



MUNICÍPIO DE TOLEDO

Estado do Paraná

Coordenação de Previdência – TOLEDOPREV

Relatório da Carteira de Investimentos - 2020

Recursos Previdenciários

SETEMBRO

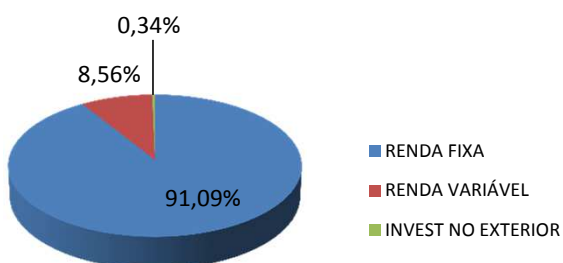
Os recursos Previdenciários são aplicados respeitando os princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação e transparência.

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.

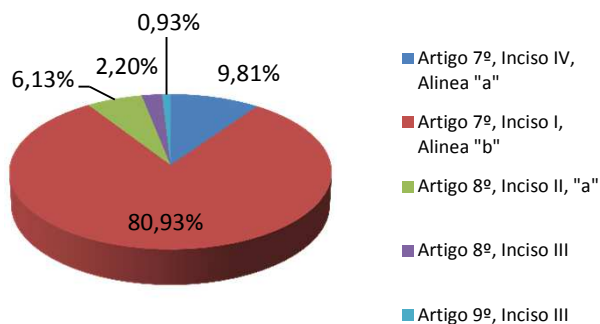
Neste mês a carteira de investimentos está distribuída da seguinte forma:

Distribuição dos Recursos

POR SEGMENTO



POR ESTRATÉGIA



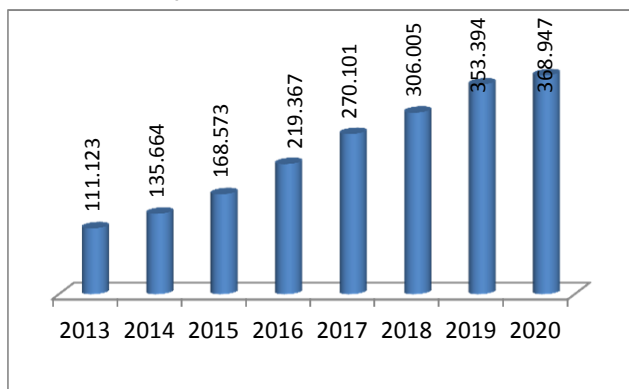
Total da Carteira de Investimentos

R\$ 368.947.005,19

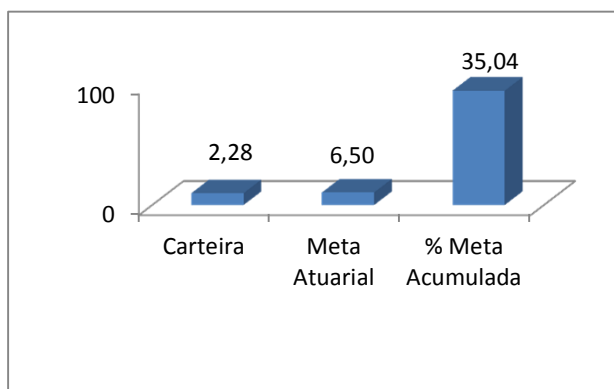
Histórico de Rentabilidade

	No Ano	No Mês
Carteira	2,28	-0,74
Meta Atuarial	6,50	1,35
% Meta Acumulada	35,04	-54,83

