



MUNICÍPIO DE TOLEDO

Estado do Paraná

Coordenação de Previdência – TOLEDOPREV

Relatório da Carteira de Investimentos - 2020

Recursos Previdenciários

JULHO

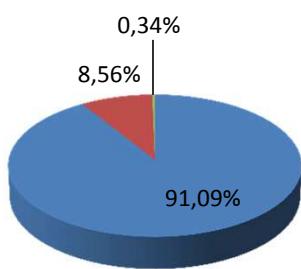
Os recursos Previdenciários são aplicados respeitando os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação e transparência.

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:

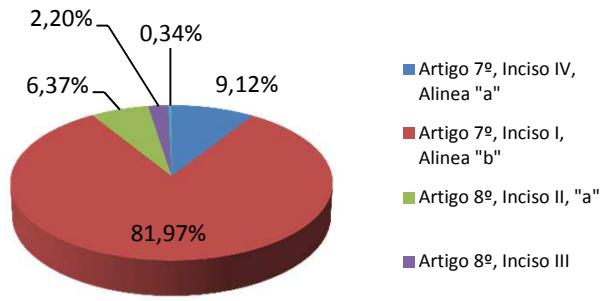
Distribuição dos Recursos

POR SEGMENTO



- RENDA FIXA
- RENDA VARIÁVEL
- INVEST NO EXTERIOR

POR ESTRATÉGIA



Total da Carteira de Investimentos

R\$ 372.301.193,09

Histórico de Rentabilidade

Carteira	No Ano	No Mês
Carteira	3,69	1,99
Meta Atuarial	4,21	0,92
% Meta Acumulada	87,51	216,36

