



MUNICÍPIO DE TOLEDO

Estado do Paraná

Coordenação de Previdência – TOLEDOPREV

Relatório da Carteira de Investimentos - 2020

Recursos Previdenciários

FEVEREIRO

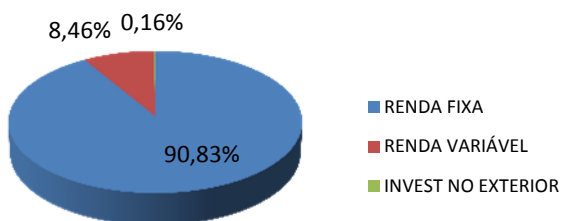
Os recursos Previdenciários são aplicados respeitando os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação e transparência.

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.

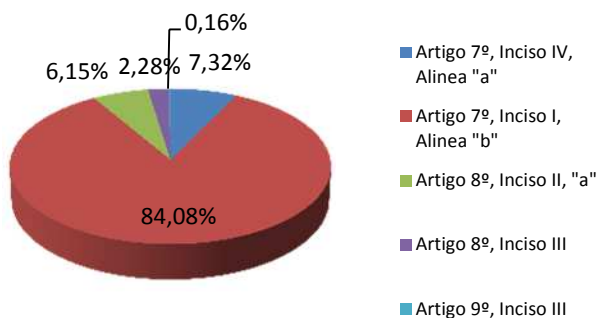
Neste mês a carteira de investimentos está distribuída da seguinte forma:

Distribuição dos Recursos

POR SEGMENTO



POR ESTRATÉGIA



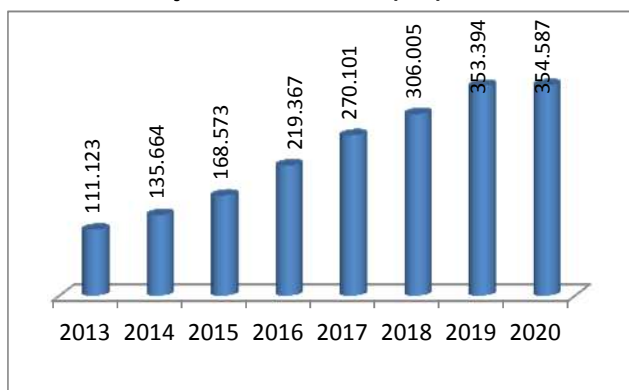
Total da Carteira de Investimentos

R\$ 354.587.877,95

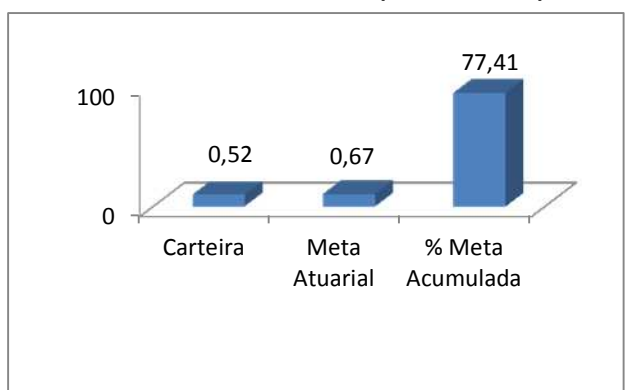
Histórico de Rentabilidade

	No Ano	No Mês
Carteira	0,52	-0,06
Meta Atuarial	0,67	0,65
% Meta Acumulada	77,41	-9,77