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	CNPJ	ATIVO	VOL a.a.	RETORNO MÊS %	ÍNDICE	% CDI	% INPC+5,87	ACUM. ANO%	ÚLT. 12M%	VALOR R\$ 30/09/2020	% Carteira do RPPS	PL DO FUNDO	% NO PL DO FUNDO	Conversão de Cotas para Resgate
RENTA FIXA E REFERENCIADO EM DI															
CEF	CEF	05.164.356/0001-84	CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,34	-0,18	CDI	-72,72	-80,26	1,98	3,21	15.284.037,87	4,14	5.784.897.306,60	0,26	D+0
CEF	CEF	03.737.206/0001-97	CAIXA FI BRASIL REF DI LONGO PRAZO	0,33	0,00	CDI	-1,04	-1,15	1,77	2,90	10.865.679,53	2,95	4.760.770.417,77	0,23	D+0
CEF	CEF	35.536.532/0001-22	CAIXA FIC BRASIL RF ATIVA LP	4,84	-0,59	IPCA			2,01		10.030.296,64	2,72	547.986.362,75	1,83	
Sub-total Art. 7º, Inciso IV "a" - FI Renda Fixa - Limite para alocação dos recursos: 40%											36.180.014,04	9,81			
RENTA FIXA															
CEF	CEF	23.215.097/0001-55	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	5,95	-0,50	IPCA	-201,28	-222,16	4,53	6,41	65.652.659,06	17,79	13.535.810.678,86	0,49	D+0
CEF	CEF	10.740.658/0001-93	CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	12,76	-1,53	IMA B	-613,32	-676,95	1,00	1,68	58.613.629,17	15,89	5.834.527.804,73	1,00	D+0
CEF	CEF	11.060.913/0001-10	CAIXA FI BRASIL IMA-B5 TP RF LP	5	-0,16	IMA B5	-63,72	-70,33	4,29	6,91	27.797.568,56	7,53	17.747.142.317,32	0,16	D+0
CEF	CEF	10.577.503.0001-88	CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	19,71	-2,64	IMA B5+	-1057,20	-1166,89	-4,82	-2,10	6.261.160,38	1,70	1.755.979.575,38	0,36	D+0
CEF	CEF	10.740.670/0001-06	CAIXA FI BRASIL IRF-M1 TP RF	0,55	0,13	IRF M1	53,32	58,85	2,97	4,34	39.321.890,68	10,66	10.130.144.603,43	0,39	D+0
CEF	CEF	14.508.605/0001-00	CAIXA FI BRASIL IRF-M RF LP	5,99	-0,61	IRF M	-245,08	-270,51	4,41	6,31	48.052.039,76	13,02	11.234.342.142,99	0,43	D+0
CEF	CEF	14.386.926/0001-71	CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	4,08	0,04	IDKA IPCA2	14,68	16,20	4,84	7,35	23.566.393,65	6,39	9.208.011.978,57	0,26	D+0
CEF	CEF	19.768.682/0001-05	FI BRASIL 2024 V TP RF	9,19	-0,77	IMA B5	-308,00	-339,96	-0,11	2,77	9.092.700,00	2,58	175.099.648,53	5,19	D+0
BB DTVM	BBDTVM	25.078.994/0001-90	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	6,22	-0,75	IMA	-301,00	-332,23	1,86	3,70	20.220.685,98	5,48	10.452.752.168,75	0,19	D+0
Sub-total Art. 7º, Inciso I, "b" - FI 100% Títulos TN - Limite para alocação dos recursos: 100%											298.578.727,24	80,93			