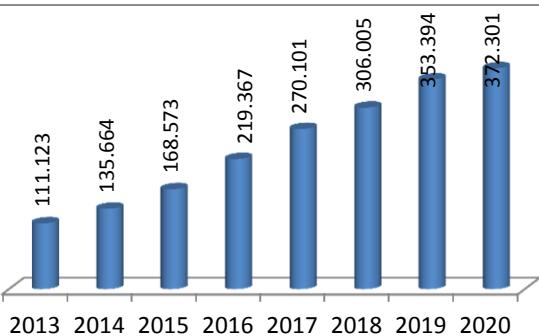
No Ano

3,69
4,21
87,51

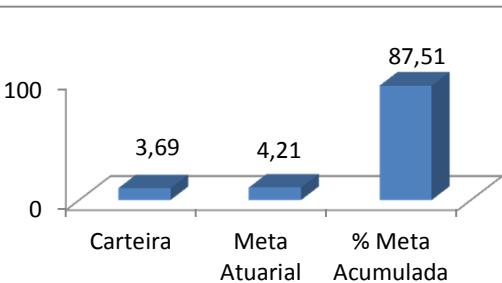
No Mês

1,99
0,92
216,36

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\$ 31/07/2020	% Carteira do RPPS	PL DO FUNDO	% NO PL DO FUNDO	
RENDIMENTO FIXO E REFERENCIADO EM DI															
CEF	CEF	05.164.356/0001-84	CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,16	0,19	CDI	74,60	82,34	2,02	4,26	15.289.467,11	4,11	5.369.451.851,24	0,28	D+0
CEF	CEF	03.737.206/0001-97	CAIXA FI BRASIL REF DI LONGO PRAZO	0,19	0,25	CDI	99,36	109,67	1,62	3,72	10.850.236,40	2,91	4.665.137.027,34	0,23	D+0
CEF	CEF	35.536.532/0001-22	CAIXA FIC BRASIL RF ATIVA LP	5,58	0,93	IPCA			2,97		7.832.195,07	2,10	317.928.560,39	2,46	
Sub-total Art. 7º, Inciso IV "a" - FI Renda Fixa - Limite para alocação dos recursos: 40%												33.971.898,58	9,12		
RENDIMENTO FIXO															
CEF	CEF	23.215.097/0001-55	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	5,6	0,98	IPCA	390,92	431,48	5,65	9,68	66.354.365,26	17,82	12.451.209.797,34	0,53	D+0
CEF	CEF	10.740.658/0001-93	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	10,65	4,38	IMA B	1750,00	1931,57	2,42	7,72	60.636.236,60	16,29	6.313.416.954,01	0,96	D+0
CEF	CEF	11.060.913/0001-10	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	3,84	0,97	IMA B5	389,44	429,85	4,05	8,54	27.733.259,03	7,45	12.027.903.790,65	0,23	D+0
CEF	CEF	10.577.503.0001-88	CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	16,95	7,29	IMA B5+	2916,72	3219,34	1,46	7,35	6.674.301,56	1,79	2.059.270.796,72	0,32	D+0
CEF	CEF	10.740.670/0001-06	CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF	0,58	0,24	IRF M1	96,40	106,40	2,73	5,30	41.710.273,78	11,20	10.907.406.871,77	0,38	D+0
CEF	CEF	14.508.605/0001-00	CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	5,64	1,09	IRF M	435,68	480,88	5,87	9,54	48.723.513,49	13,09	15.544.114.121,31	0,31	D+0
CEF	CEF	14.386.926/0001-71	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3,32	0,83	IDKA IPCA2	331,68	366,09	3,97	8,10	23.372.737,66	6,28	7.954.778.997,85	0,29	D+0
CEF	CEF	19.768.682/0001-05	FI BRASIL 2024 V TP RF	7,02	1,77	IMA B5	708,00	781,46	3,23	5,98	9.396.432,00	2,58	180.948.628,13	5,19	D+0
BB DTVM	BBDTVM	25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	5,51	1,77	IMA	707,08	780,44	3,55	7,10	20.556.708,29	5,52	10.799.663.748,52	0,19	D+0
Sub-total Art. 7º, Inciso IV "b" - FI 100% Títulos TN - Limite para alocação dos recursos: 100%												305.157.827,67	81,97		
RENDIMENTO VARIÁVEL - AÇÕES															
CEF	CEF	30.068.224/0001-04	CAIXA FIC AÇÕES MULTIGESTOR (25/06/2019)	42,00	10,34	IBOVESPA	4135,16	4564,19	-5,84	10,26	3.315.739,23	0,89	872.742.979,00	0,38	D+23
VINCI EQUITIES	CEF	15.154.441/0001-15	FIC AÇÕES VALOR DIVIDENDOS RPPS	37,05	8,32	IDIV	3328,00	3673,29	-9,87	4,7	3.781.156,61	1,02	862.156.434,48	0,44	D+30
CEF	CEF	15.154.220/0001-47	CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	45,08	9,27	SMLL	3709,84	4094,75	-14,17	6,10	1.680.341,76	0,45	1.227.996.315,01	0,14	D+1
CEF	CEF	10.551.375/0001-01	CAIXA FI AÇOES CONSTRUÇÃO CIVIL	56,47	6,94	IMOB11	2774,56	3062,43	-25,46	6,86	1.442.256,82	0,39	575.045.117,36	0,25	D+1
CEF	CEF	10.577.512/0001-79	CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	43,15	7,41	ICON	2964,96	3272,58	-4,73	11,99	1.518.419,10	0,41	737.824.163,56	0,21	D+1
ITAÚ	ITAÚ	24.571.992/0001-75	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	40,97	7,54	IBOVESPA	3016,00	3328,92	-16,38	-0,92	4.157.659,76	1,12	3.482.474.100,00	0,12	D+21
ITAÚ	ITAÚ	16.718.302/0001-30	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30	39,18	9,40	IBOVESPA	3760,00	4150,11	-6,63	6,25	2.978.866,26	0,80	1.826.640.201,67	0,16	D+21
BAHIA RV	BEM DTVM	09.635.172/0001-06	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	41,93	10,35	IBOVESPA	4140,00	4569,54	-8,92	5,22	4.835.486,46	1,30	1.108.758.492,93	0,44	D+30
Sub-total Art. 8º, Inciso II, "a" - Ações - Limite para alocação dos recursos: 20%												23.709.926,00	6,37		
RENDIMENTO VARIÁVEL - MULTIMERCADO															
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)	1,68	0,05	IBOVESPA	21,88	24,15	1,85	4,66	3.531.540,05	0,95	507.871.987,12	0,70	D+0
CEF	CEF	08.070.841/0001-87	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	7,33	1,41	CDI	562,36	620,71	0,36	6,35	4.645.647,63	1,25	4.779.150.272,41	0,10	D+1
Sub-total Art. 8º, Inciso III - Multimercado - Limite para alocação dos recursos: 10%												8.177.187,68	2,20		
INVESTIMENTO NO EXTERIOR															
CEF	CEF	17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	25,54	1,88	AÇÕES	752,00	830,02	35,34	55,47	1.284.353,16	0,34	1.279.266.331,34	0,10	D+1
Sub-total Art. 9º, Inciso III - Ações BDR Nível I - Limite para alocação dos recursos: 10%												1.284.353,16	0,34		
TOTAL												372.301.193,09	100,00		

