



Fundo Municipal de
Seguridade Social de Guaraci-SP

Rua Governador Franco, 522 - CEP 13.620-001
CNPJ 15.524.526/0001-27

RELATÓRIO DE GESTÃO DOS INVESTIMENTOS FMSS- GUARACI Setembro/2020

As informações utilizadas neste relatório de gestão de investimento são obtidas do sistema informatizado de Gestão dos Investimentos do RPPS.

Este Relatório visa a fornecer informações resumidas aos órgãos fiscalizadores, aos segurados e pensionistas do FMSS GUARACI e à população, em geral.

Este relatório contém, a composição atual da carteira do Instituto relatando a sua rentabilidade consolidada e detalhada por ativo, a comparação com a meta atuarial e seu enquadramento em relação à Resolução 3.922/2010 e alterações do Conselho Monetário Nacional.

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

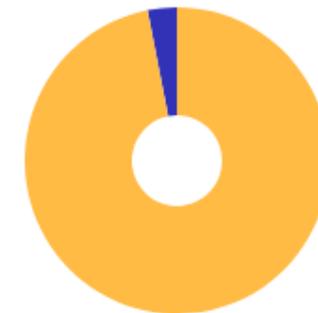
1 - CARTEIRA CONSOLIDADA DE INVESTIMENTOS - BASE (SETEMBRO / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.759.200,24	17,85%	13	3,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	4.809.125,88	18,04%	152	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.577.885,39	5,92%	1.361	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.855.487,58	6,96%	265	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.459.955,94	16,73%	127	0,96%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.038.950,09	11,40%	128	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.520.140,28	9,45%	677	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.295.783,92	4,86%	31	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	924.556,15	3,47%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	483.601,08	1,81%	26	0,71%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	104.918,52	0,39%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	826.181,20	3,10%	304	0,92%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			26.655.786,27				

2 - ENQUADRAMENTOS NA RESOLUÇÃO 3.922/2010 E POLÍTICA DE INVESTIMENTO

2.1 - (RENDA FIXA - BASE (SETEMBRO / 2020))

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	26.655.786,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	13.001.699,09	48,78%	15,00%	55,00%	100,00%	13.654.087,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	12.722.987,46	47,73%	10,00%	27,00%	40,00%	-2.060.672,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	104.918,52	0,39%	0,00%	3,00%	5,00%	1.227.870,79
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.332.789,31
Total Renda Fixa	100,00%	25.829.605,07	96,90%	25,00%	95,00%	250,00%	



RENDA FIXA 25.829.605,07

RENDA VARIÁVEL 826.181,20

2.2. RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR - BASE (SETEMBRO / 2020)

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	826.181,20	3,10%	2,00%	5,00%	20,00%	4.504.976,05
Total Renda Variável	30,00%	826.181,20	3,10%	2,00%	5,00%	20,00%	



7º I b 7º IV a 7º VII a 8º II a

3. ENQUADRAMENTOS NA RESOLUÇÃO 4.604 POR GESTORES - BASE (SETEMBRO / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	17.067.232,15	64,03	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.098.025,67	15,37	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.855.487,58	6,96	0,00
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	1.295.783,92	4,86	0,03
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	1.029.474,67	3,86	3,90
MULTINVEST CAPITAL	826.181,20	3,10	0,14
RJI CORRETORA DE VALORES	483.601,08	1,81	0,29

