



# MUNICÍPIO DE TOLEDO

## Estado do Paraná

### Coordenação de Previdência – TOLEDOPREV

#### Relatório da Carteira de Investimentos - 2020

Recursos Previdenciários

JUNHO

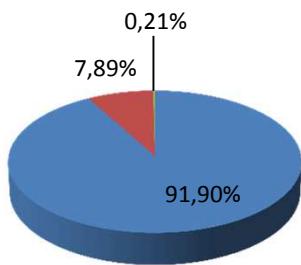
Os recursos Previdenciários são aplicados respeitando os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação e transparência.

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.

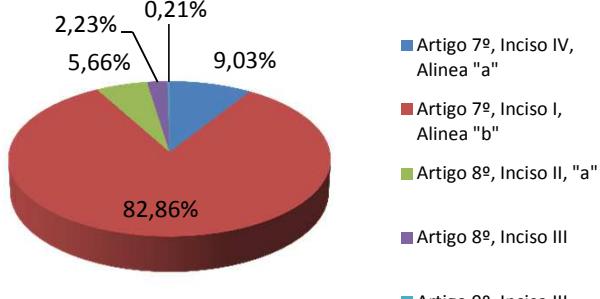
Neste mês a carteira de investimentos está distribuída da seguinte forma:

#### Distribuição dos Recursos

##### POR SEGMENTO



##### POR ESTRATÉGIA



#### Total da Carteira de Investimentos

R\$ 363.271.628,23

#### Histórico de Rentabilidade

Carteira	No Ano	No Mês
Carteira	1,66	1,41
Meta Atuarial	3,26	0,78
% Meta Acumulada	51,02	181,30

