



# MUNICÍPIO DE TOLEDO

## Estado do Paraná

### Coordenação de Previdência – TOLEDOPREV

#### Relatório da Carteira de Investimentos - 2020

Recursos Previdenciários

AGOSTO

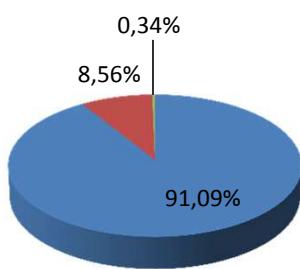
Os recursos Previdenciários são aplicados respeitando os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação e transparência.

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:

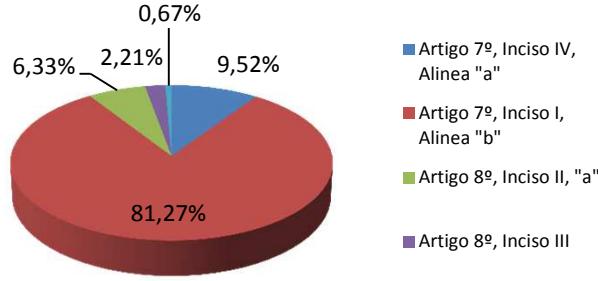
#### Distribuição dos Recursos

##### POR SEGMENTO



- RENDA FIXA
- RENDA VARIÁVEL
- INVEST NO EXTERIOR

##### POR ESTRATÉGIA



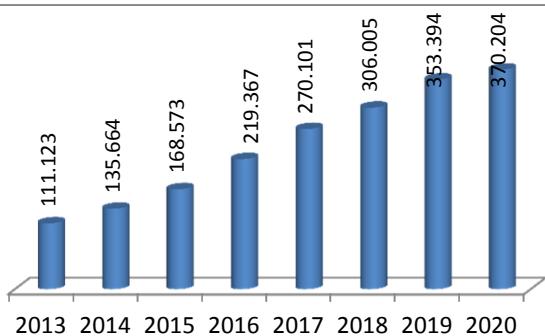
#### Total da Carteira de Investimentos

R\$ 370.204.829,64

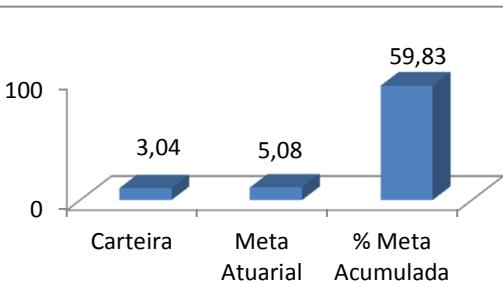
#### Histórico de Rentabilidade

Carteira	No Ano	No Mês
Carteira	3,04	-0,62
Meta Atuarial	5,08	0,84
% Meta Acumulada	59,83	-74,02

