



# MUNICÍPIO DE TOLEDO

## Estado do Paraná

### Coordenação de Previdência – TOLEDOPREV

#### Relatório da Carteira de Investimentos - 2020

**Recursos Previdenciários**

**MARÇO**

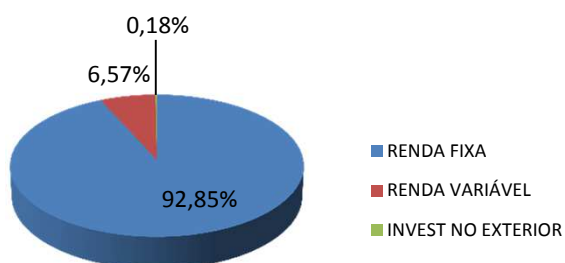
Os recursos Previdenciários são aplicados respeitando os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação e transparência.

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.

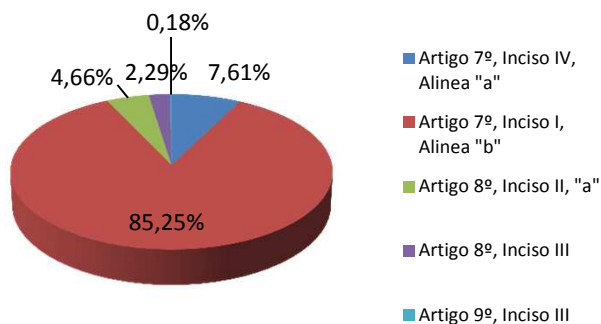
Neste mês a carteira de investimentos está distribuída da seguinte forma:

#### Distribuição dos Recursos

**POR SEGMENTO**



**POR ESTRATÉGIA**



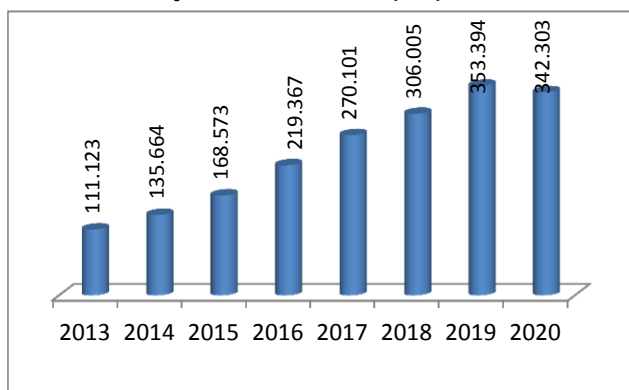
#### Total da Carteira de Investimentos

R\$ 342.239.880,34

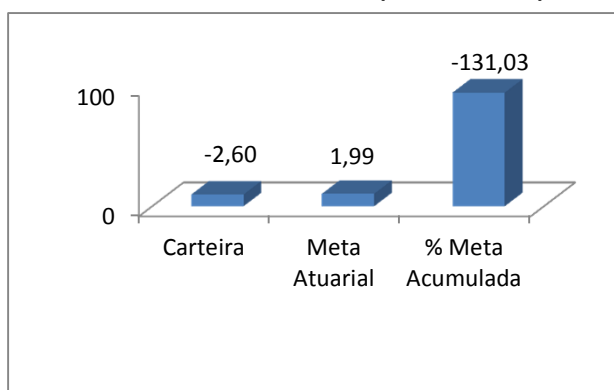
#### Histórico de Rentabilidade

	No Ano	No Mês
Carteira	-2,60	-3,10
Meta Atuarial	1,99	0,66
% Meta Acumulada	-131,03	-471,85

