



# MUNICÍPIO DE TOLEDO

## Estado do Paraná

### Coordenação de Previdência – TOLEDOPREV

#### Relatório da Carteira de Investimentos - 2020

Recursos Previdenciários

MAIO

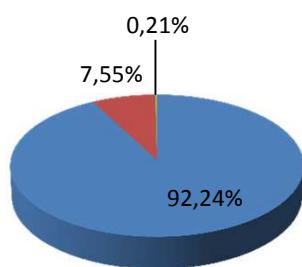
Os recursos Previdenciários são aplicados respeitando os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação e transparência.

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.

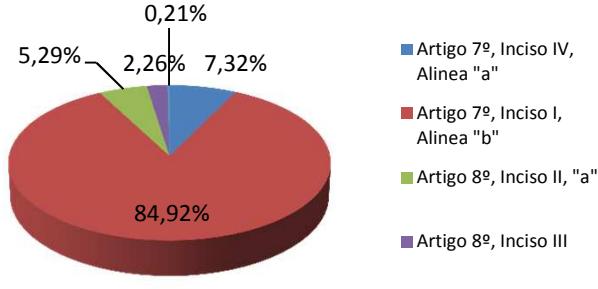
Neste mês a carteira de investimentos está distribuída da seguinte forma:

#### Distribuição dos Recursos

##### POR SEGMENTO



##### POR ESTRATÉGIA



#### Total da Carteira de Investimentos

R\$ 355.706.880,65

#### Histórico de Rentabilidade

Carteira	No Ano	No Mês
Carteira	0,25	1,56
Meta Atuarial	2,47	0,23
% Meta Acumulada	10,18	692,03

