	CEF	FIC ACÕES VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,3414	1,53	IDIV	406,27	225,00	1,53	28,52	4.259.301,93	1,20	943.947.729,59	0,45	D+30
CEF	CEF	CAIXA FI ACÕES SMALL CAPS ATIVO	19,2423	0,50	SMILL	133,30	73,82	0,50	41,2604	1.967.538,64	0,56	1.590.900.361,63	0,12	D+1
CEF	CEF	CAIXA FI ACOES CONSTRUÇÃO CIVIL	21,9913	3,64	IMOB	967,05	535,57	3,64	57,5158	2.005.452,54	0,57	1.076.028.516,03	0,19	D+1
CEF	CEF	CAIXA FI ACÕES CONSUMO	20,5957	3,38	ICON	898,30	497,50	3,38	42,7602	1.647.788,33	0,47	957.716.872,27	0,17	D+1
ITAÚ	ITAÚ	ITAÚ ACÕES DUNAMIS FIC	17,9052	-0,19	IBOVESPA	-50,45	-27,94	-0,19	31,46	4.962.961,62	1,40	4.585.787.416,19	0,11	D+24
BAHIA RV	BEM DTVM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	20,4699	-0,58	IBOVESPA	-154,01	-85,29	-0,58	21,02	5.278.259,08	1,49	1.203.119.286,22	0,44	D+32
Sub-total Art. 8º, Inciso II, "a" - Ações - Limite para alocação dos recursos: 20%										22.826.678,15	6,46			
RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO														
CEF	CEF	FIC CAP PROT BRASIL IBOVESPA II MULT	-	0,11	IBOVESPA	29,47	16,32	0,11	4,35	0,00	0,00	0,00	-	D+2
CEF	CEF	FIC CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT (13/08/2018)	0,2640	0,32	IBOVESPA	84,07	46,56	0,32	7,26	3.478.482,49	0,98	500.501.925,72	0,69	D+0
CEF	CEF	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	4,0631	0,68	CDI	181,49	100,51	0,68	14,67	4.660.638,30	1,32	6.423.116.574,31	0,07	D+1
Sub-total Art. 8º, Inciso III - Multimercado - Limite para alocação dos recursos: 10%										8.139.120,79	2,30			
INVESTIMENTO NO EXTERIOR														
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	11,8272	6,52	AÇÕES	1731,28	958,82	6,52	42,28	617.786,63	0,17	797.257.804,89	0,08	D+1
Sub-total Art. 9º, Inciso III - Ações BDR Nível I - Limite para alocação dos recursos: 10%										617.786,63	0,17			
TOTAL										353.617.159,31	100,00			

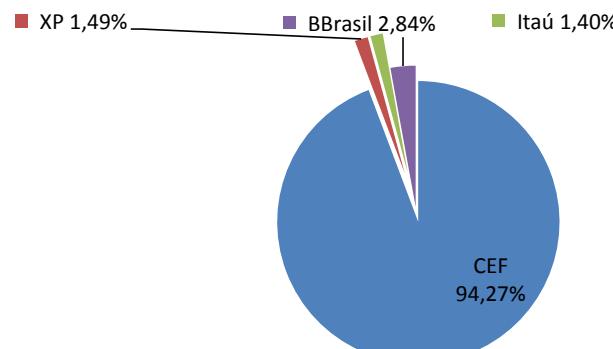
ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA						
ARTIGO	TIPO DE ATIVO	VALOR (R\$)	% CARTEIRA	POLÍTICA DE INVESTIMENTO	LIMITE PL DO FUNDO	LIMITE RES. 3922/2010
RENDAS FIXAS						
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	FI Renda Fixa	25.906.042,40	7,33	40%	15%	40%
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	FI 100% Títulos TN	296.127.531,34	83,74	100%	15%	100%
	Total Renda Fixa	322.033.573,74	91,07			
RENDAS VARIÁVEIS E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS						
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"	FI Ações Livres	22.826.678,15	6,46	20%	15%	20%
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	Multimercado	8.139.120,79	2,30	10%	5%	10%
	Total Renda Variável	30.965.798,94	8,76			
INVESTIMENTO NO EXTERIOR						
CMN 3922 - Artigo 9º, Inciso III	Investimento no Exterior	617.786,63	0,17	10%	5%	10%
	Total Investimentos no Exterior	617.786,63	0,17			
	TOTAL	353.617.159,31				
GANHOS FINANCEIROS						
ESTRATÉGIA	GANHO BRUTO NO MÊS (R\$)	GANHO BRUTO NO ANO R\$				
	108.114,59	108.114,59				
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	1.619.879,37	1.619.879,37				
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	26.174,24	26.174,24				
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"	43.726,63	43.726,63				
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	37.807,42	37.807,42				
	TOTAL	1.835.702,25	1.835.702,25			

