

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2021

Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.



Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	165.042.239,51	8,85%	926	1,79%	7º Ib
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREV...	D+1	Não há	129.309.645,51	6,94%	689	2,56%	7º Ib
19.303.795/0001-35	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	10.671.348,92	0,57%	140	1,81%	7º Ib
20.734.931/0001-20	BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	15/08/2024	22.304.887,73	1,20%	93	5,11%	7º Ib
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	336.404.084,15	18,04%	892	2,27%	7º Ib
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	154.604.002,94	8,29%	76	10,05%	7º Ib
13.455.117/0001-01	SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC ...	D+1	Não há	157.891.963,96	8,47%	172	11,94%	7º Ib
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	152.144.187,73	8,16%	443	5,89%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	46.197.138,65	2,48%	576	1,56%	7º IV a
28.515.874/0001-09	BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC...	D+4	Não há	131.147.574,32	7,03%	196	9,33%	7º IV a
08.702.798/0001-25	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B RESP LIMITADA FIF C...	D+1	Não há	17.478.043,75	0,94%	117	0,84%	7º IV a
35.536.532/0001-22	CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA F...	D+1	Não há	24.674.555,42	1,32%	103	3,20%	7º IV a
03.394.711/0001-86	BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+3	Não há	25.498.731,16	1,37%	52	7,43%	8º I a
13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF A...	D+4	Não há	81.389.257,53	4,37%	115	10,69%	8º I a
09.005.805/0001-00	BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	D+3	Não há	26.774.463,71	1,44%	44.564	1,96%	8º II a
03.660.879/0001-96	BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+4	Não há	68.251.133,59	3,66%	200	8,73%	8º II a
30.068.224/0001-04	CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+25	Não há	38.042.944,46	2,04%	2.394	3,73%	8º II a
24.571.992/0001-75	ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+24	Não há	53.703.066,31	2,88%	41.775	1,27%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	D+5	Não há	48.691.982,21	2,61%	55	4,66%	8º II a
32.665.845/0001-92	ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LI...	D+24	Não há	10.312.517,32	0,55%	18	2,82%	8º II a

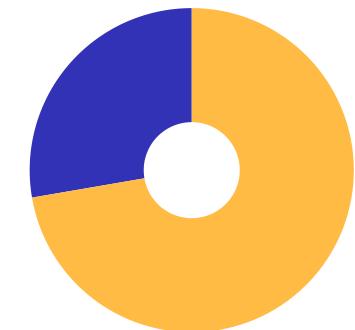
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	18.622.947,94	1,00%	134	1,09%	8º II a
02.436.763/0001-05	SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITA...	D+4	Não há	23.975.836,00	1,29%	2.980	4,77%	8º II a
08.070.841/0001-87	CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTI...	D+4	Não há	117.934.212,77	6,33%	18.477	2,44%	8º III
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	3.423.300,00	0,18%		1,90%	8º IV b
Total para cálculo dos limites da Resolução				1.864.490.065,59				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				26.775,69			Artigo 6º	
				PL Total	1.864.516.841,28			



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	30,00%	559.347.019,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	976.228.172,72	52,36%	12,00%	33,30%	90,00%	701.812.886,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	372.898.013,12
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	45,00%	371.641.499,87	19,93%	5,00%	23,00%	45,00%	467.379.029,65
Total Renda Fixa	100,00%	1.347.869.672,59	72,29%	17,00%	68,30%	185,00%	



RENDAS FIXAS 1.347.869.672,59
RENDAS VARIÁVEIS 516.620.393,00

ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!





CRÉDITO
& MERCADO

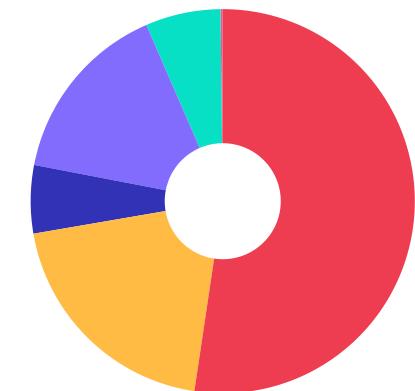
FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/01/2021

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2021)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea a	35,00%	106.887.988,69	5,73%	1,00%	4,30%	35,00%	545.683.534,27
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	25,00%	288.374.891,54	15,47%	5,00%	16,00%	25,00%	177.747.624,86
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	117.934.212,77	6,33%	2,00%	7,90%	10,00%	68.514.793,79
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	3.423.300,00	0,18%	0,00%	0,30%	1,00%	15.221.600,66
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	516.620.393,00	27,71%	8,00%	28,50%	71,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	10,00%	186.449.006,56
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	10,00%	186.449.006,56
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	



█ 7º I b █ 7º IV a █ 8º I a █ 8º II a
█ 8º III █ 8º IV b



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	12,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	5,00	45,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea a	0,00	0,00	1,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	5,00	25,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	2,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM S.A	601.868.354,33	32,28	0,10
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	552.443.911,76	29,63	0,03
BANCO BRADESCO	216.876.751,66	11,63	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	208.307.069,25	11,17	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	181.867.799,96	9,75	0,04
ITAÚ DTVM	59.004.499,53	3,16	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	25.498.731,16	1,37	0,00
ITAÚ UNIBANCO	18.622.947,94	1,00	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,15%	0,15%	3,16%	4,28%	8,20%	20,12%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,18%	0,18%	3,07%	4,24%	7,69%	18,77%	0,95%	3,21%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,28%	3,80%	7,55%	20,52%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,08%	0,08%	3,22%	3,67%	7,34%	20,02%	1,04%	3,50%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	0,10%	3,24%	3,66%	7,29%	19,97%	1,04%	3,52%
ITAU INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,08%	0,08%	3,21%	3,66%	7,33%	20,00%	1,03%	3,45%