RENTA VARIÁVEL - AÇÕES															
CEF	CEF	30.068.224/0001-04	CAIXA FIC AÇÕES MULTIGESTOR (25/06/2019)	43,38	-5,38	IBOVESPA	-2151,08	-2374,26	-14,86	-2,46	3.721.702,08	1,01	829.854.206,90	0,45	D+23
VINCI EQUITIES	CEF	15.154.441/0001-15	FIC AÇÕES VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,43	-4,93	IDIV	-1972,00	-2176,60	-17,58	-6,98	3.457.468,69	0,94	783.577.685,83	0,44	D+30
CEF	CEF	15.154.220/0001-47	CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	46,46	-5,93	SMLL	-2370,72	-2616,69	-20,37	-4,18	1.558.858,12	0,42	1.156.431.775,09	0,13	D+1
CEF	CEF	10.551.375/0001-01	CAIXA FI ACOES CONSTRUÇÃO CIVIL	58,99	-8,11	IMOB11	-3242,16	-3578,54	-36,98	-21,21	1.219.455,40	0,33	472.017.380,08	0,26	D+1
CEF	CEF	10.577.512/0001-79	CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	44,58	-4,06	ICON	-1622,88	-1791,26	-10,05	-1,18	1.433.606,73	0,39	718.937.900,79	0,20	D+1
ITAÚ	ITAÚ	24.571.992/0001-75	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	42,71	-4,96	IBOVESPA	-1984,00	-2189,85	-20,69	-10,53	3.943.640,61	1,07	3.159.975.144,49	0,12	D+21
ITAÚ	ITAÚ	16.718.302/0001-30	ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30	40,85	-4,00	IBOVESPA	-1600,00	-1766,00	-11,63	-0,77	2.819.361,92	0,76	1.846.376.502,59	0,15	D+21
BAHIA RV	BEM DTVM	09.635.172/0001-06	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	43,49	-4,45	IBOVESPA	-1780,00	-1964,68	-15,69	-5,14	4.476.265,94	1,21	844.202.491,55	0,53	D+30
Sub-total Art. 8º, Inciso II, "a" - Ações - Limite para alocação dos recursos: 20%											22.630.359,49	6,13			
RENTA 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)	1,76	-0,45	IBOVESPA	-178,72	-197,26	1,41	2,97	3.516.560,93	0,95	505.717.833,93	0,70	D+0
CEF	CEF	08.070.841/0001-87	CAIXA FIC ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO	7,73	-0,91	CDI	-363,76	-401,50	-0,69	3,05	4.597.112,49	1,25	5.019.584.079,54	0,09	D+1
Sub-total Art. 8º, Inciso III - Multimercado - Limite para alocação dos recursos: 10%											8.113.673,42	2,20			
INVESTIMENTO NO EXTERIOR															
CEF	CEF	17.502.937/0001-68	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	28,47	-1,99	AÇÕES	-796,00	-878,59	52,76	61,21	3.444.231,00	0,93	1.671.279.124,17	0,21	D+1
Sub-total Art. 9º, Inciso III - Ações BDR Nível I - Limite para alocação dos recursos: 10%											3.444.231,00	0,93			
TOTAL											368.947.005,19	100,00			