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\$ 28/02/2020	% Carteira do RPPS	PL DO FUNDO	% NO PL DO FUNDO	Conversão de Cotas para Resgate
RENTA FIXA E REFERENCIADO EM DI														
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,0641	0,29	CDI	99,15	61,32	0,68	5,57	15.088.785,78	4,26	4.277.867.607,58	0,35	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LONGO PRAZO	0,0329	0,27	CDI	92,91	57,46	0,65	5,33	10.870.603,64	3,07	5.421.482.050,58	0,20	D+0
Sub-total Art. 7º, Inciso IV "a" - FI Renda Fixa - Limite para alocação dos recursos: 40%										25.959.389,42	7,32			
RENTA FIXA														
CEF	CEF	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	1,8673	0,62	IPCA	209,37	90,74	1,44	14,23	61.724.806,71	17,41	10.626.779.468,55	0,58	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	4,9476	0,44	IMA B	148,93	64,54	0,69	17,63	57.946.047,99	16,34	6.609.422.706,56	0,88	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	1,7541	0,63	IMA B5	213,61	92,57	1,18	11,87	26.968.678,29	7,61	9.698.235.388,71	0,28	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	7,6747	0,29	IMA B5+	98,88	42,85	0,25	21,46	6.594.876,81	1,86	2.293.876.669,47	0,29	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF	0,1848	0,36	IRF M1	123,24	53,41	0,79	6,31	39.491.358,54	11,14	10.513.960.188,40	0,38	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	1,8687	0,63	IRF M	214,59	93,00	1,48	11,51	45.205.134,64	12,75	15.973.064.296,15	0,28	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	1,4142	0,60	IDKA IPCA2	204,11	88,46	1,06	10,35	31.159.082,54	8,79	8.419.154.798,69	0,37	D+0
CEF	CEF	FI BRASIL 2024 V TP RF	0,7977	0,70	IMA B5	237,53	102,94	1,50	15,87	9.024.036,00	2,58	173.777.403,98	5,19	D+0
BB DTVM	BBDTVM	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	2,208	0,46	IMA	154,70	67,04	0,94	11,46	20.039.580,02	5,65	10.908.803.618,87	0,18	D+0
Sub-total Art. 7º, Inciso I, "b" - FI 100% Títulos TN - Limite para alocação dos recursos: 100%										298.153.601,54	84,08			
RENTA VARIÁVEL - AÇÕES														
CEF	CEF	CAIXA FIC AÇÕES MILTIGESTOR (25/06/2019)	30,315	-8,78	IBOVESPA	-2979,71	-1291,35	-5,89	-	2.467.812,61	0,70	833.715.081,43	0,30	D+23
VINCI EQUITIES	CEF	FIC AÇÕES VALOR DIVIDENDOS RPPS	31,1359	-6,37	IDIV	-2161,52	-936,76	-4,94	19,87	3.988.054,99	1,12	909.648.393,83	0,44	D+30
CEF	CEF	CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	37,8271	-8,60	SMLL	-2918,05	-1264,63	-8,14	32,4219	1.798.340,99	0,51	1.542.999.030,98	0,12	D+1
CEF	CEF	CAIXA FI ACOES CONSTRUÇÃO CIVIL	33,8289	-10,66	IMOB11	-3616,08	-1567,15	-7,40	48,9072	1.791.739,51	0,51	974.243.337,57	0,18	D+1
CEF	CEF	CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	33,8289	-10,05	ICON	-3409,67	-1477,69	-7,01	34,984	1.482.213,81	0,42	903.356.588,09	0,16	D+1
ITAÚ	ITAÚ	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	31,014	-9,79	IBOVESPA	-3322,02	-1439,71	-9,96	20,11	4.476.962,98	1,26	4.106.559.997,95	0,11	D+21
ITAÚ	ITAÚ	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30	29,3258	-6,85	IBOVESPA	-2324,40	-1007,35	-5,66	19,62	915.338,54	0,26	1.592.946.431,21	0,06	D+21
BAHIA RV	BEM DTVM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	30,8557	-7,29	IBOVESPA	-2473,70	-1072,06	-7,83	13,79	4.893.703,37	1,38	1.139.056.064,38	0,43	D+30
Sub-total Art. 8º, Inciso II, "a" - Ações - Limite para alocação dos recursos: 20%										21.814.166,80	6,15			
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO														
CEF	CEF	FIC CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT (13/08/2018)	0,1839	0,27	IBOVESPA	90,53	39,24	0,58	7,33	3.487.763,73	0,98	501.837.357,44	0,69	D+0
CEF	CEF	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	6,9924	-1,51	CDI	-512,15	-221,96	-0,84	12,95	4.590.291,64	1,29	6.152.155.591,60	0,07	D+1
Sub-total Art. 8º, Inciso III - Multimercado - Limite para alocação dos recursos: 10%										8.078.055,37	2,28			
INVESTIMENTO NO EXTERIOR														
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	28,3574	-5,69	AÇÕES	-1930,78	-836,76	0,46	26,84	582.664,82	0,16	866.229.995,42	0,07	D+1
Sub-total Art. 9º, Inciso III - Ações BDR Nível I - Limite para alocação dos recursos: 10%										582.664,82	0,16			
TOTAL										354.587.877,95	100,00			