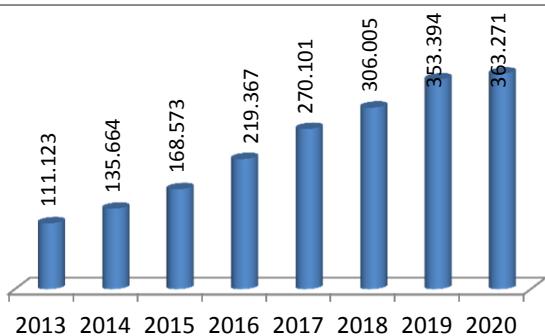
##### No Ano

1,66  
3,26  
51,02

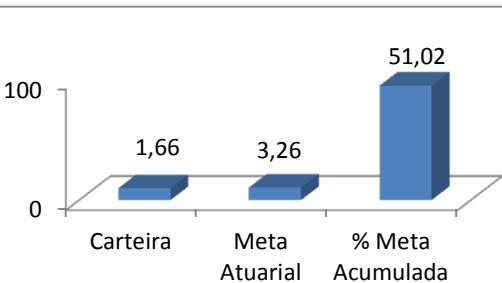
##### No Mês

1,41  
0,78  
181,30

#### 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	SHARPE (RISCO X RETORNO)	RETORNO MÊS %	ÍNDICE	% CDI	% INPC+5,87	ACUM. ANO%	ÚLT. 12M%	VALOR R\$ 30/06/2020	% 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	0,11	0,22	CDI	86,32	95,28	1,82	4,64	15.260.997,67	4,20	4.922.144.184,93	0,31	D+0
CEF	CEF	03.737.206/0001-97	CAIXA FI BRASIL REF DI LONGO PRAZO	5,03	0,24	CDI	97,12	107,20	1,37	4,03	10.823.344,71	2,98	5.172.945.706,81	0,21	D+0
CEF	CEF	35.536.532/0001-22	CAIXA FIC BRASIL RF ATIVIA LP	2,55	0,66	IPCA			2,02		6.737.112,11	1,85	254.000.669,64	2,65	
<b>Sub-total Art. 7º, Inciso IV "a" - FI Renda Fixa - Limite para alocação dos recursos: 40%</b>												32.821.454,49	9,03		
<b>RENDIMENTO FIXO</b>															
CEF	CEF	23.215.097/0001-55	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	2,71	0,75	IPCA	299,84	330,95	4,63	9,82	65.712.159,47	18,09	12.211.119.756,17	0,54	D+0
CEF	CEF	10.740.658/0001-93	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	3,87	2,03	IMA B	810,08	894,13	-1,88	4,52	58.094.590,80	15,99	5.979.262.081,07	0,97	D+0
CEF	CEF	11.060.913/0001-10	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	5,9	1,10	IMA B5	439,44	485,03	3,04	8,51	27.465.854,13	7,56	8.746.335.681,60	0,31	D+0
CEF	CEF	10.577.503.0001-88	CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	3,49	2,83	IMA B5+	1130,88	1248,21	-5,44	1,57	6.220.700,80	1,71	1.967.228.116,14	0,32	D+0
CEF	CEF	10.740.670/0001-06	CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF	5,03	0,26	IRF M1	103,68	114,44	2,48	5,78	42.707.888,32	11,76	11.257.382.974,77	0,38	D+0
CEF	CEF	14.508.605/0001-00	CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	2,8	0,77	IRF M	307,00	338,85	4,73	9,54	48.198.534,04	13,27	17.164.831.993,69	0,28	D+0
CEF	CEF	14.386.926/0001-71	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	6,83	1,18	IDKA IPCA2	470,12	518,90	3,12	8,19	23.180.530,28	6,38	7.740.606.629,29	0,30	D+0
CEF	CEF	19.768.682/0001-05	FI BRASIL 2024 V TP RF	3,63	1,24	IMA B5	496,00	547,46	1,44	5,13	9.233.370,00	2,58	177.808.536,74	5,19	D+0
BB DTVM	BBDTVM	25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	3,48	0,95	IMA	379,44	418,81	1,75	6,31	20.199.625,60	5,56	10.783.491.196,95	0,19	D+0
<b>Sub-total Art. 7º, Inciso IV "b" - FI 100% Títulos TN - Limite para alocação dos recursos: 100%</b>												301.013.253,44	82,86		
<b>RENDIMENTO VARIÁVEL - AÇÕES</b>															
CEF	CEF	30.068.224/0001-04	CAIXA FIC AÇÕES MULTIGESTOR (25/06/2019)	7,72	9,88	IBOVESPA	3950,88	4360,79	-14,67	5,165	2.692.453,23	0,74	767.311.521,81	0,35	D+23
VINCI EQUITIES	CEF	15.154.441/0001-15	FIC AÇÕES VALOR DIVIDENDOS RPPS	2,57	4,58	IDIV	1832,00	2022,08	-16,79	-2,34	3.490.854,02	0,96	799.344.501,83	0,44	D+30
CEF	CEF	15.154.220/0001-47	CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	9,25	12,89	SMLL	5157,32	5692,41	-21,45	3,57	1.537.723,76	0,42	1.090.602.347,47	0,14	D+1
CEF	CEF	10.551.375/0001-01	CAIXA FI AÇOES CONSTRUÇÃO CIVIL	13,04	18,16	IMOB11	7265,44	8019,25	-30,30	-5,62	1.348.705,06	0,37	489.413.926,39	0,28	D+1
CEF	CEF	10.577.512/0001-79	CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	8,38	9,80	ICON	3921,20	4328,04	-11,31	14,47	1.413.634,44	0,39	672.088.502,03	0,21	D+1
ITAÚ	ITAÚ	24.571.992/0001-75	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	6,69	9,28	IBOVESPA	3712,00	4097,13	-22,25	-4,41	3.866.242,49	1,06	3.271.694.899,63	0,12	D+21
ITAÚ	ITAÚ	16.718.302/0001-30	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30	11,28	11,47	IBOVESPA	4588,00	5064,02	-14,65	0,85	1.823.958,82	0,50	1.573.476.047,46	0,12	D+21
BAHIA RV	BEM DTVM	09.635.172/0001-06	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	5,79	8,04	IBOVESPA	3216,00	3549,67	-17,46	-4,65	4.381.985,70	1,21	997.483.211,36	0,44	D+30
<b>Sub-total Art. 8º, Inciso II, "a" - Ações - Limite para alocação dos recursos: 20%</b>												20.555.557,52	5,66		
<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)	-19,11	0,11	IBOVESPA	43,88	48,43	1,79	5,40	3.529.607,80	0,97	507.594.109,51	0,70	D+0
CEF	CEF	08.070.841/0001-87	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	5,1	1,25	CDI	501,20	553,20	-1,03	6,27	4.581.237,25	1,26	4.507.138.355,17	0,10	D+1
<b>Sub-total Art. 8º, Inciso III - Multimercado - Limite para alocação dos recursos: 10%</b>												8.110.845,05	2,23		
<b>INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>															
CEF	CEF	17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	2,42	4,37	AÇÕES	1748,00	1929,36	32,85	54,59	770.517,73	0,21	1.181.944.568,52	0,07	D+1
<b>Sub-total Art. 9º, Inciso III - Ações BDR Nível I - Limite para alocação dos recursos: 10%</b>												770.517,73	0,21		
<b>TOTAL</b>												363.271.628,23	100,00		