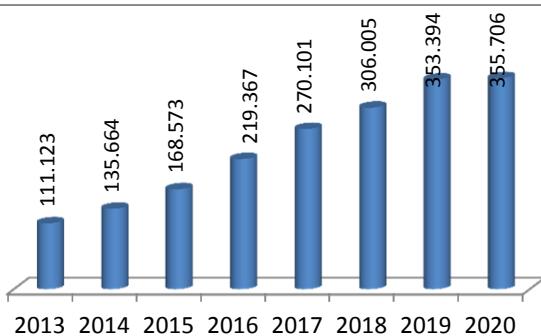
##### No Ano

0,25  
2,47  
10,18

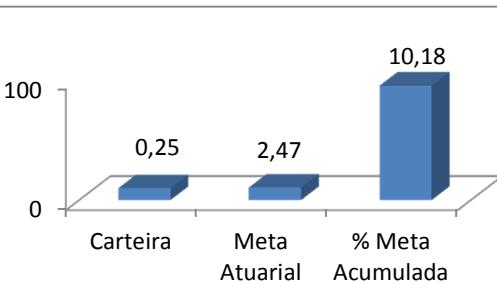
##### No Mês

1,56  
0,23  
692,03

#### 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\$ 30/04/2020	% Carteira do RPPS	PL DO FUNDO	% NO PL DO FUNDO	Conversão de Cotas para Resgate
<b>RENDA FIXA E REFERENCIADO EM DI</b>														
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,2522	0,25	CDI	101,84	112,41	1,61	4,92	15.228.141,59	4,28	4.436.706.354,03	0,34	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LONGO PRAZO	0,9248	0,33	CDI	131,32	144,94	1,12	4,25	10.797.134,38	3,04	4.656.011.205,04	0,23	D+0
Sub-total Art. 7º, Inciso IV "a" - FI Renda Fixa - Limite para alocação dos recursos: 40%											26.025.275,97	7,32		
<b>RENDA FIXA</b>														
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	10,2001	1,38	IPCA	551,48	608,70	3,85	11,99	65.223.238,99	18,34	12.026.220.422,43	0,54	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	18,5984	1,50	IMA B	600,24	662,52	-3,82	6,23	56.941.415,95	16,01	5.962.762.833,75	0,95	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	6,6892	2,11	IMA B5	842,12	929,49	1,92	9,15	27.167.388,51	7,64	8.882.233.150,63	0,31	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	29,5620	1,00	IMA B5+	400,04	441,55	-8,04	3,72	6.049.662,21	1,70	1.931.164.845,98	0,31	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF	1,0006	0,39	IRF M1	157,20	173,51	2,22	6,11	42.597.470,11	11,98	10.824.772.393,85	0,39	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	10,2065	1,40	IRF M	558,16	616,07	3,93	11,04	47.831.424,86	13,45	16.970.991.295,24	0,28	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	5,6608	1,91	IDKA IPCA2	762,16	841,24	1,92	8,24	27.142.666,87	7,63	7.977.728.907,89	0,34	D+0
CEF	CEF	FI BRASIL 2024 V TP RF	11,9983	3,15	IMA B5	1260,00	1390,73	1,92	8,24	9.120.684,00	2,58	175.638.582,48	5,19	D+0
BB DTVM	BBDTVM	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	9,9054	1,07	IMA	428,84	473,33	0,79	7,59	20.009.794,31	5,63	10.653.642.517,78	0,19	D+0
Sub-total Art. 7º, Inciso IV "b" - FI 100% Títulos TN - Limite para alocação dos recursos: 100%											302.083.745,81	84,92		
<b>RENDA VARIÁVEL - AÇÕES</b>														
CEF	CEF	CAIXA FIC AÇÕES MULTIGESTOR (25/06/2019)	45,2023	7,64	IBOVESPA	3055,88	3372,94	-22,34	-	2.450.420,87	0,69	675.158.975,61	0,36	D+23
VINCI EQUITIES	CEF	FIC AÇÕES VALOR DIVIDENDOS RPPS	41,9732	7,50	IDIV	3000,00	3311,26	-20,43	-1,18	3.337.880,62	0,94	768.284.939,45	0,43	D+30
CEF	CEF	CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	47,0697	4,76	SMLL	1905,44	2103,13	-30,42	-2,38	1.362.103,77	0,38	950.738.261,40	0,14	D+1
CEF	CEF	CAIXA FI ACOES CONSTRUÇÃO CIVIL	68,4448	0,86	IMOB11	345,52	381,37	-41,01	-8,37	1.141.388,41	0,32	396.958.694,35	0,29	D+1
CEF	CEF	CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	48,2822	7,55	ICON	3020,64	3334,04	-19,23	8,37	1.287.427,50	0,36	601.617.138,96	0,21	D+1
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	50,496	5,36	IBOVESPA	2144,00	2366,45	-28,85	-6,21	3.537.921,82	0,99	3.016.388.876,97	0,12	D+21
ITAU	ITAU	ITAU AÇÕES MOMENTO 30	47,9798	6,10	IBOVESPA	2440,00	2693,16	-23,43	-5,21	1.636.342,95	0,46	1.359.288.645,95	0,12	D+21
BAHIA RV	BEM DTVM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	42,6024	8,34	IBOVESPA	3336,00	3682,12	-23,61	-7,03	4.055.831,28	1,14	926.402.790,16	0,44	D+30
Sub-total Art. 8º, Inciso II, "a" - Ações - Limite para alocação dos recursos: 20%											18.809.317,22	5,29		
<b>RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO</b>														
CEF	CEF	FIC CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT (13/08/2018)	0,7805	0,26	IBOVESPA	105,60	116,56	1,68	6,33	3.525.738,40	0,99	507.037.648,57	0,70	D+0
CEF	CEF	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	9,2305	1,43	CDI	572,04	631,39	-2,26	7,39	4.524.543,35	1,27	4.394.194.294,70	0,10	D+1
Sub-total Art. 8º, Inciso III - Multimercado - Limite para alocação dos recursos: 10%											8.050.281,75	2,26		
<b>INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>														
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	33,8654	2,78	AÇÕES	1112,00	1227,37	27,29	53,85	738.259,90	0,21	1.133.955.741,98	0,07	D+1
Sub-total Art. 9º, Inciso III - Ações BDR Nível I - Limite para alocação dos recursos: 10%											738.259,90	0,21		
											355.706.880,65	100,00		

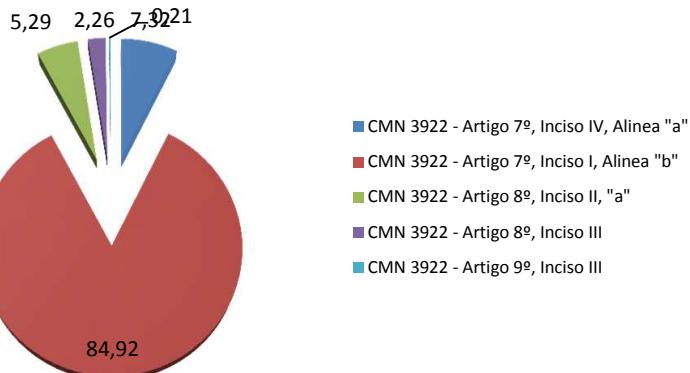
# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Índice de comparação : INPC + 6%