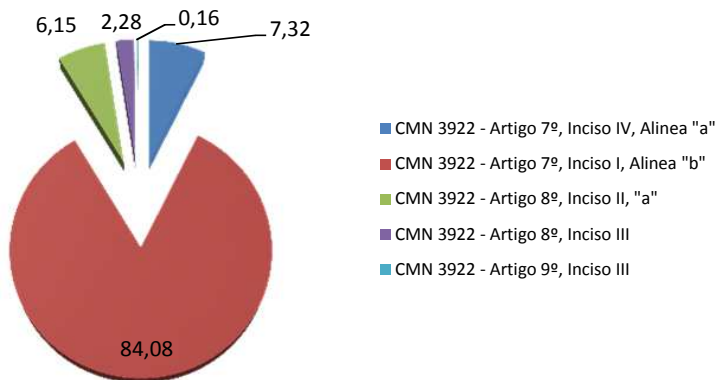
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Índice de comparação : INPC + 6%

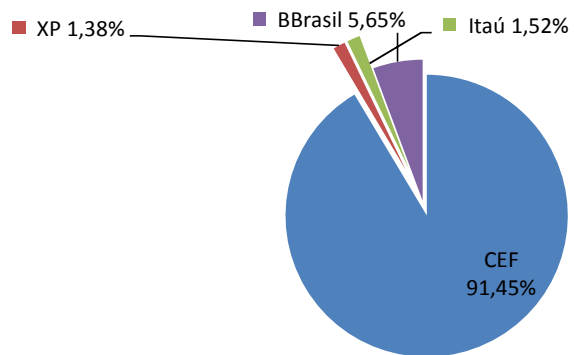
ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA							
ARTIGO	TIPO DE ATIVO	VALOR (R\$)	% CARTEIRA	POLÍTICA DE INVESTIMENTO	LIMITE PL DO FUNDO	ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE RES. 3922/2010
RENDA FIXA							
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	FI Renda Fixa	25.959.389,42	7,32	40%	15%	10%	40%
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	FI 100% Títulos TN	298.153.601,54	84,08	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		324.112.990,96	91,41				
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	21.814.166,80	6,15	20%	15%	8%	20%
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	Multimercado	8.078.055,37	2,28	10%	5%	5%	10%
Total Renda Variável		29.892.222,17	8,43				
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	582.664,82	0,16	10%	15%	0,50%	10%
Total Investimentos no Exterior		582.664,82	0,16				
TOTAL		354.587.877,95					
GANHOS FINANCEIROS							
ESTRATÉGIA	GANHO BRUTO NO MÊS (R\$)	GANHO BRUTO NO ANO R\$					
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	78.952,93	187.067,52					
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	1.517.922,48	3.137.801,85					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"	-2.012.511,35	-1.986.337,11					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	-61.065,42	-17.338,79					
CMN 3922 - Artigo 9º, Inciso III	-35.121,81	2.685,61					
TOTAL		-511.823,17	1.323.879,08				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