#### 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\$ 31/03/2020	% 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	0,4652	0,35	CDI	104,73	53,98	1,04	5,47	15.142.270,74	4,42	4.026.737.305,82	0,38	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LONGO PRAZO	0,2329	0,14	CDI	42,02	21,66	0,79	4,99	10.886.065,89	3,18	5.503.080.783,31	0,20	D+0
<b>Sub-total Art. 7º, Inciso IV "a" - FI Renda Fixa - Limite para alocação dos recursos: 40%</b>										26.028.336,63	7,61			
<b>RENDA FIXA</b>														
CEF	CEF	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	15,8064	-0,13	IPCA	-38,59	-19,89	1,31	13,46	61.644.147,69	18,01	11.020.077.699,37	0,56	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	38,3832	-7,10	IMA B	-2098,73	-1081,81	-6,46	8,66	55.377.926,40	16,18	5.890.819.394,91	0,94	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	14,0862	-1,80	IMA B5	-531,06	-273,74	-0,64	9,03	26.484.017,46	7,74	9.363.308.744,85	0,28	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	52,3195	-10,91	IMA B5+	-3223,58	-1661,63	-10,68	7,75	5.875.467,39	1,72	1.938.373.241,51	0,30	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF	1,2668	0,59	IRF M1	173,70	89,54	1,38	6,46	36.642.163,66	10,71	10.517.651.272,61	0,35	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	15,817	-0,11	IRF M	-33,45	-17,24	1,36	10,78	46.646.784,37	13,63	15.907.113.181,36	0,29	D+0
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	11,3033	-1,45	IDKA IPCA2	-429,58	-221,43	-0,41	8,03	30.706.125,63	8,97	8.199.299.170,30	0,37	D+0
CEF	CEF	FI BRASIL 2024 V TP RF	24,3538	-2,69	IMA B5	-794,92	-409,75	-1,17	11,87	8.780.868,00	2,58	169.094.624,07	5,19	D+0
BB DTVM	BBDTVM	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	16,5729	-2,10	IMA	-620,92	-320,06	-1,18	8,55	19.618.498,25	5,73	10.536.452.770,12	0,19	D+0
<b>Sub-total Art. 7º, Inciso I, "b" - FI 100% Títulos TN - Limite para alocação dos recursos: 100%</b>										291.775.998,85	85,25			
<b>RENDA VARIÁVEL - AÇÕES</b>														
CEF	CEF	CAIXA FIC AÇÕES MLTIGESTOR (25/06/2019)	124,4909	-29,43	IBOVESPA	-8697,96	-4483,46	-33,59	-	2.018.381,20	0,59	590.532.828,22	0,34	D+23
VINCI EQUITIES	CEF	FIC AÇÕES VALOR DIVIDENDOS RPPS	103,9889	-27,40	IDIV	-8096,93	-4173,65	-30,98	-12,36	2.895.294,43	0,85	668.635.770,53	0,43	D+30
CEF	CEF	CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	129,1071	-35,06	SMLL	-10359,93	-5340,14	-40,34	-13,79	1.167.878,22	0,34	894.019.781,17	0,13	D+1
CEF	CEF	CAIXA FI ACOES CONSTRUÇÃO CIVIL	151,2537	-41,14	IMOB11	-12156,26	-6266,08	-45,49	-9,18	1.054.674,87	0,31	416.036.779,10	0,25	D+1
CEF	CEF	CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	125,2831	-31,23	ICON	-9227,72	-4756,53	-36,04	-6,29	1.019.368,84	0,30	544.828.665,14	0,19	D+1
ITAÚ	ITAÚ	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	115,6138	-32,44	IBOVESPA	-9586,29	-4941,36	-39,18	-17,47	3.024.428,36	0,88	2.717.755.336,40	0,11	D+21
ITAÚ	ITAÚ	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30	113,0619	-31,06	IBOVESPA	-9178,49	-4731,15	-34,96	-16,95	1.389.867,37	0,41	1.171.296.538,03	0,12	D+21
BAHIA RV	BEM DTVM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	122,3692	-30,69	IBOVESPA	-9069,15	-4674,79	-36,11	-21,54	3.392.068,94	0,99	777.057.191,68	0,44	D+30
<b>Sub-total Art. 8º, Inciso II, "a" - Ações - Limite para alocação dos recursos: 20%</b>										15.961.962,23	4,66			
<b>RENDA VARIÁVEL - MULTIMERCADO</b>														
CEF	CEF	FIC CAP PROT BOLSA DE VALORES MULT (13/08/2018)	1,7970	0,57	IBOVESPA	169,09	87,16	1,16	7,54	3.507.724,14	1,02	504.709.364,08	0,69	D+0
CEF	CEF	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	20,8756	-5,31	CDI	-1569,68	-809,11	-6,10	6,44	4.346.463,23	1,27	4.401.772.920,54	0,10	D+1
<b>Sub-total Art. 8º, Inciso III - Multimercado - Limite para alocação dos recursos: 10%</b>										7.854.187,37	2,29			
<b>INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>														
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	60,6645	6,30	AÇÕES	1861,70	959,63	6,80	27,06	619.395,26	0,18	876.229.505,18	0,07	D+1
<b>Sub-total Art. 9º, Inciso III - Ações BDR Nível I - Limite para alocação dos recursos: 10%</b>										619.395,26	0,18			
<b>TOTAL</b>										<b>342.239.880,34</b>	<b>100,00</b>			