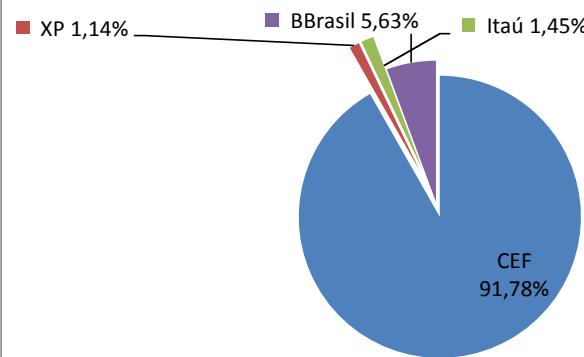
ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA							
ARTIGO	TIPO DE ATIVO	VALOR (R\$)	% CARTEIRA	POLÍTICA DE INVESTIMENTO	LIMITE PL DO FUNDO	ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE RES. 3922/2010
<strong>RENDA FIXA</strong>							
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	FI Renda Fixa	26.025.275,97	7,32	40%	15%	10%	40%
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	FI 100% Títulos TN	302.083.745,81	84,92	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>328.109.021,78</strong>	<strong>92,24</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	18.809.317,22	5,29	20%	15%	8%	20%
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	Multimercado	8.050.281,75	2,26	10%	5%	5%	10%
	<strong>Total Renda Variável</strong>	<strong>26.859.598,97</strong>	<strong>7,55</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	738.259,90	0,21	10%	15%	0,50%	10%
	<strong>Total Investimentos no Exterior</strong>	<strong>738.259,90</strong>	<strong>0,21</strong>				
	<strong>TOTAL</strong>	<strong>355.706.880,65</strong>	<strong>100,00</strong>				
<strong>GANHOS FINANCEIROS</strong>							
ESTRATÉGIA		GANHO BRUTO NO MÊS (R\$)	GANHO BRUTO NO ANO R\$				
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"		74.342,05	377.922,87				
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"		4.210.104,54	3.586.472,10				
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"		1.155.276,41	-6.350.803,95				
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III		73.082,21	-45.112,41				
CMN 3922 - Artigo 9º, Inciso III		19.979,41	158.280,69				
	<strong>TOTAL</strong>	<strong>5.532.784,62</strong>	<strong>-2.273.240,70</strong>				