#### 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\$ 31/08/2020	% 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	0,16	0,15	CDI	58,60	64,68	2,17	3,90	15.311.870,35	4,14	5.871.239.975,92	0,26	D+0
CEF	CEF	03.737.206/0001-97	CAIXA FI BRASIL REF DI LONGO PRAZO	0,19	0,15	CDI	58,00	64,02	1,77	3,36	10.865.966,10	2,94	4.687.255.346,64	0,23	D+0
CEF	CEF	35.536.532/0001-22	CAIXA FIC BRASIL RF ATIVA LP	5,58	-0,35	IPCA			2,61		9.049.065,96	2,44	475.936.731,51	1,90	
<b>Sub-total Art. 7º, Inciso IV "a" - FI Renda Fixa - Limite para alocação dos recursos: 40%</b>												35.226.902,41	9,52		
<b>RENDIMENTO FIXO</b>															
CEF	CEF	23.215.097/0001-55	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	5,6	-0,56	IPCA	-222,88	-246,00	5,06	9,21	65.984.666,72	17,82	13.462.808.031,45	0,49	D+0
CEF	CEF	10.740.658/0001-93	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	10,65	-1,83	IMA B	-732,16	-808,12	0,54	6,20	59.526.357,42	16,08	6.019.680.821,86	0,99	D+0
CEF	CEF	11.060.913/0001-10	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	3,84	0,39	IMA B5	156,72	172,98	4,45	8,93	27.841.918,14	7,52	12.740.710.327,20	0,22	D+0
CEF	CEF	10.577.503.0001-88	CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	16,95	-3,64	IMA B5+	-1457,32	-1608,52	-2,24	4,26	6.431.135,41	1,74	1.873.284.904,48	0,34	D+0
CEF	CEF	10.740.670/0001-06	CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF	0,58	0,10	IRF M1	38,60	42,60	2,83	4,85	39.632.731,28	10,71	10.245.504.415,29	0,39	D+0
CEF	CEF	14.508.605/0001-00	CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	5,64	-0,77	IRF M	-308,04	-340,00	5,06	8,49	48.348.272,67	13,06	16.114.955.012,29	0,30	D+0
CEF	CEF	14.386.926/0001-71	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	3,32	0,79	IDKA IPCA2	316,60	349,45	4,80	8,84	23.557.742,15	6,36	8.901.363.723,20	0,26	D+0
CEF	CEF	19.768.682/0001-05	FI BRASIL 2024 V TP RF	7,02	-2,48	IMA B5	-992,00	-1094,92	0,67	5,84	9.163.392,00	2,58	176.460.941,04	5,19	D+0
BB DTVM	BBDTVM	25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	5,51	-0,89	IMA	-355,48	-392,36	2,63	6,05	20.374.010,51	5,50	10.897.747.304,90	0,19	D+0
<b>Sub-total Art. 7º, Inciso IV "a" - FI Renda Fixa - Limite para alocação dos recursos: 40%</b>												300.860.226,30	81,27		
<b>RENDIMENTO VARIÁVEL - AÇÕES</b>															
CEF	CEF	30.068.224/0001-04	CAIXA FIC AÇÕES MULTIGESTOR (25/06/2019)	42,00	-3,45	IBOVESPA	-1380,96	-1524,24	-10,02	6,16	3.566.173,99	0,96	869.696.020,28	0,41	D+23
VINCI EQUITIES	CEF	15.154.441/0001-15	FIC AÇÕES VALOR DIVIDENDOS RPPS	37,05	-3,82	IDIV	-1528,00	-1686,53	-13,31	-1,14	3.636.641,88	0,98	819.770.596,51	0,44	D+30
CEF	CEF	15.154.220/0001-47	CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	45,08	-1,39	SMLL	-554,00	-611,48	-15,36	3,92	1.657.069,21	0,45	1.226.260.606,95	0,14	D+1
CEF	CEF	10.551.375/0001-01	CAIXA FI AÇOES CONSTRUÇÃO CIVIL	56,47	-7,99	IMOB11	-3196,16	-3527,77	-31,42	-13,77	1.327.015,20	0,36	529.350.277,83	0,25	D+1
CEF	CEF	10.577.512/0001-79	CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	43,15	-1,59	ICON	-637,20	-703,31	-6,25	5,57	1.494.230,67	0,40	750.936.914,19	0,20	D+1
ITAÚ	ITAÚ	24.571.992/0001-75	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	40,97	-0,20	IBOVESPA	-80,00	-88,30	-16,55	-2,64	4.149.507,05	1,12	3.382.143.848,22	0,12	D+21
ITAÚ	ITAÚ	16.718.302/0001-30	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30	39,18	-1,41	IBOVESPA	-564,00	-622,52	-7,94	3,73	2.936.847,30	0,79	1.880.767.542,38	0,16	D+21
BAHIA RV	BEM DTVM	09.635.172/0001-06	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	41,93	-3,12	IBOVESPA	-1248,00	-1377,48	-11,76	2,31	4.684.604,57	1,27	1.018.121.260,04	0,46	D+30
<b>Sub-total Art. 8º, Inciso II, "a" - Ações - Limite para alocação dos recursos: 20%</b>												23.452.089,87	6,33		
<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)	1,68	0,02	IBOVESPA	9,08	10,02	1,87	4,31	3.532.342,37	0,95	507.987.368,29	0,70	D+0
CEF	CEF	08.070.841/0001-87	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	7,33	-0,14	CDI	-54,64	-60,31	0,22	5,57	4.639.300,86	1,25	5.030.518.008,95	0,09	D+1
<b>Sub-total Art. 8º, Inciso III - Multimercado - Limite para alocação dos recursos: 10%</b>												8.171.643,23	2,21		
<b>INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>															
CEF	CEF	17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	25,54	15,16	AÇÕES	6064,00	6693,16	55,87	68,87	2.493.967,83	0,67	1.583.297.843,04	0,16	D+1
<b>Sub-total Art. 9º, Inciso III - Ações BDR Nível I - Limite para alocação dos recursos: 10%</b>												2.493.967,83	0,67		
<b>TOTAL</b>												370.204.829,64	100,00		