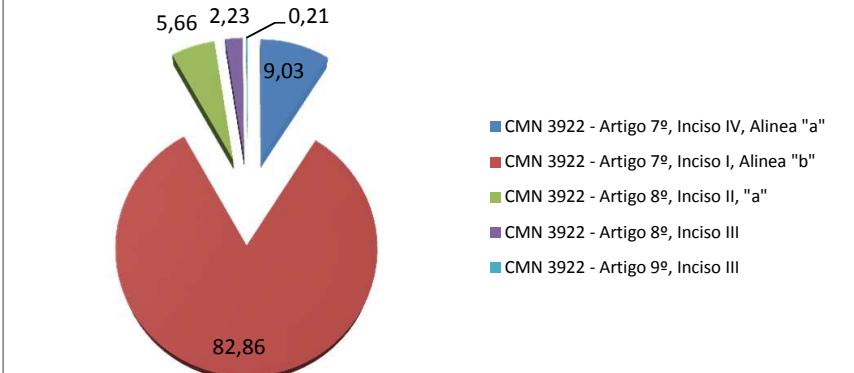
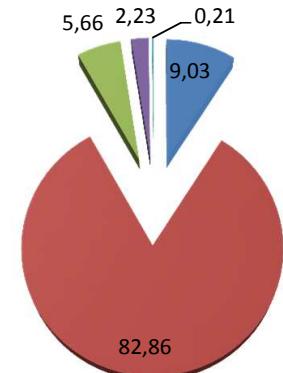
# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Índice de comparação : INPC + 6%

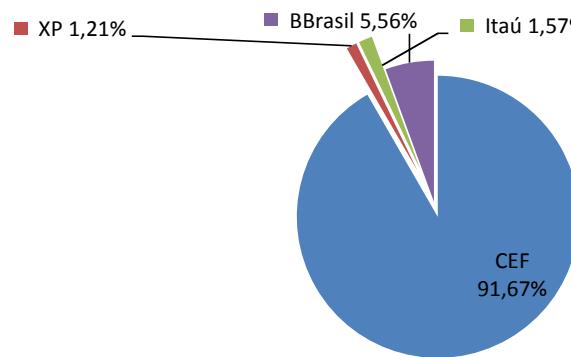
ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA							
ARTIGO	TIPO DE ATIVO	VALOR (R\$)	% CARTEIRA	POLÍTICA DE INVESTIMENTO	LIMITE PL DO FUNDO	ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE RES. 3922/2010
<strong>RENDA FIXA</strong>							
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	FI Renda Fixa	32.821.454,49	9,03	40%	15%	10%	40%
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	FI 100% Títulos TN	301.013.253,44	82,86	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>333.834.707,93</strong>	<strong>91,90</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	20.555.557,52	5,66	20%	15%	8%	20%
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	Multimercado	8.110.845,05	2,23	10%	5%	5%	10%
	<strong>Total Renda Variável</strong>	<strong>28.666.402,57</strong>	<strong>7,89</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	770.517,73	0,21	10%	15%	0,50%	10%
	<strong>Total Investimentos no Exterior</strong>	<strong>770.517,73</strong>	<strong>0,21</strong>				
	<strong>TOTAL</strong>	<strong>363.271.628,23</strong>	<strong>100,00</strong>				
<strong>GANHOS FINANCEIROS</strong>							
ESTRATÉGIA			GANHO BRUTO NO ANO R\$				
	GANHO BRUTO NO MÊS (R\$)						
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"			81.693,31	459.616,18			
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"			3.202.280,35	6.788.752,45			
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"			1.746.240,30	-4.604.563,65			
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III			60.563,30	15.450,89			
CMN 3922 - Artigo 9º, Inciso III			32.257,83	190.538,52			
	<strong>TOTAL</strong>	<strong>5.123.035,09</strong>	<strong>2.849.794,39</strong>				