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

4. RETORNO DOS INVESTIMENTOS E BENCHMARK'S DE ATIVOS NO MÊS DE SETEMBRO/2020 - RENDA FIXA

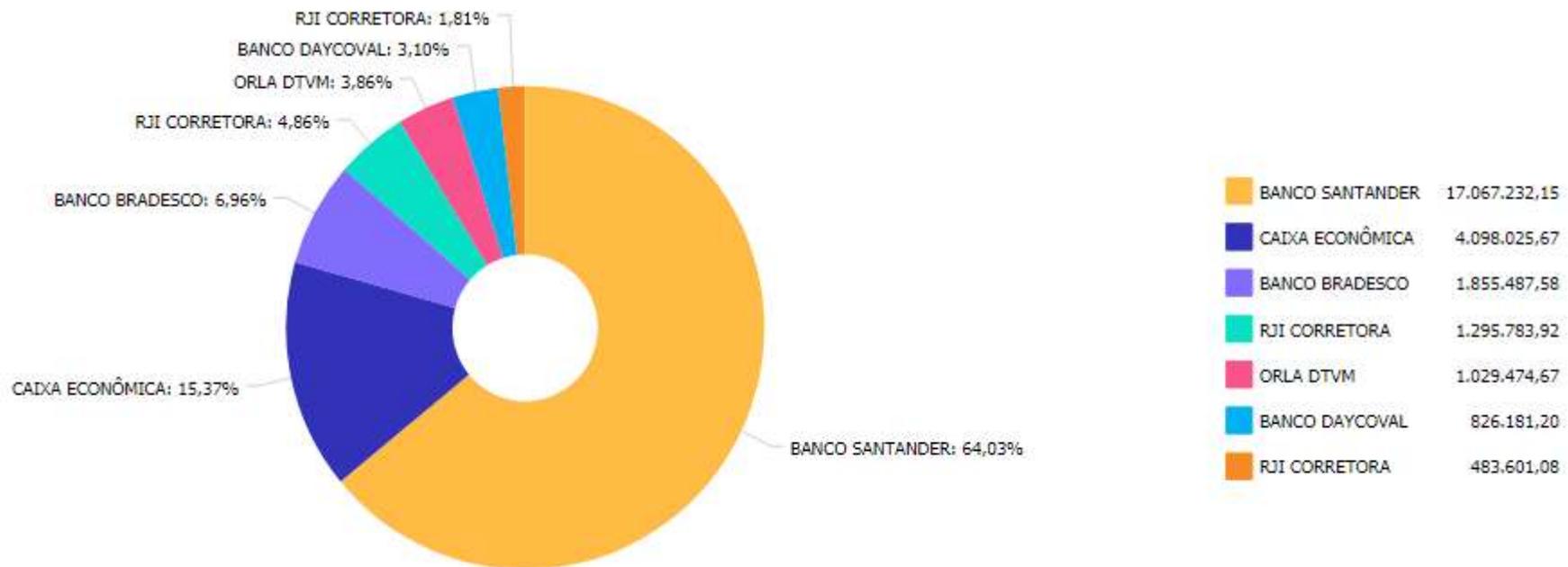
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,21%	6,59%	3,03%	4,28%	10,35%	21,46%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,27%	-5,73%	-2,88%	-3,74%	-6,52%	-3,07%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,15%	3,12%	0,51%	1,86%	4,54%	12,32%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,13%	2,97%	0,47%	1,57%	4,34%	11,93%	0,00%	0,01%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	2,79%	0,34%	1,42%	4,14%	11,81%	0,00%	0,01%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,12%	2,86%	0,22%	1,28%	4,02%	11,83%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,12%	4,51%	1,30%	5,11%	7,24%	23,75%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,15%	4,37%	1,23%	5,00%	7,04%	23,28%	0,02%	0,03%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,32%	-34,60%	-4,89%	-7,71%	-33,21%	-29,98%	0,00%	0,27%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	-0,19%	4,54%	1,30%	5,72%	7,13%	23,80%	0,02%	0,04%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,01%	-19,44%	-1,87%	-3,54%	-18,88%	-18,87%	0,01%	0,17%
IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-	-3,53%	-0,38%	1,33%	-2,75%	14,77%	-	-
CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00%	1,77%	0,39%	0,97%	2,90%	9,20%	0,00%	0,00%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,23%	1,93%	-0,05%	1,22%	4,33%	18,81%	0,00%	0,02%