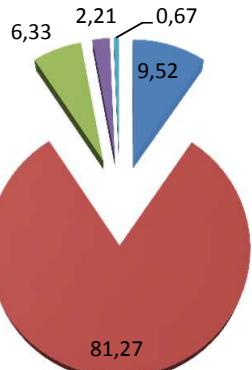
# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	35.226.902,41	9,52	40%	15%	10%	40%
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	FI 100% Títulos TN	300.860.226,30	81,27	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>336.087.128,71</strong>	<strong>90,78</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	23.452.089,87	6,33	20%	15%	8%	20%
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	Multimercado	8.171.643,23	2,21	10%	5%	5%	10%
	<strong>Total Renda Variável</strong>	<strong>31.623.733,10</strong>	<strong>8,54</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	2.493.967,83	0,67	10%	15%	0,50%	10%
	<strong>Total Investimentos no Exterior</strong>	<strong>2.493.967,83</strong>	<strong>0,67</strong>				
	<strong>TOTAL</strong>	<strong>370.204.829,64</strong>	<strong>100,00</strong>				
<strong>GANHOS FINANCEIROS</strong>							
ESTRATÉGIA	GANHO BRUTO NO MÊS (R\$)		GANHO BRUTO NO ANO R\$				
	12.200,25	590.223,03					
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	-1.968.511,75	10.071.123,55					
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	-625.656,87	-3.440.416,61					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"	-5.544,45	76.249,07					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	209.614,67	413.988,62					
	<strong>TOTAL</strong>	<strong>-2.377.898,15</strong>	<strong>7.711.167,66</strong>				

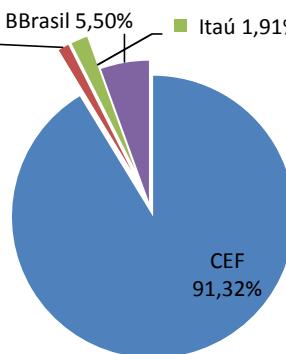
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### ALOCAÇÃO POR ESTRATÉGIA



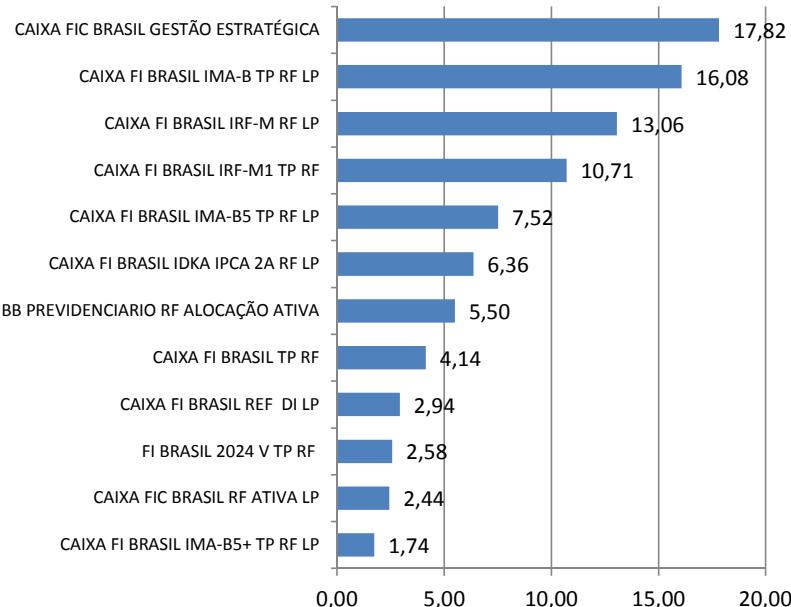
- CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"
- CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"
- CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"
- CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III
- CMN 3922 - Artigo 9º, Inciso III

### ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

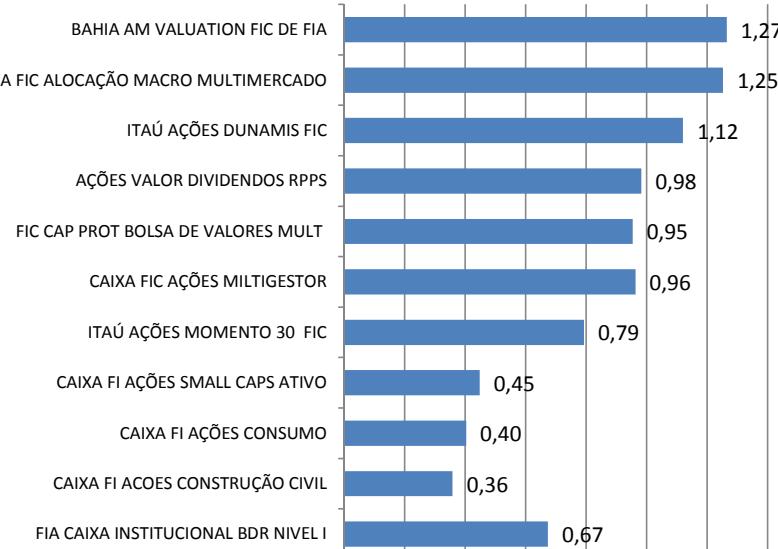


### ALOCAÇÃO POR ATIVOS

**25.078.994/0001-90**

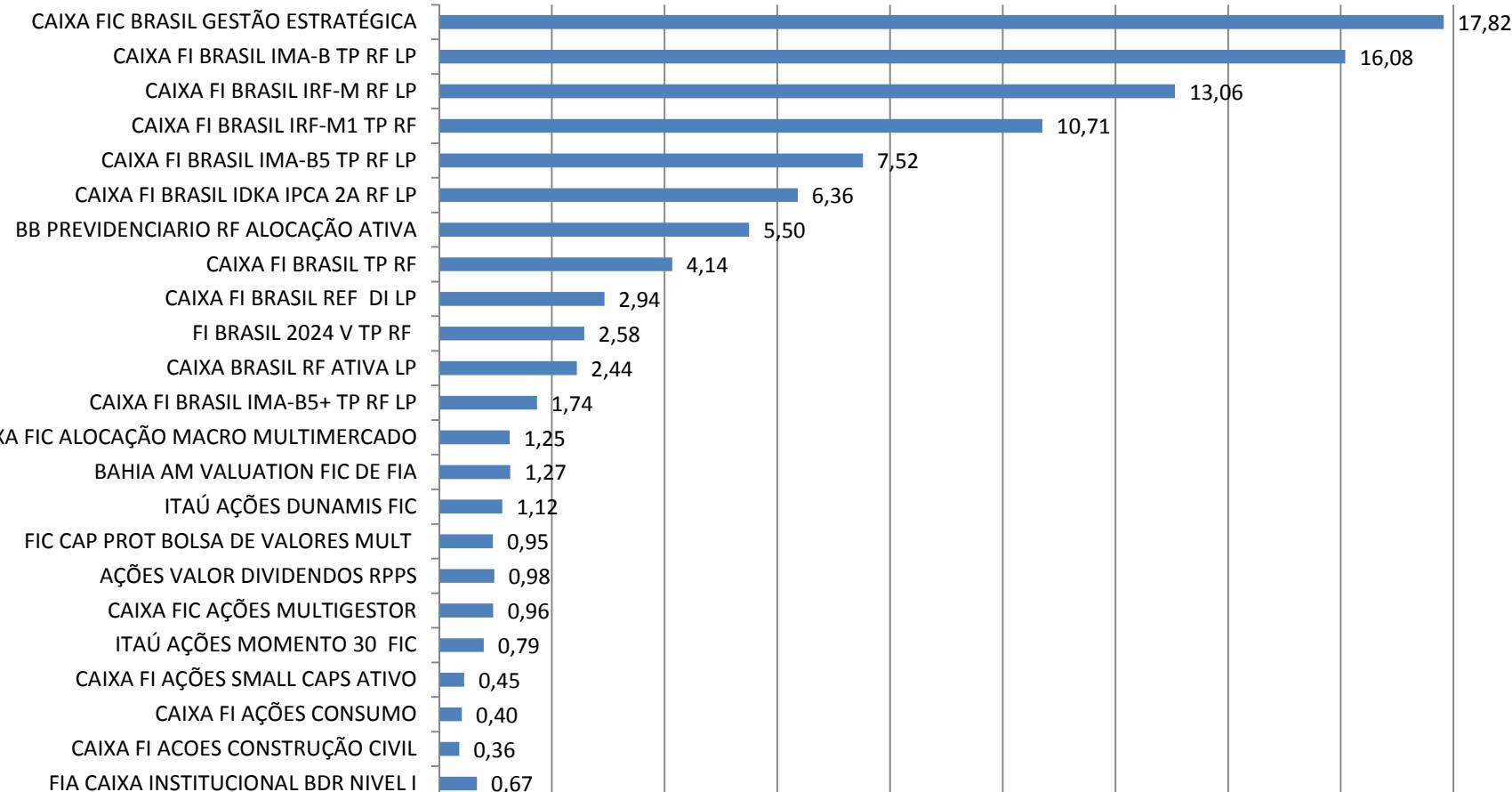


### RENDA VÁRIAVEL



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### ALOCAÇÃO POR ATIVOS



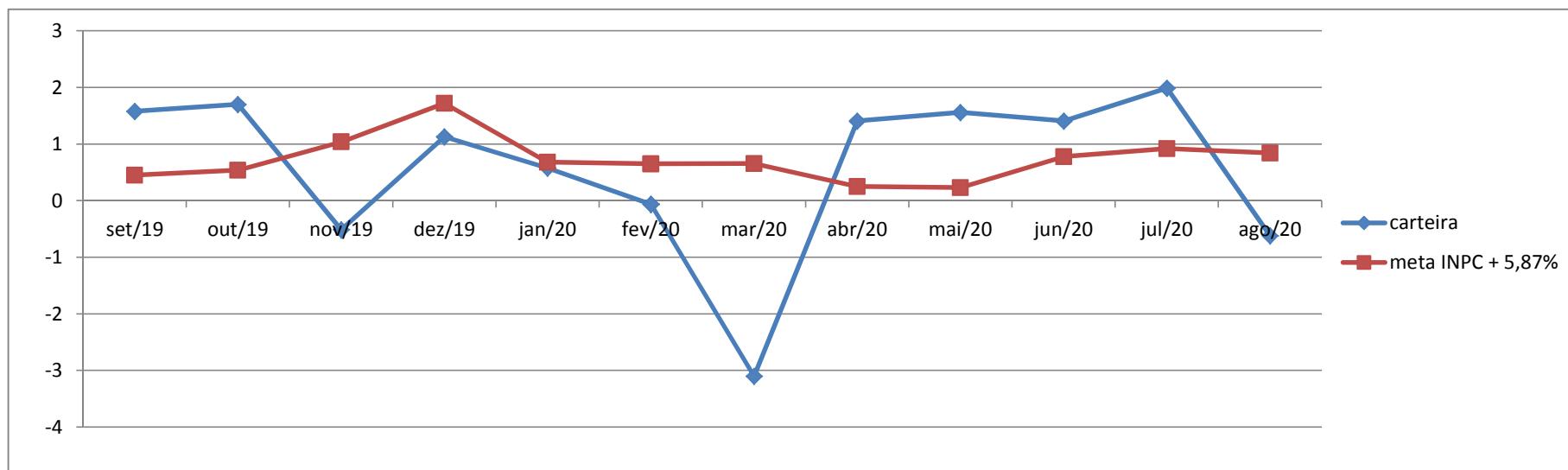
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### 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	10,749
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					
INPC+5,87%		0,67	0,65	0,66	0,25	0,23	0,78	0,92	0,84					
p.p. Meta		-0,09	-0,71	-3,76	1,16	1,33	0,63	1,07	-1,46					
% da Meta no Mês		86,94	-9,77	-479,51	570,78	692,03	181,30	216,36	-74,02					

### 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	47%	03 meses	2,78	2,53%	0,25	4,75
Meses abaixo do Benchmark	17	53%	06 meses	2,59	3,66%	-1,07	6,78
	Rentab.	Mês	12 meses	7,02	8,73%	-1,71	5,06
<b>Maior</b> Rentabilidade da Carteira	1,99%	jul/20	24 meses	16,44	17,97%	-1,53	3,63
<b>Menor</b> Rentabilidade da Carteira	-3,10%	mar/20	36 meses				
			Desde jan/18	20,48	24,77%	-4,29	3,16

### Retorno Mensal - Carteira vs Meta