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### ALOCAÇÃO POR ESTRATÉGIA

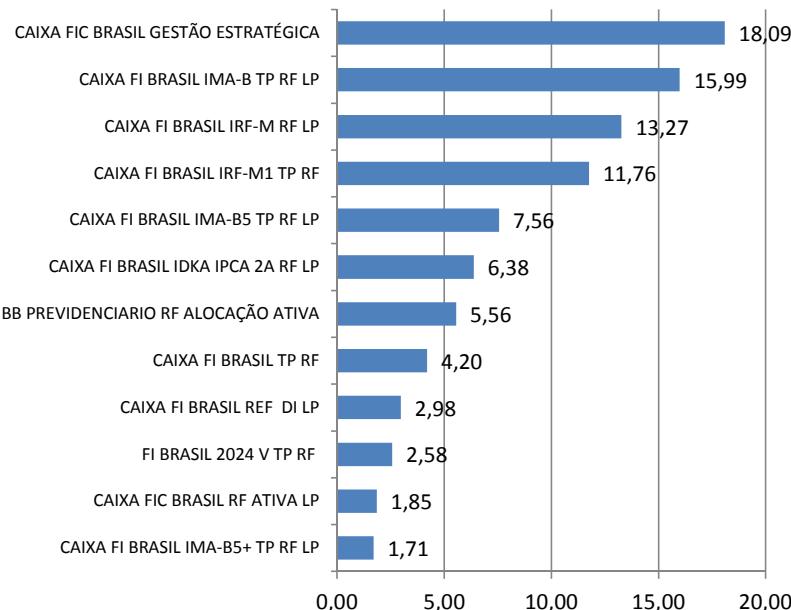


### ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

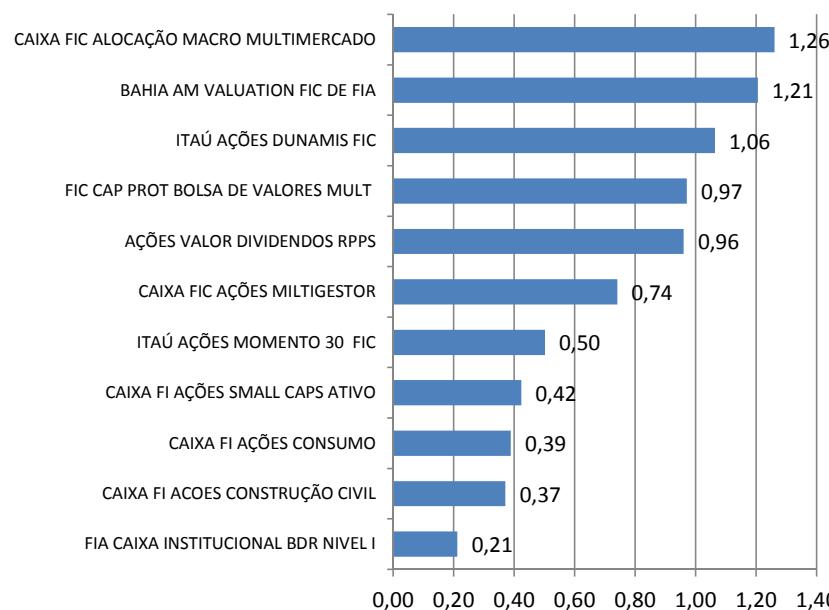


### ALOCAÇÃO POR ATIVOS

**25.078.994/0001-90**

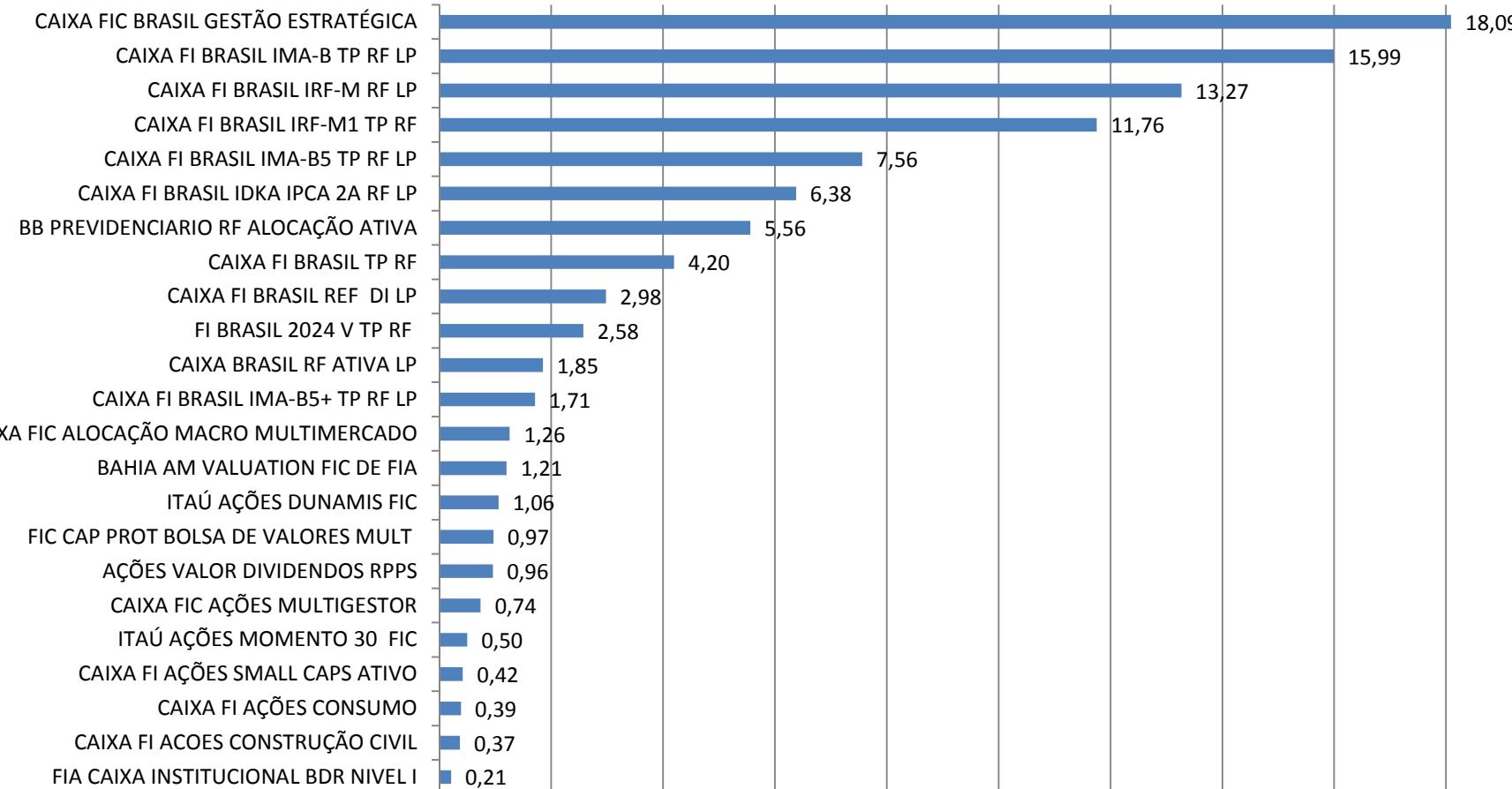


### RENDA VÁRIAVEL



## 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	10,7488
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	-0,06	-3,10	1,41	1,56	1,41							
INPC+5,87%	0,67	0,65	0,66	0,25	0,23	0,78							
p.p. Meta	-0,09	-0,71	-3,76	1,16	1,33	0,63							
% da Meta no Mês	86,94	-9,77	-479,51	570,78	692,03	181,30							

### RENTABILIDADE MENSAIS - 12 ÚLTIMOS MESES

25.078.994/0001-90