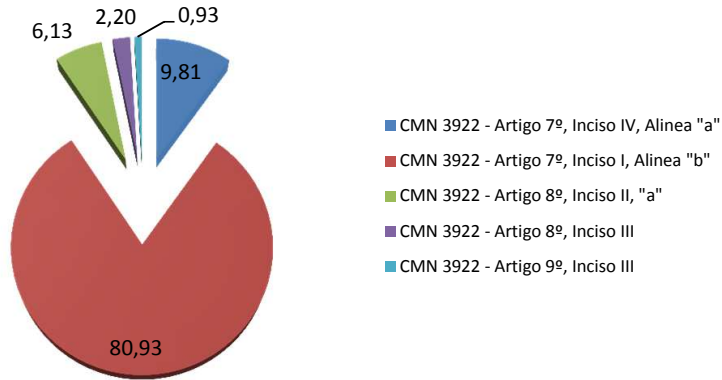
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Índice de comparação : INPC + 5,87%

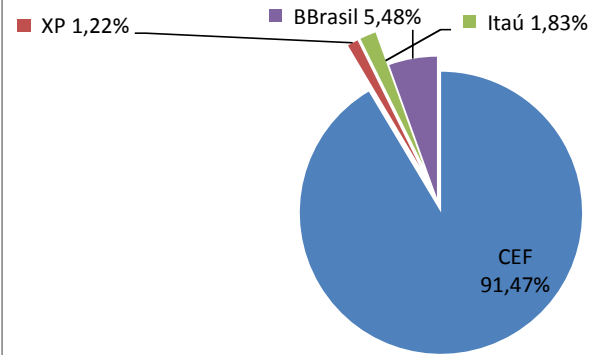
ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA							
ARTIGO	TIPO DE ATIVO	VALOR (R\$)	% CARTEIRA	POLÍTICA DE INVESTIMENTO	LIMITE PL DO FUNDO	ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE RES. 3922/2010
RENDA FIXA							
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	FI Renda Fixa	36.180.014,04	9,81	40%	15%	10%	40%
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	FI 100% Títulos TN	298.578.727,24	80,93	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		334.758.741,28	90,73				
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	22.630.359,49	6,13	20%	15%	8%	20%
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	Multimercado	8.113.673,42	2,20	10%	5%	5%	10%
Total Renda Variável		30.744.032,91	8,33				
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	3.444.231,00	0,93	10%	15%	0,50%	10%
Total Investimentos no Exterior		3.444.231,00	0,93				
TOTAL		368.947.005,19	100,00				
GANHOS FINANCEIROS							
ESTRATÉGIA	GANHO BRUTO NO MÊS (R\$)	GANHO BRUTO NO ANO R\$					
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"	-78.925,87	511.297,16					
CMN 3922 - Artigo 7º, Inciso I, Alinea "b"	-1.915.263,29	8.155.860,26					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso II, "a"	-1.189.680,30	-4.630.096,91					
CMN 3922 - Artigo 8º, Inciso III	-57.969,81	18.279,26					
CMN 3922 - Artigo 9º, Inciso III	-49.736,83	364.251,79					
TOTAL		-3.291.576,10	4.419.591,56				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