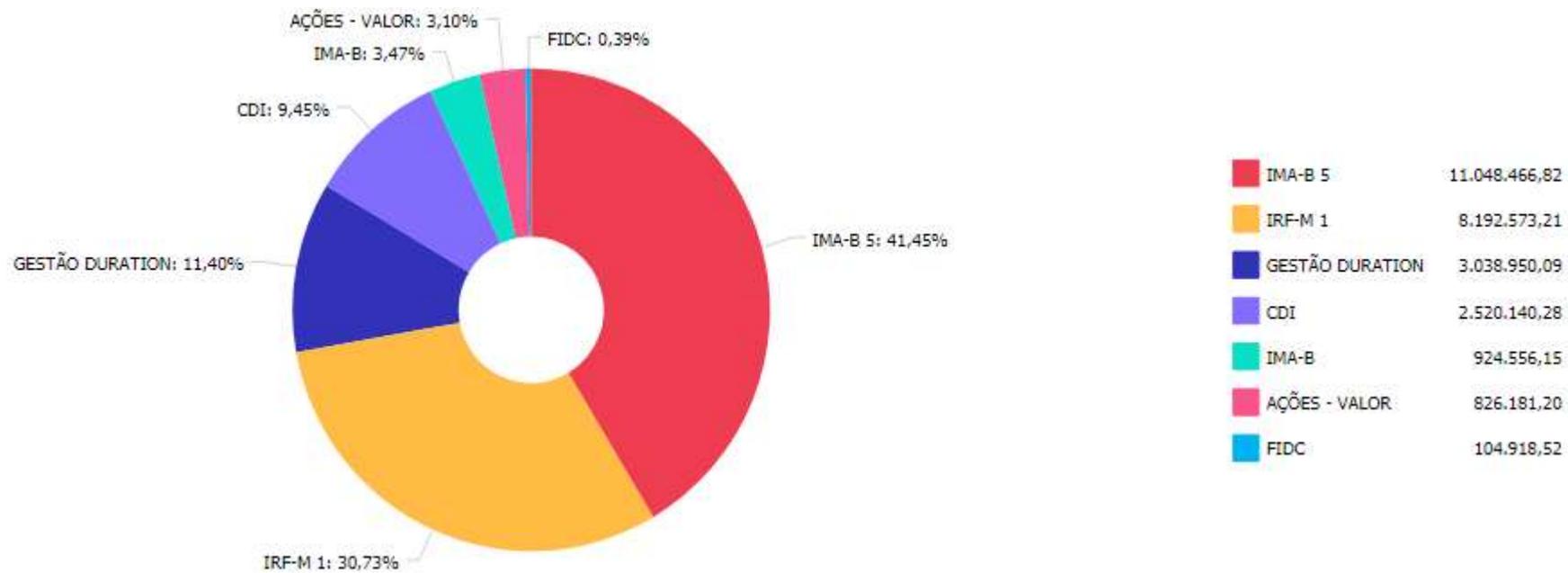
5. RETORNO DOS INVESTIMENTOS E BENCHMARK'S DE ATIVOS NO MÊS DE SETEMBRO/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,58%	-9,88%	19,23%	-	-
MULTINVEST FIAÇÕES	-7,49%	-17,15%	-2,33%	29,42%	-4,25%	33,72%	0,10%	0,44%