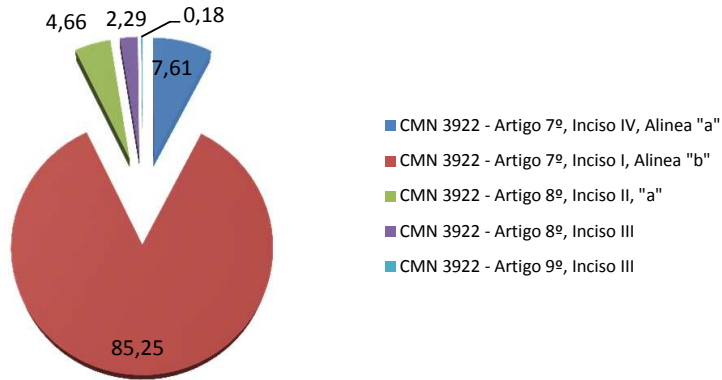
# EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Índice de comparação : INPC + 6%

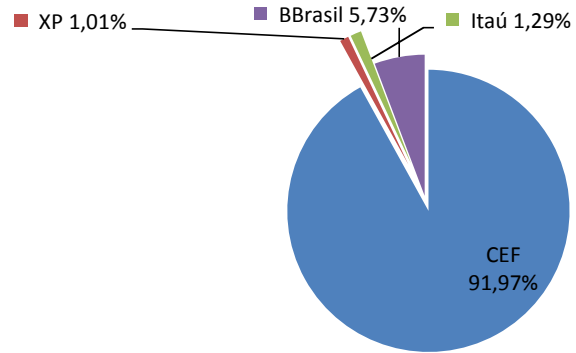
ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA							
ARTIGO	TIPO DE ATIVO	VALOR (R\$)	% CARTEIRA	POLÍTICA DE INVESTIMENTO	LIMITE PL DO FUNDO	ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE RES. 3922/2010
<b>RENDA FIXA</b>							
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	FI Renda Fixa	26.028.336,63	7,61	40%	15%	10%	40%
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	FI 100% Títulos TN	291.775.998,85	85,25	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%
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>317.804.335,48</b>	<b>92,86</b>				
<b>RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>							
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	15.961.962,23	4,66	20%	15%	8%	20%
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	Multimercado	7.854.187,37	2,29	10%	5%	5%	10%
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>23.816.149,60</b>	<b>6,96</b>				
<b>INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>							
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	619.395,26	0,18	10%	15%	0,50%	10%
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>619.395,26</b>	<b>0,18</b>				
	<b>TOTAL</b>	<b>342.239.880,34</b>	<b>100,00</b>				
<b>GANHOS FINANCEIROS</b>							
ESTRATÉGIA	GANHO BRUTO NO MÊS (R\$)	GANHO BRUTO NO ANO R\$					
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	68.947,21	256.014,73					
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	-6.472.778,37	-3.334.976,52					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"	-7.211.821,83	-9.198.158,94					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	-223.868,00	-241.206,79					
CMN 3922 - Artigo 9º, Inciso III	36.730,44	39.416,05					
<b>TOTAL</b>	<b>-13.802.790,55</b>	<b>-12.478.911,47</b>					