ALOCÇÃO POR ESTRATÉGIA

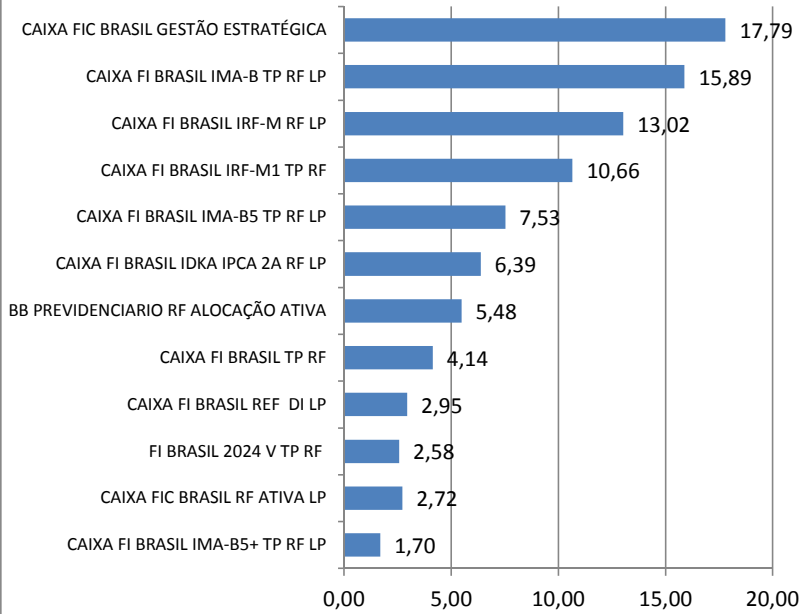


ALOCÇÃO POR INSTITUIÇÃO

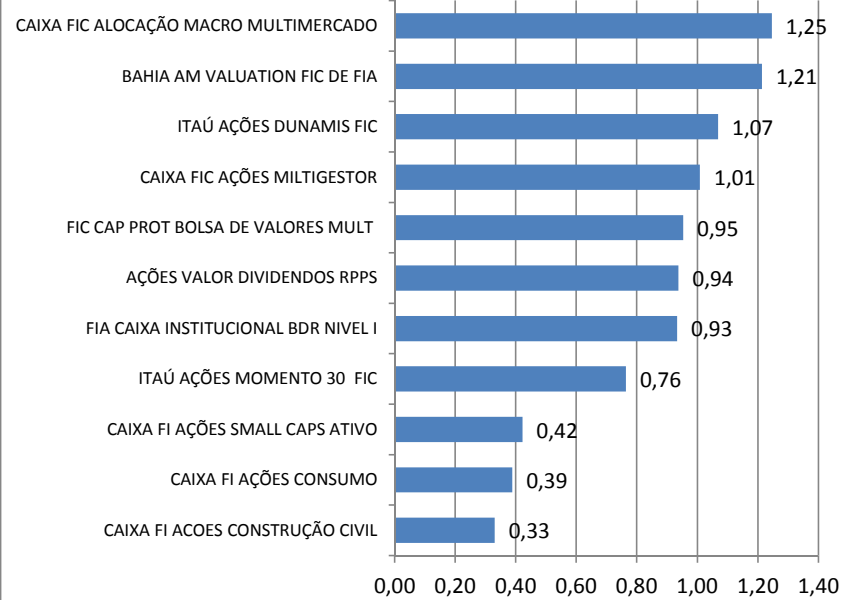


ALOCÇÃO POR ATIVOS

RENDA FIXA

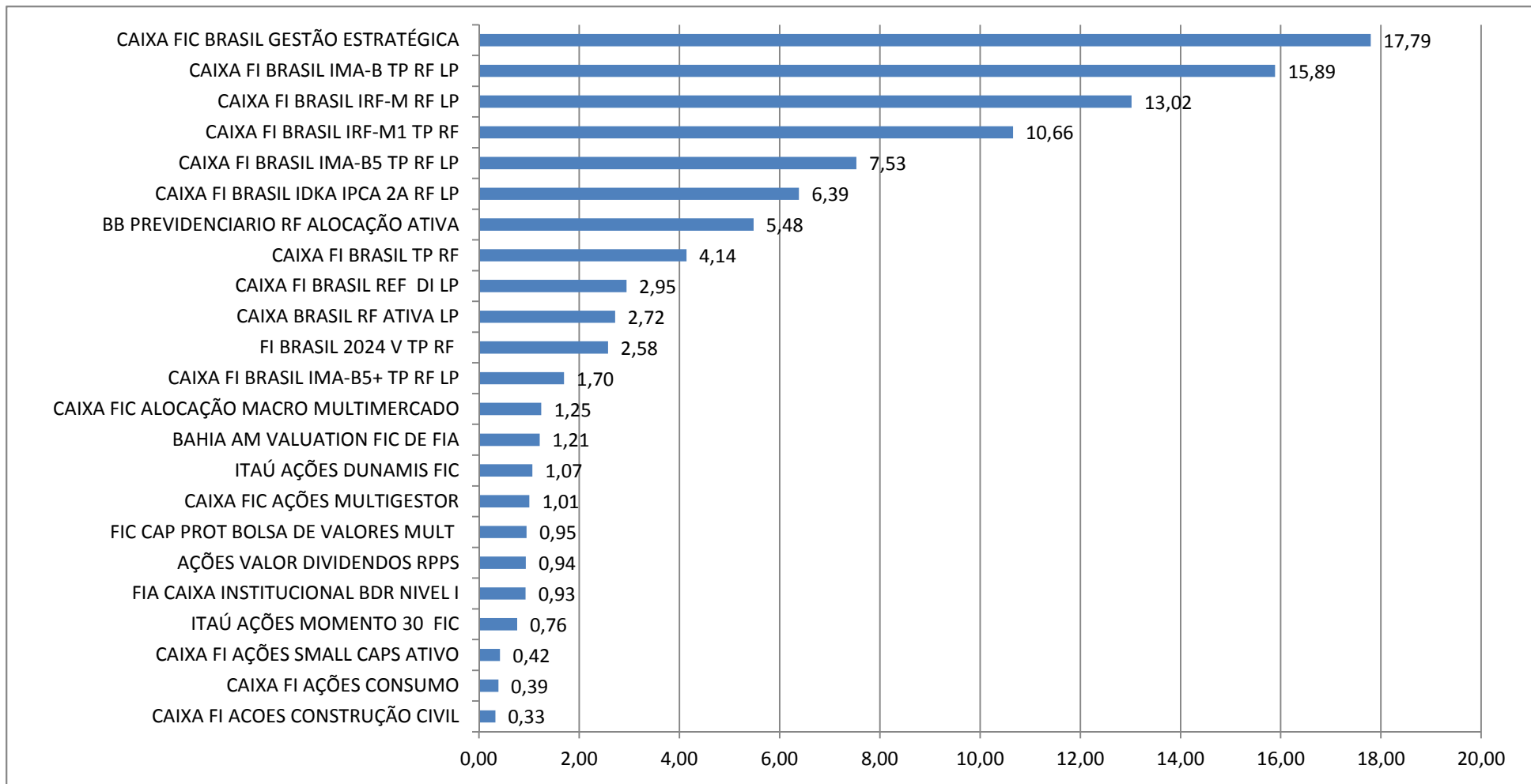


RENDA VÁRIAVEL



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

ALOCÇÃO POR ATIVOS



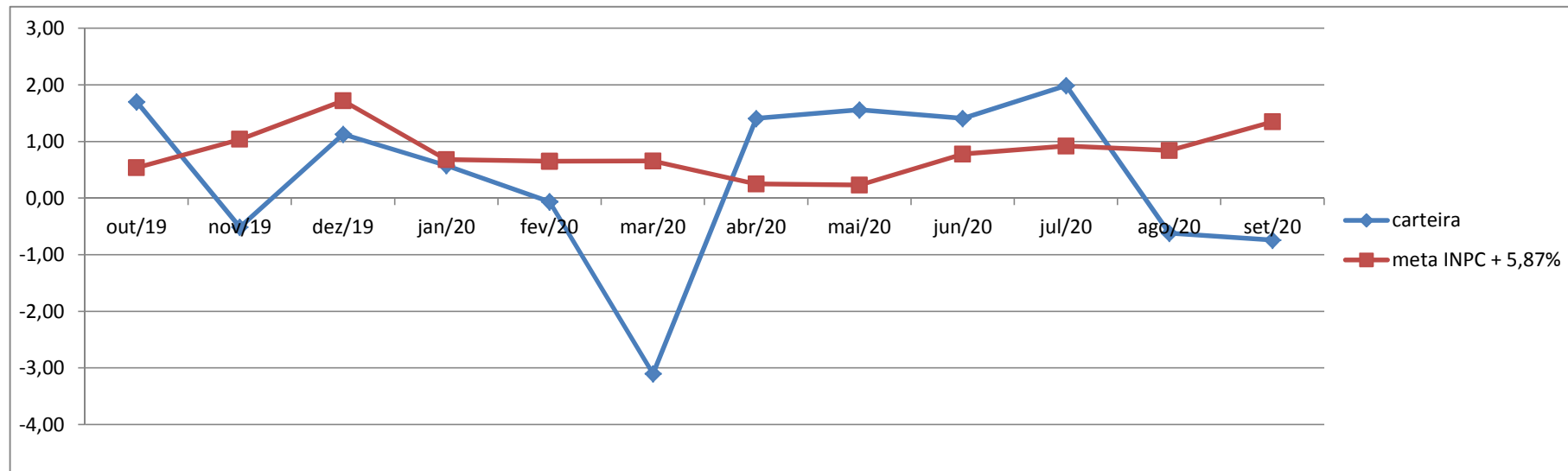
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	10,749
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	-0,74				
INPC+5,87%	0,67	0,65	0,66	0,25	0,23	0,78	0,92	0,84	1,35				
p.p. Meta	-0,09	-0,71	-3,76	1,16	1,33	0,63	1,07	-1,46	-2,09				
% da Meta no Mês	86,94	-9,77	-479,51	570,78	692,03	181,30	216,36	-74,02	-54,83				

RENTABILIDADE MENSIS - 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)