ALOCÇÃO POR ESTRATÉGIA

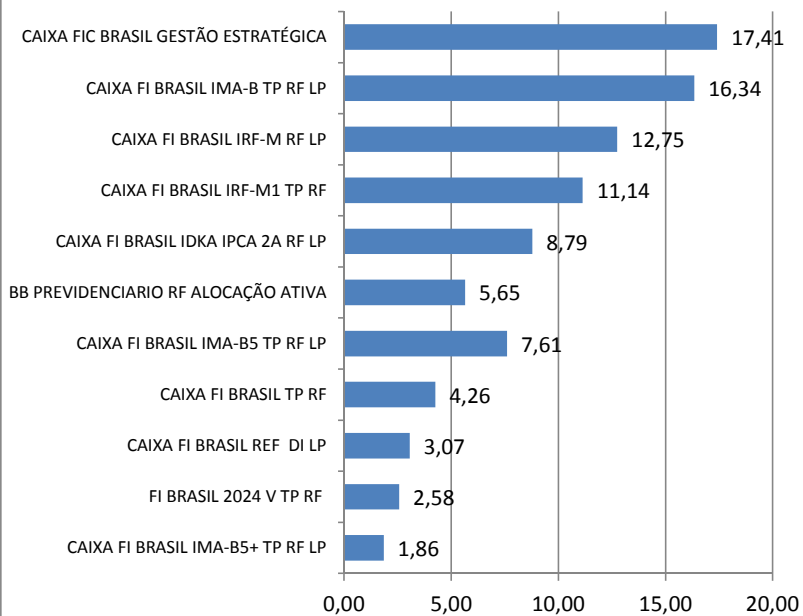


ALOCÇÃO POR INSTITUIÇÃO

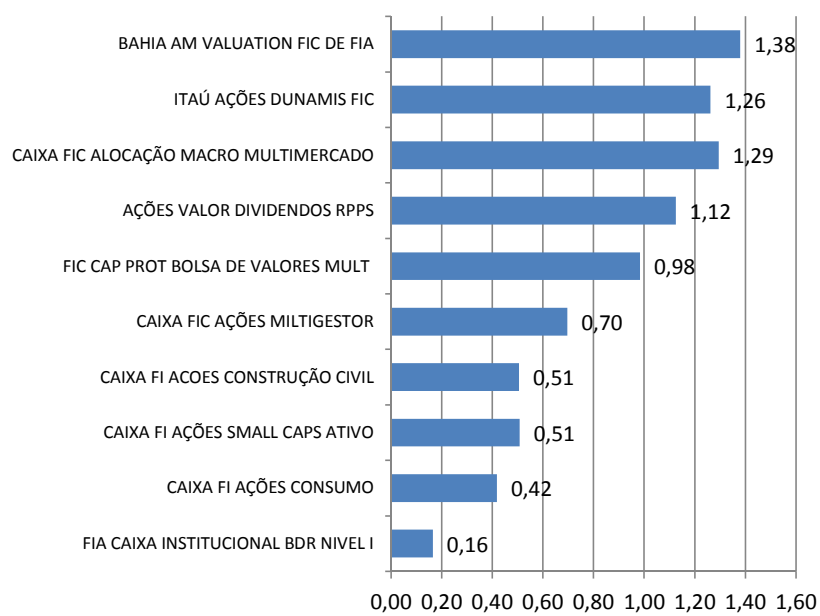


ALOCÇÃO POR ATIVOS

RENDA FIXA

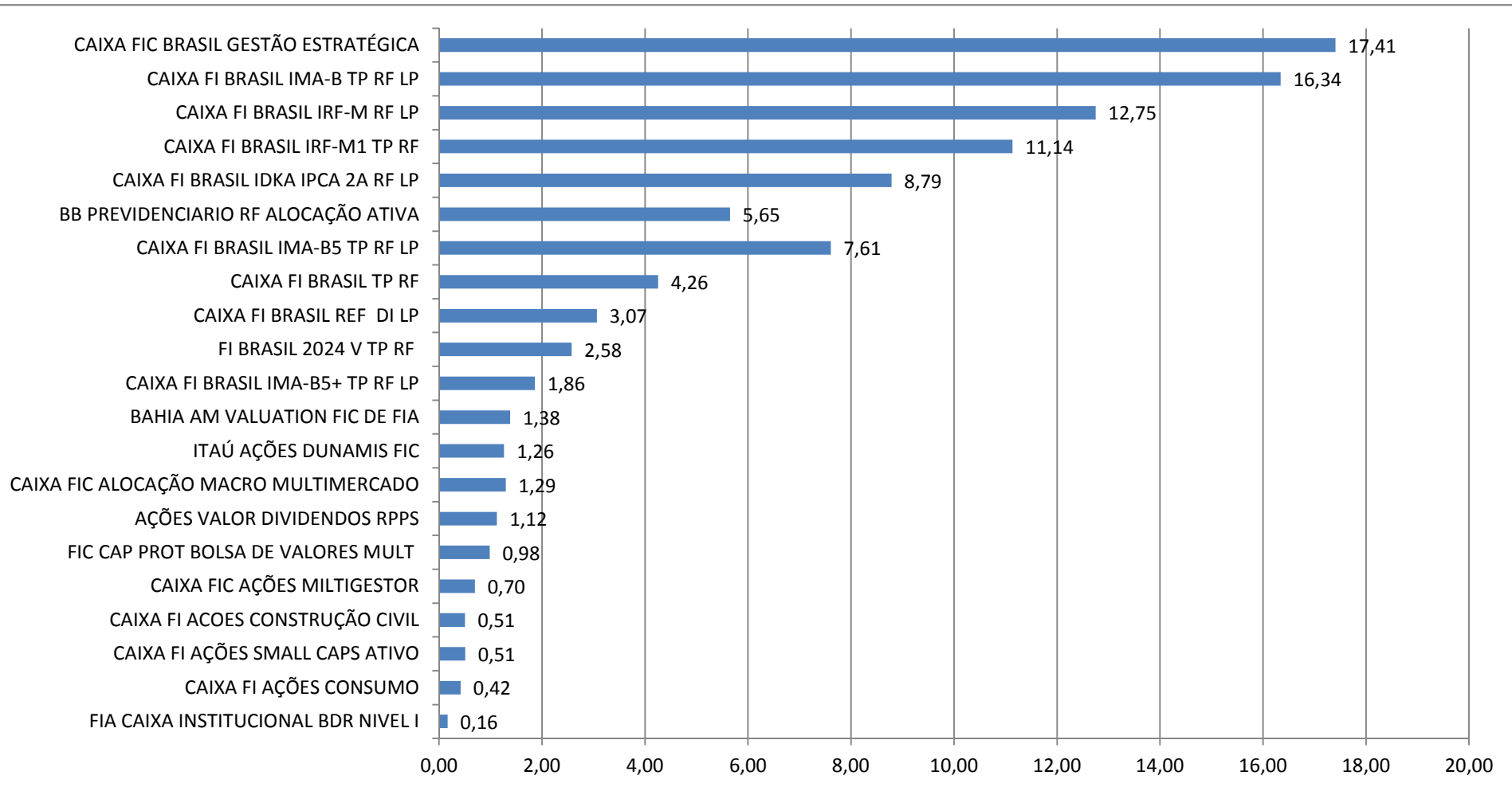


RENDA VÁRIAVEL



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

ALOCÇÃO 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											
INPC+5,87%	0,67	0,65											
p.p. Meta	-0,09	-0,71											
% da Meta no Mês	86,94	-9,77											

RENTABILIDADE MENSAL - 12 ÚLTIMOS MESES