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**ALOCÇÃO POR ESTRATÉGIA**

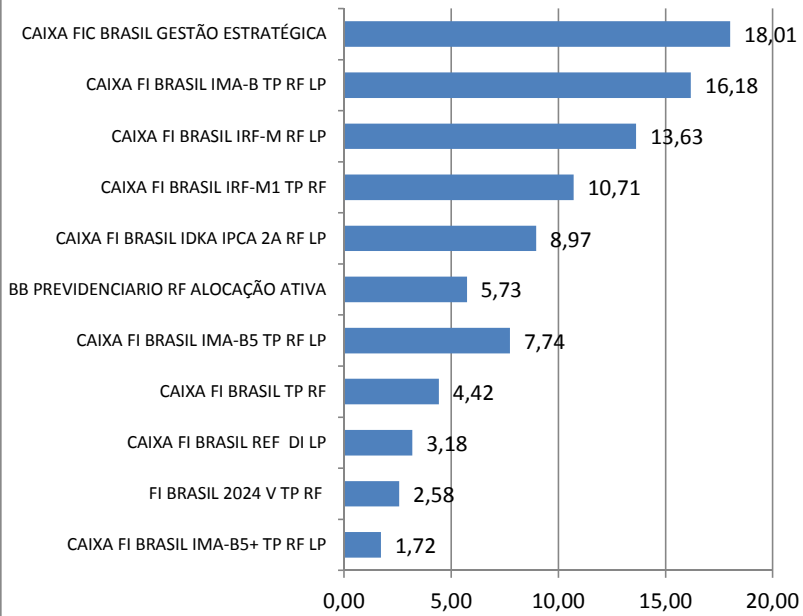


**ALOCÇÃO POR INSTITUIÇÃO**

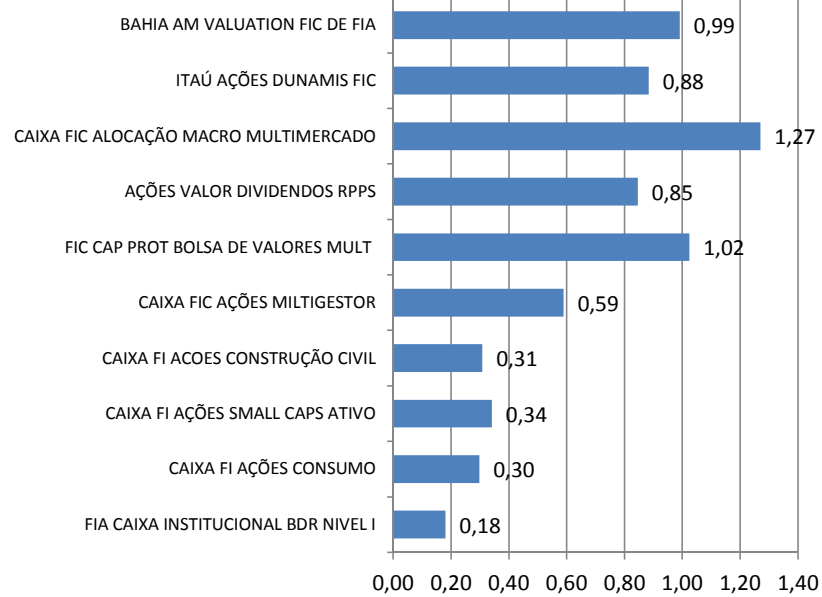


**ALOCÇÃO POR ATIVOS**

**RENDA FIXA**

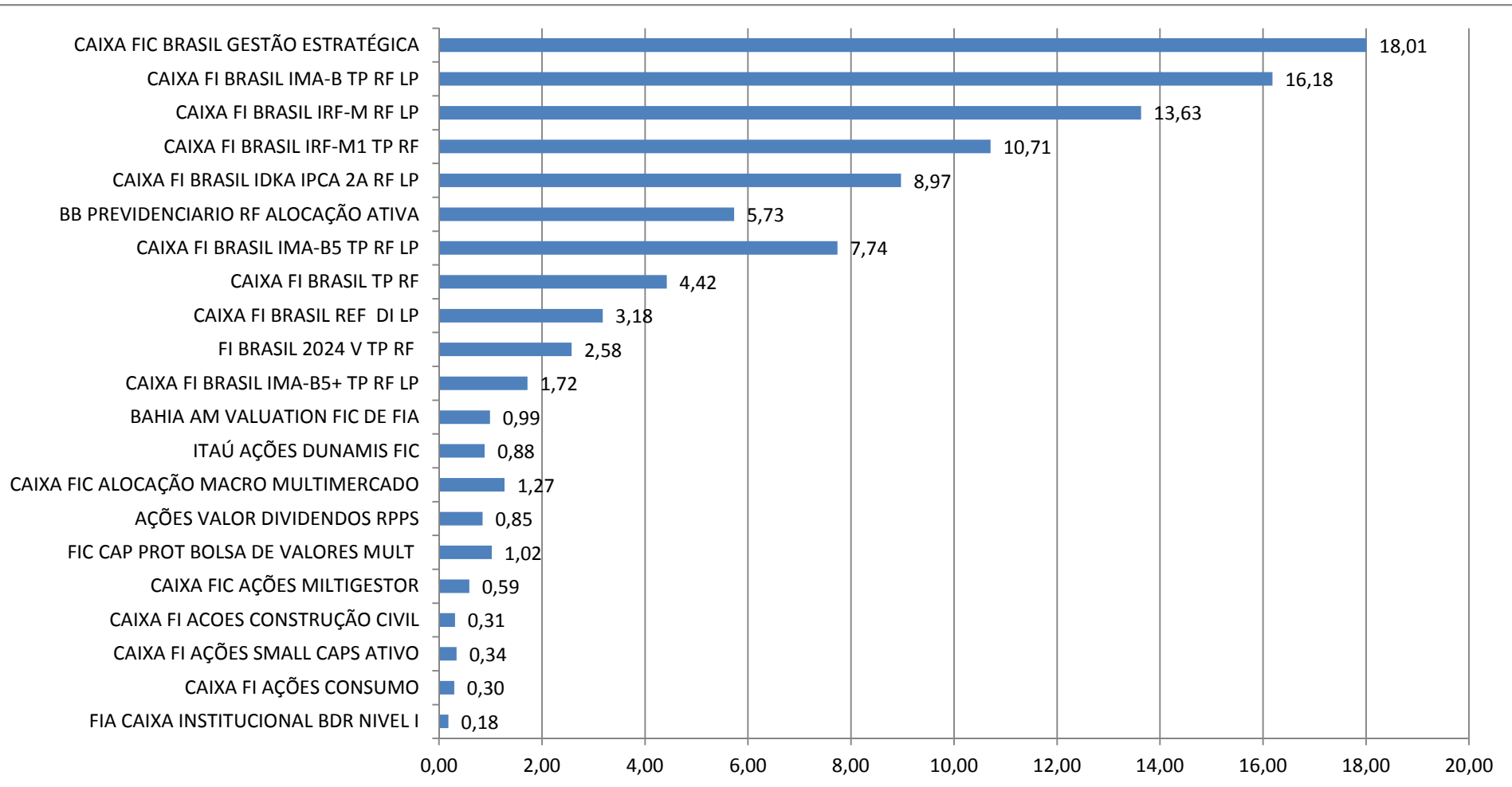


**RENDA VÁRIAVEL**



## 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										
INPC+5,87%	0,67	0,65	0,66										
p.p. Meta	-0,09	-0,71	-3,76										
% da Meta no Mês	86,94	-9,77	-471,85										

### RENTABILIDADE MENSAL - 12 ÚLTIMOS MESES