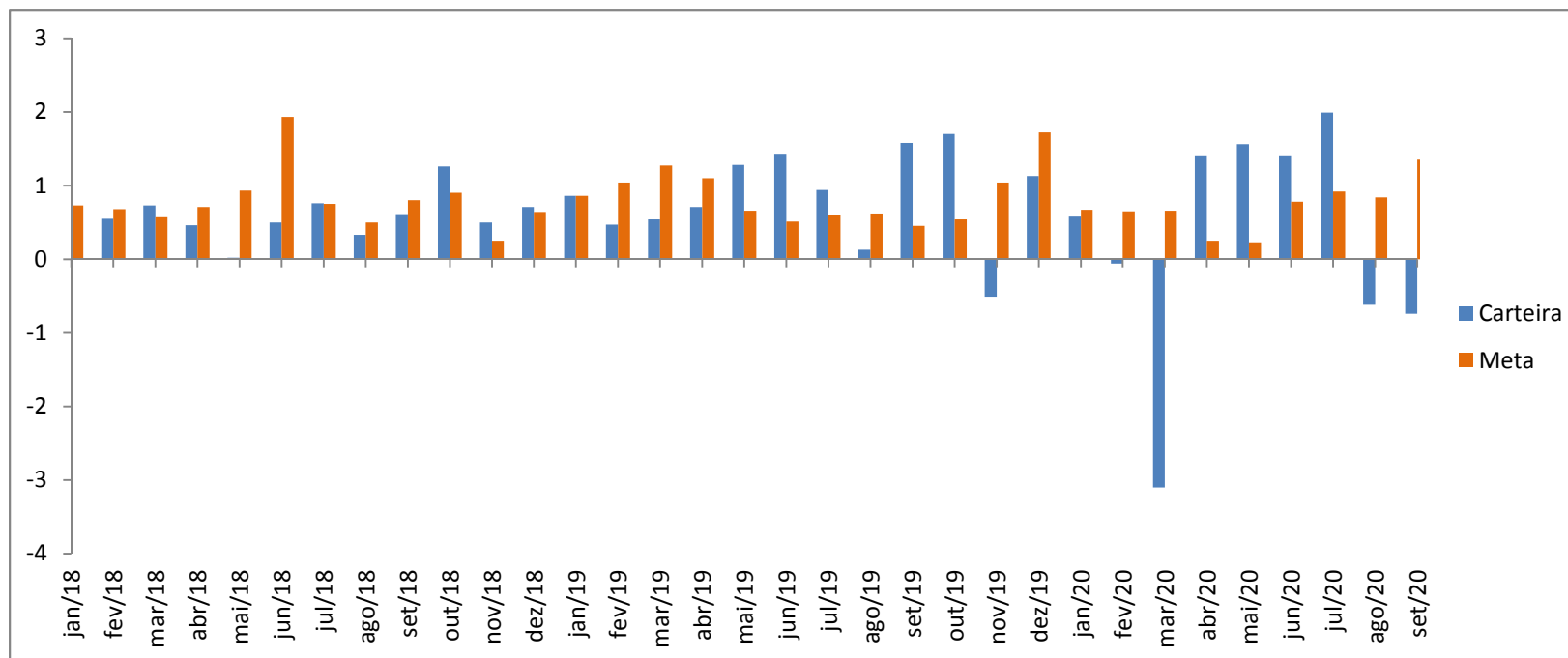
Análise de Risco/Retorno da Carteira

	Qtd.	%
Meses acima do Benchmark	15	45%
Meses abaixo do Benchmark	18	55%

	Rentab.	Mês
Maior Rentabilidade da Carteira	1,99%	jul/20
Menor Rentabilidade da Carteira	-3,10%	mar/20

Período	Rentabilidade			Vol. Anual
	Carteira	INPC + 5,87%	p.p. Indx.	
03 meses	0,63	3,11	-2,48	5,34
06 meses	5,01	4,37	0,64	4,13
12 meses	4,75	9,65	-4,90	5,10
24 meses	15,16	15,55	-0,39	3,77
36 meses				
Desde jan/18	19,82	26,15	-4,29	3,23

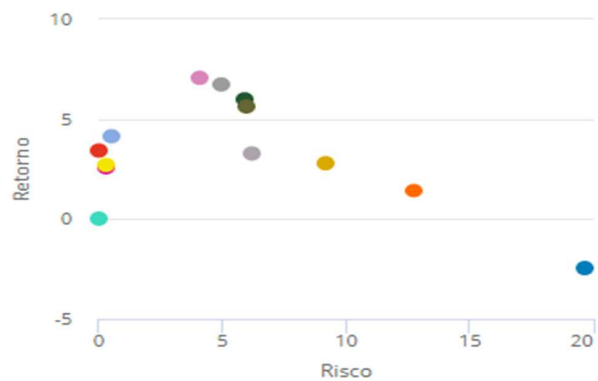
Retorno Mensal - Carteira vs Meta



Volatilidade Ativos de Renda Fixa

Fundo	12 meses	Desde o início
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	19,71%	12,53%
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,76%	7,96%
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,95%	4,26%
FIC FI CAIXA BRASIL RF ATIVA LP	-%	4,88%
FI CAIXA BRASIL RF REFERENCIADO DI LP	0,33%	0,20%
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,34%	0,29%
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,00%	3,05%
FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55%	0,49%
FI CAIXA BRASIL IRF M TITULOS PUBLICOS RF LP	5,99%	3,82%
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP	4,08%	2,75%
FI CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS RF	9,19%	8,24%
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22%	4,41%
CDI	0,07	0,4

Gráfico de Risco X Retorno



Volatilida Ativos de Renda Variável

Fundo	12 meses	Desde o início
FIC FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	43,38%	38,85%
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,43%	19,90%
FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO	46,46%	23,30%
FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	58,99%	30,62%
FIA CAIXA CONSUMO	44,58%	22,95%
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI	40,85%	21,68%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	42,71%	27,12%
BAHIA AM VALUATION FIC FIA	43,49%	22,88%
FIC FI CAIXA CAPITAL PROT BOLSA VALORES MULT	1,76%	1,83%
FIC FI CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP	7,73%	2,92%
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	28,47%	18,57%

Gráfico de Risco X Retorno

- CDI
- FIC FIA CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR
- FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS
- FIA CAIXA SMALL CAPS ATIVO
- FIA CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL
- FIA CAIXA CONSUMO
- ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 FIC FI
- ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI
- BAHIA AM VALUATION FIC FIA
- FIC FI CAIXA CAPITAL PROT BOLSA VALORES MULT
- FIC FI CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULT LP
- FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