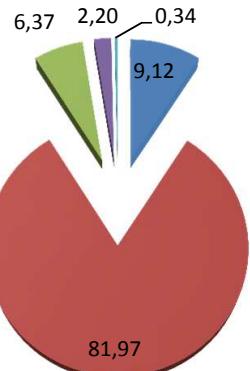
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Índice de comparação : INPC + 6%

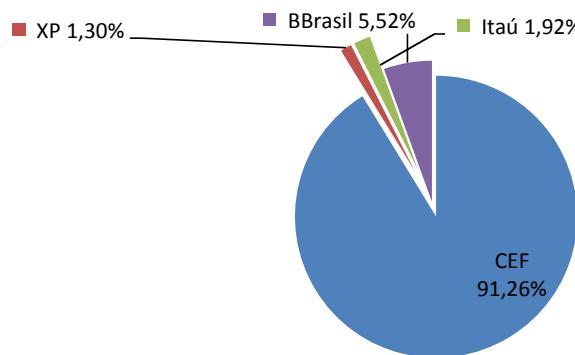
ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA								
ARTIGO	TIPO DE ATIVO	VALOR (R\$)	% CARTEIRA	POLÍTICA DE INVESTIMENTO	LIMITE PL DO FUNDO	ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE RES. 3922/2010	
RENDA FIXA								
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	FI Renda Fixa	33.971.898,58	9,12	40%	15%	10%	40%	
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	FI 100% Títulos TN	305.157.827,67	81,97	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%	
	Total Renda Fixa	339.129.726,25	91,09					
RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS								
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	23.709.926,00	6,37	20%	15%	8%	20%	
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	Multimercado	8.177.187,68	2,20	10%	5%	5%	10%	
	Total Renda Variável	31.887.113,68	8,56					
INVESTIMENTO NO EXTERIOR								
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	1.284.353,16	0,34	10%	15%	0,50%	10%	
	Total Investimentos no Exterior	1.284.353,16	0,34					
	TOTAL	372.301.193,09	100,00					
GANHOS FINANCEIROS								
ESTRATÉGIA			GANHO BRUTO NO MÊS (R\$)	GANHO BRUTO NO ANO R\$				
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"		118.406,60	578.022,78					
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"		5.250.882,85	12.039.635,30					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"		1.789.803,91	-2.814.759,74					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III		66.342,63	81.793,52					
CMN 3922 - Artigo 9º, Inciso III		13.835,43	204.373,95					
	TOTAL	7.239.271,42	10.089.065,81					