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

ALOCAÇÃO POR ESTRATÉGIA

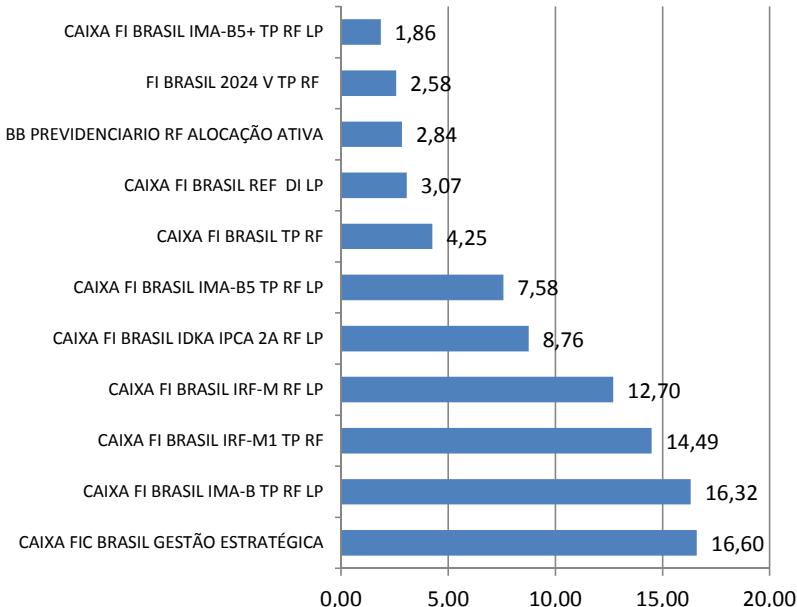


ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

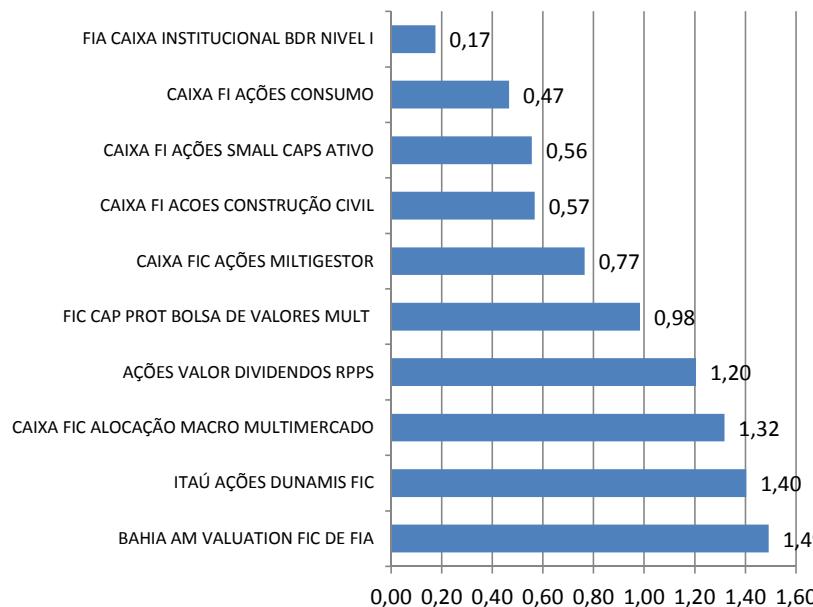


ALOCAÇÃO POR ATIVOS

RENDA FIXA



RENDA VÁRIAVEL

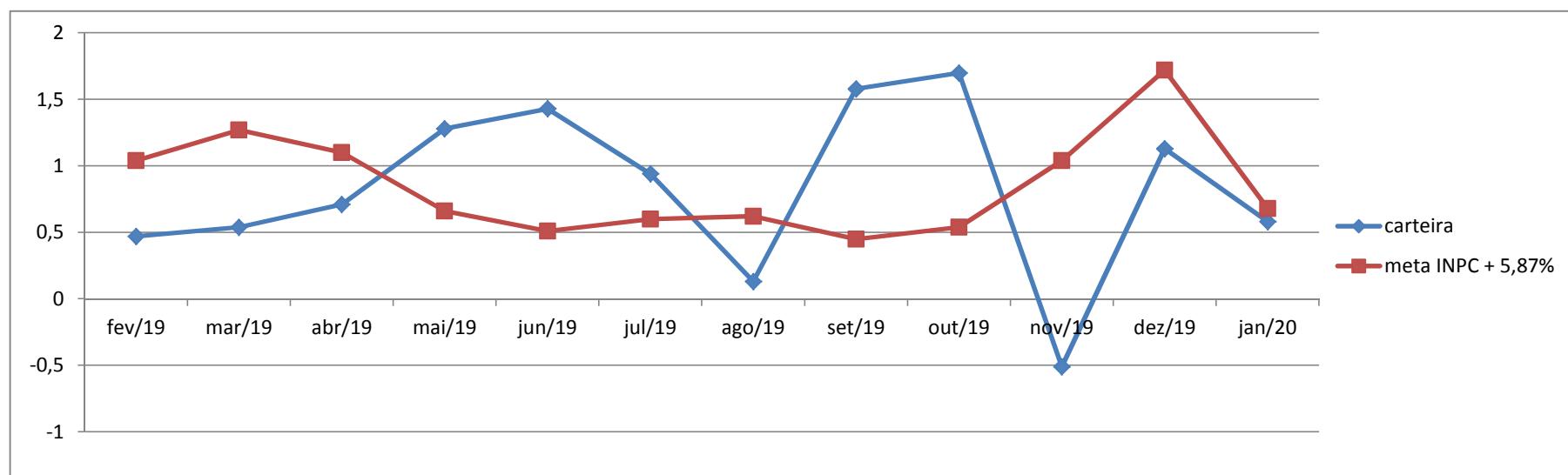


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	10,7488
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												
INPC+5,87%	0,68												
p.p. Meta	-0,10												
% da Meta no Mês	85,43												

RENTABILIDADE MENSAL - 12 ÚLTIMOS MESES



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

ALOCAÇÃO POR ATIVOS