6. DISTRIBUIÇÃO DOS ATIVOS POR ADMINISTRADORES - BASE (SETEMBRO / 2020)



7. DISTRIBUIÇÃO DOS ATIVOS POR SUB-SEGMENTOS - BASE (SETEMBRO / 2020)



8. RETORNO E META ATUARIAL ACUMULADOS NO ANO DE 2020

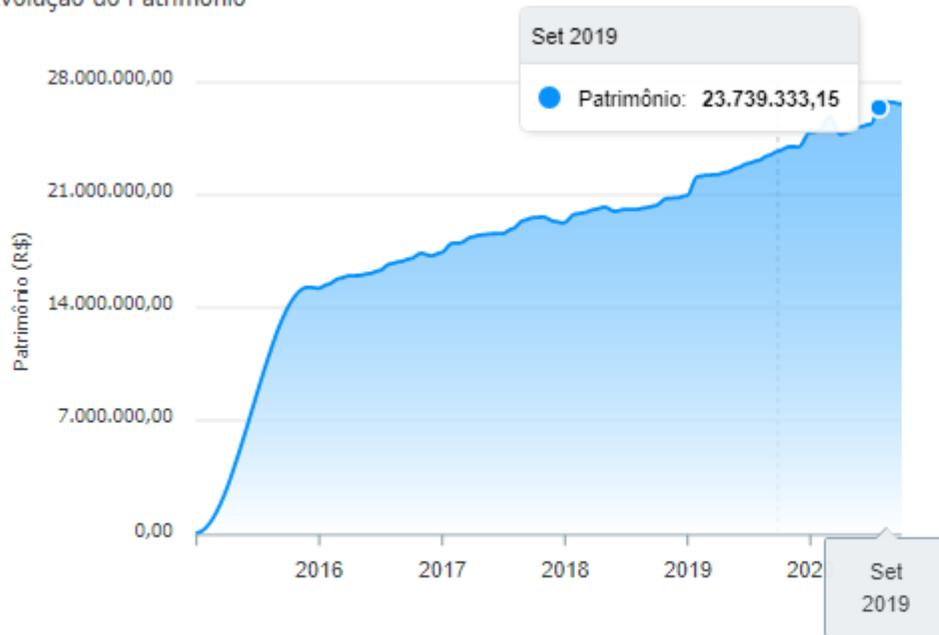
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	24.883.687,74	0,00	0,00	25.002.847,29	119.159,55	119.159,55	0,48%	0,48%	0,71%	0,71%	67,50%	0,76%
Fevereiro	25.002.847,29	900.000,00	0,00	25.864.052,64	-38.794,65	80.364,90	-0,15%	0,33%	0,66%	1,37%	23,92%	1,30%
Março	25.864.052,64	0,00	0,00	24.760.659,25	-1.103.393,39	-1.023.028,49	-4,27%	-3,95%	0,57%	1,95%	-202,73%	7,82%
Abril	24.760.659,25	0,00	0,00	24.940.269,03	179.609,78	-843.418,71	0,73%	-3,26%	0,14%	2,09%	-156,47%	2,78%
Mai	24.940.269,03	0,00	0,00	25.244.360,20	304.091,17	-539.327,54	1,22%	-2,08%	0,07%	2,17%	-95,80%	1,17%
Junho	25.244.360,20	0,00	0,00	25.410.409,43	166.049,23	-373.278,31	0,66%	-1,43%	0,74%	2,92%	-49,03%	2,37%
Julho	25.410.409,43	1.200.000,00	0,00	26.844.323,29	233.913,86	-139.364,45	0,88%	-0,56%	0,88%	3,83%	-14,76%	0,86%
Agosto	26.844.323,29	0,00	0,00	26.765.950,88	-78.372,41	-217.736,86	-0,29%	-0,86%	0,72%	4,57%	-18,70%	0,85%
Setembro	26.765.950,88	0,00	0,00	26.655.786,27	-110.164,61	-327.901,47	-0,41%	-1,26%	1,12%	5,74%	-22,00%	1,07%

Investimentos x Meta Atuarial



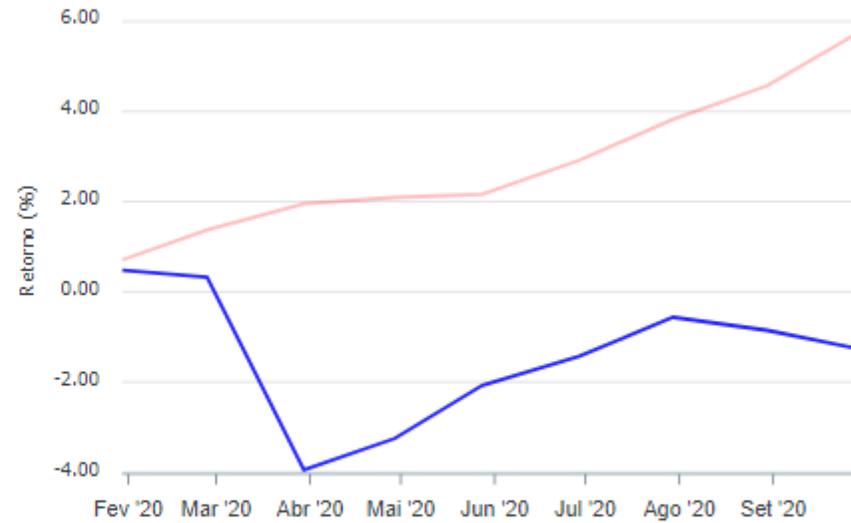
9. GRÁFICOS ILUSTRATIVOS DE EVOLUÇÃO PATRIMONIAL E INDICADORES

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos
- Meta Atuarial
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