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

### ALOCAÇÃO POR ESTRATÉGIA

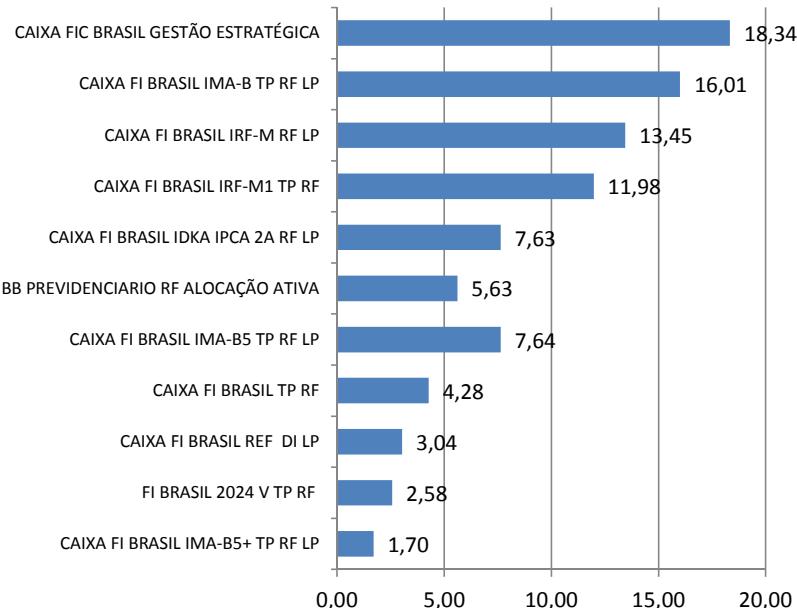


### ALOCAÇÃO POR INSTITUIÇÃO

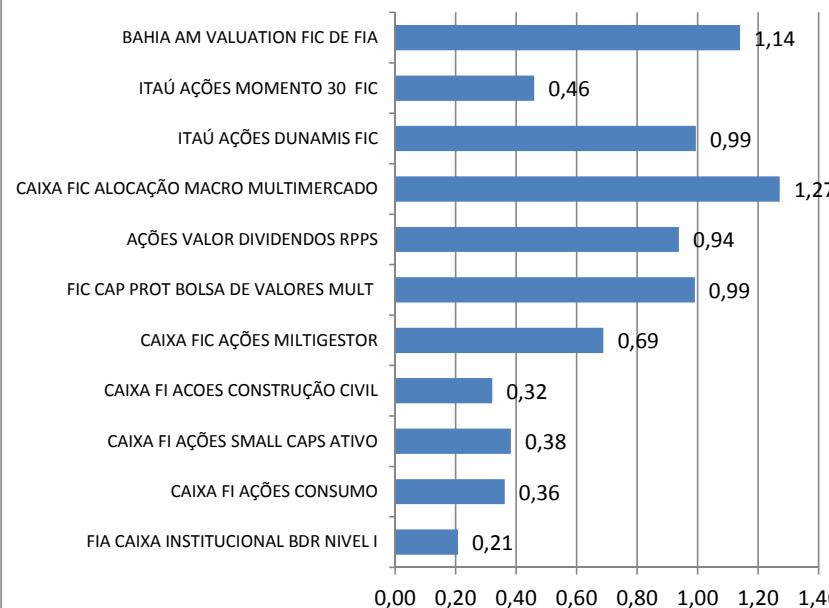


## ALOCAÇÃO POR ATIVOS

### RENDA FIXA

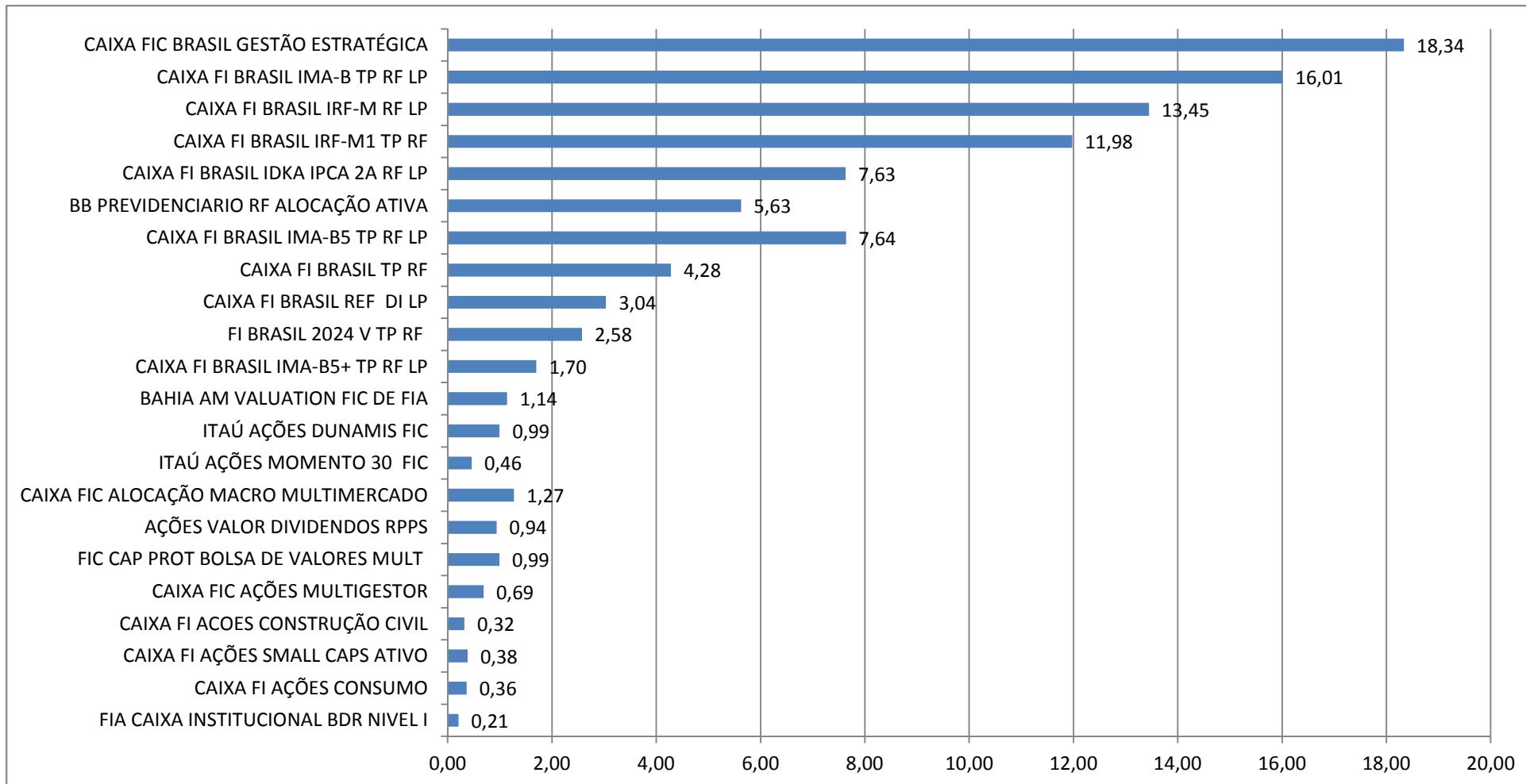


### RENDA VÁRIAVEL



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

### RENTABILIDADE MENSAIS - 12 ÚLTIMOS MESES