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

ALOCAÇÃO POR ESTRATÉGIA

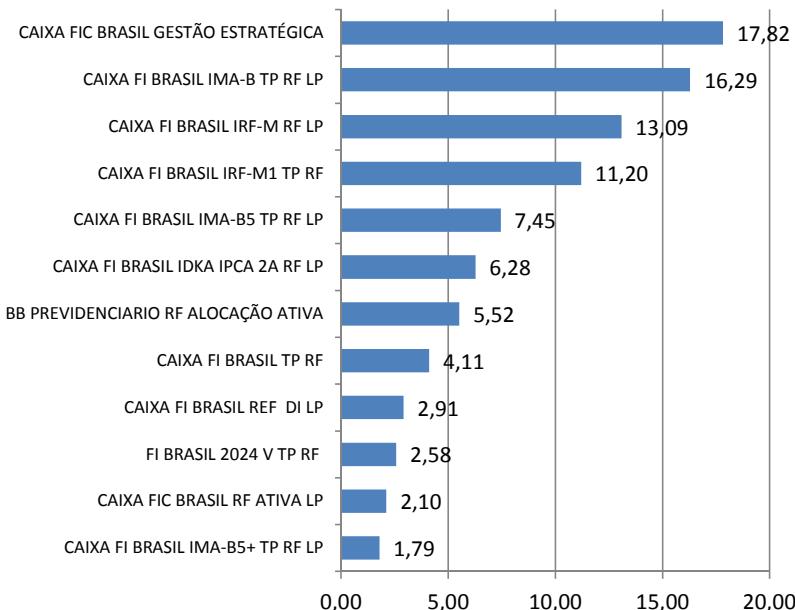


ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

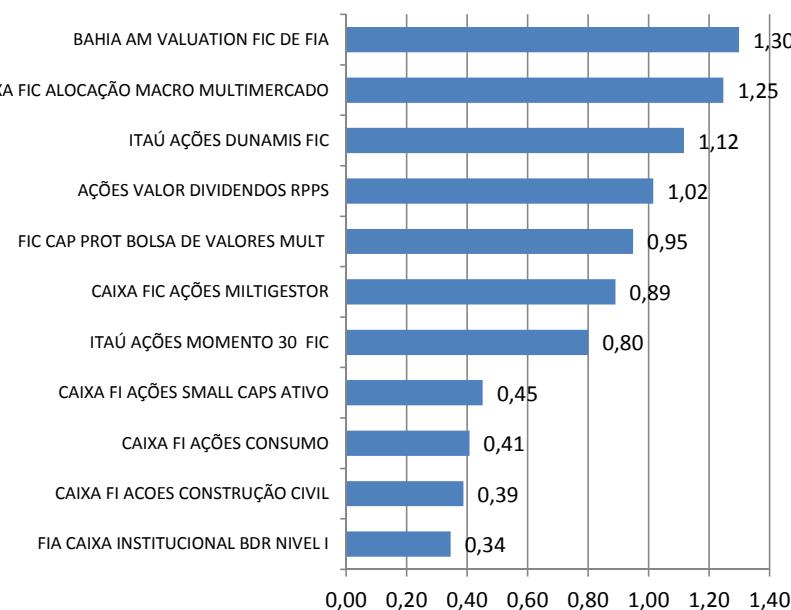


ALOCAÇÃO POR ATIVOS

25.078.994/0001-90

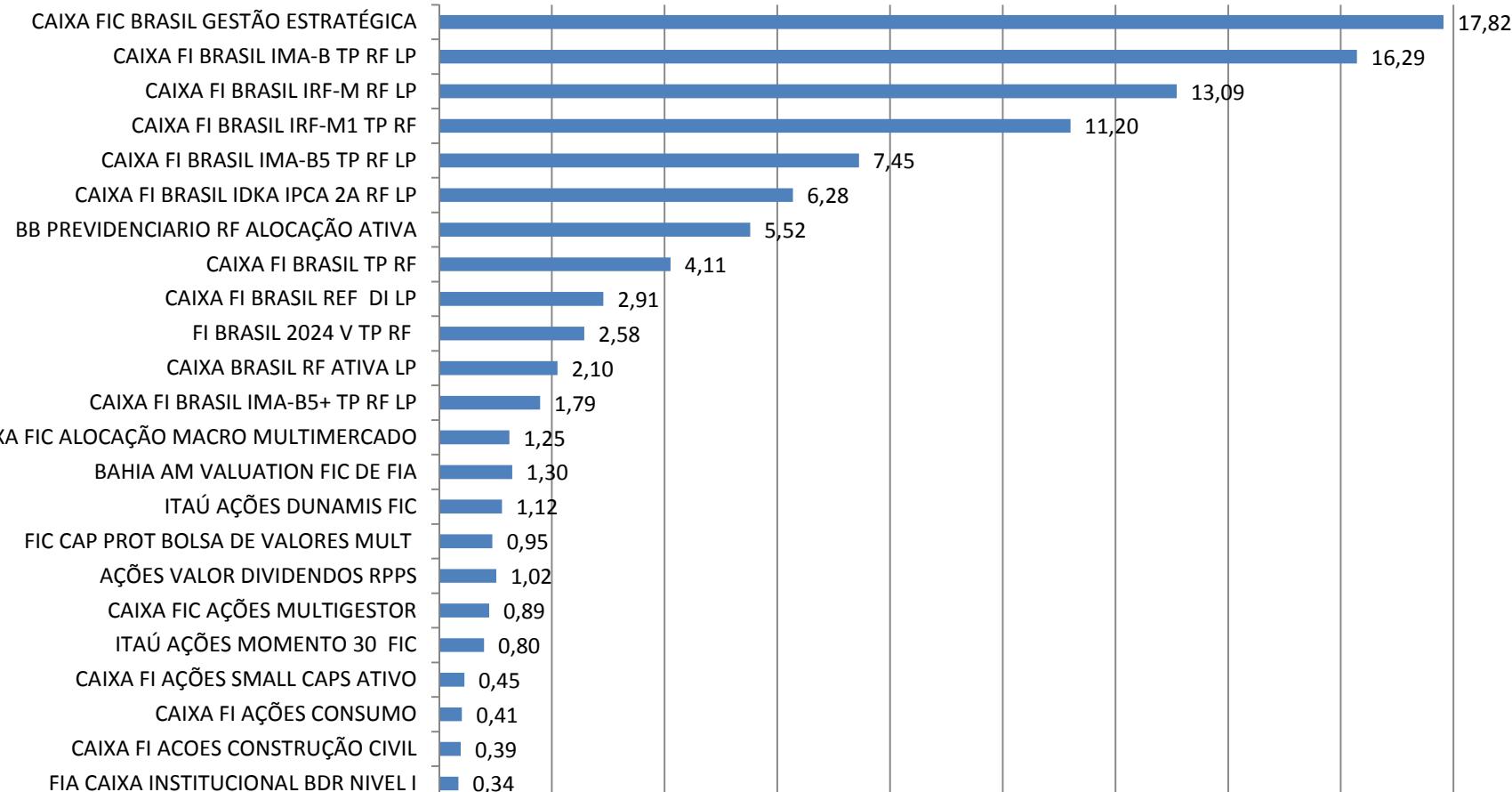


RENDA VÁRIAVEL



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	1,99						
INPC+5,87%	0,67	0,65	0,66	0,25	0,23	0,78	0,92						
p.p. Meta	-0,09	-0,71	-3,76	1,16	1,33	0,63	1,07						
% da Meta no Mês	86,94	-9,77	-479,51	570,78	692,03	181,30	216,36						

RENTABILIDADE MENSAL - 12 ÚLTIMOS MESES

25.078.994/0001-90