10. RETORNO DOS INVESTIMENTOS APÓS AS MOVIMENTAÇÕES (APLICAÇÕES E RESGATES) NO MÊS DE SETEMBRO/2020

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.575.784,41	0,00	0,00	1.577.885,39	2.100,98	0,13%	0,13%	0,12%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.855.001,44	0,00	0,00	1.855.487,58	486,14	0,03%	0,03%	0,14%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	483.545,14	0,00	0,00	483.601,08	55,94	0,01%	0,01%	1,33%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.520.206,75	0,00	0,00	2.520.140,28	-66,47	0,00%	0,00%	0,10%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.764.930,41	0,00	0,00	4.759.200,24	-5.730,17	-0,12%	-0,12%	0,18%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.816.093,67	0,00	0,00	4.809.125,88	-6.967,79	-0,14%	-0,14%	1,65%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	4.468.423,30	0,00	0,00	4.459.955,94	-8.467,36	-0,19%	-0,19%	1,78%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.045.806,70	0,00	0,00	3.038.950,09	-6.856,61	-0,23%	-0,23%	0,40%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.299.990,01	0,00	0,00	1.295.783,92	-4.206,09	-0,32%	-0,32%	0,13%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	935.808,93	0,00	0,00	924.556,15	-11.252,78	-1,20%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	107.333,76	0,00	0,00	104.918,52	-2.415,24	-2,25%	-	-
Total Renda Fixa	25.872.924,52	0,00	0,00	25.829.605,07	-43.319,45	-0,17%		0,78%

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MULTIINVEST FIAÇÕES	893.026,36	0,00	0,00	826.181,20	-66.845,16	-7,49%	-7,49%	9,68%
Total Renda Variável	893.026,36	0,00	0,00	826.181,20	-66.845,16	-7,49%		9,68%

10.1 - RETORNO DOS INVESTIMENTOS APÓS AS MOVIMENTAÇÕES (APLICAÇÕES E RESGATES) NO 3º TRIMESTRE/2020

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.750.792,24	0,00	0,00	4.809.125,88	58.333,64	1,23%	1,23%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	4.402.782,54	0,00	0,00	4.459.955,94	57.173,40	1,30%	1,30%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.748.888,29	0,00	0,00	4.759.200,24	10.511,95	0,22%	0,22%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.510.321,32	0,00	0,00	2.520.140,28	9.818,96	0,39%	0,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.570.479,98	0,00	0,00	1.577.885,39	7.405,41	0,47%	0,47%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.849.209,85	0,00	0,00	1.855.487,58	6.277,93	0,34%	0,34%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1.841.926,46	1.200.000,00	0,00	3.038.950,09	-2.976,37	-0,10%	-0,05%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	108.008,91	0,00	0,00	104.918,52	-3.090,39	-2,88%	-2,88%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	928.066,86	0,00	0,00	924.556,15	-3.510,71	-0,38%	-0,38%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	491.836,55	0,00	0,00	483.601,08	-8.235,47	-1,67%	-1,67%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.362.424,25	0,00	0,00	1.295.783,92	-66.640,33	-4,89%	-4,89%
				Total Renda Fixa	65.068,02	0,25%	

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
MULTINVEST FIAÇÕES	845.872,38	0,00	0,00	826.181,20	-19.691,18	-2,33%	-2,33%
				Total Renda Variável	-19.691,18	-2,33%	

Este relatório foi gerado com informações do mês de setembro de 2020.

SERGIO FERRAZ NETO
Presidente do FMSS GUARACI