IMA-B (Benchmark)	-0,85%	-0,85%	6,04%	2,78%	5,22%	24,29%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-1,02%	-1,02%	5,96%	2,45%	4,93%	23,74%	2,80%	11,15%

CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	-0,47%	-0,47%	3,25%	1,20%	-	-	1,56%	-
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,17%	0,17%	0,58%	0,94%	2,21%	7,89%	0,03%	0,34%

IPCA (Benchmark)	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	0,15%	3,08%	3,70%	6,62%	18,65%	0,88%	3,21%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	0,08%	0,08%	1,77%	0,70%	-	-	0,82%	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,58%	-0,58%	2,68%	0,52%	3,61%	14,74%	1,40%	4,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	2,18%	0,99%	5,83%	20,75%	0,76%	2,41%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/01/2021

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	0,08%	3,28%	3,54%	7,00%	20,22%	1,05%	3,70%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/01/2021

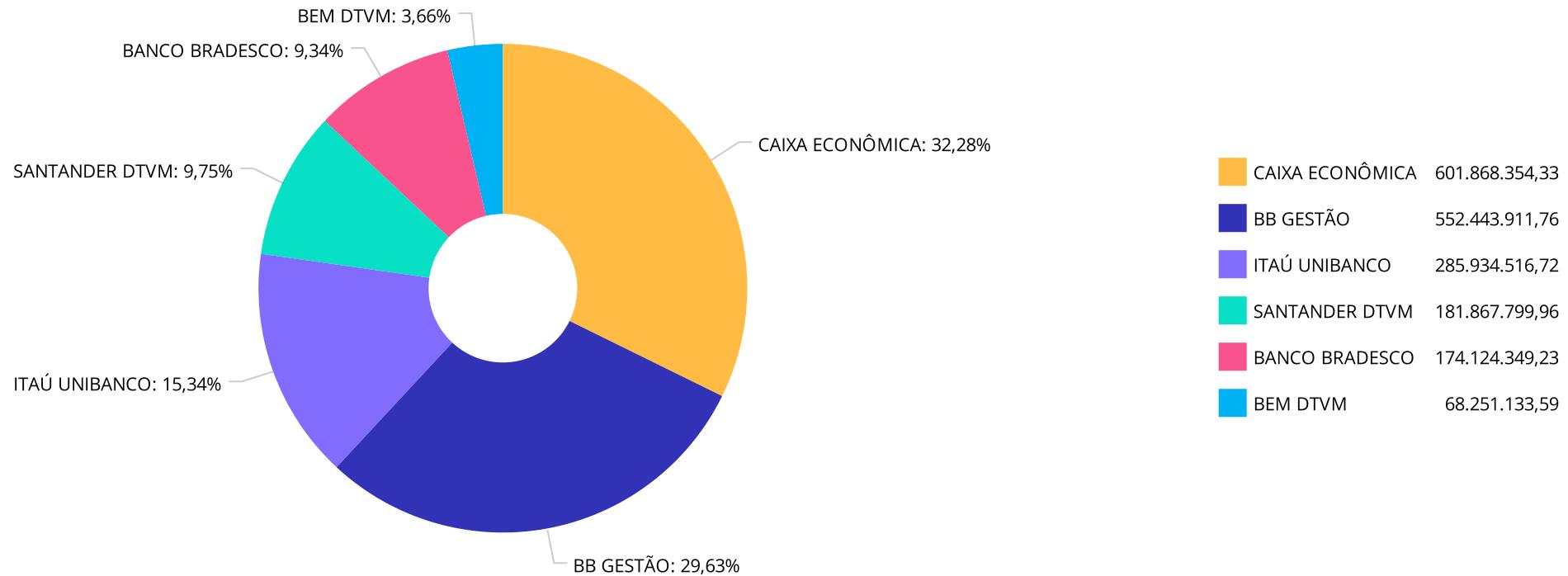
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	-0,09%	-0,09%	4,50%	3,05%	2,72%	17,79%	1,73%	7,69%

Ibovespa (Benchmark)	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	-2,34%	-2,34%	20,39%	10,30%	-0,91%	22,60%	11,57%	42,72%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-2,57%	-2,57%	18,02%	5,76%	-4,46%	-	11,08%	43,84%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-1,46%	-1,46%	17,60%	12,10%	-6,09%	23,46%	10,78%	42,53%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-2,48%	-2,48%	13,85%	13,11%	-4,84%	13,16%	12,40%	41,26%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	-3,18%	-3,18%	16,79%	6,58%	-7,53%	25,82%	13,37%	39,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHENIX RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-2,91%	-2,91%	19,43%	1,12%	-24,63%	-1,24%	13,45%	52,63%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-3,06%	-3,06%	17,53%	8,32%	-8,34%	11,24%	11,65%	44,08%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-3,32%	-3,32%	22,26%	11,68%	1,02%	17,63%	11,72%	42,27%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-3,35%	-3,35%	22,40%	11,66%	0,84%	17,52%	11,82%	42,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMITADA FIF CICAÇ...	-1,63%	-1,63%	18,01%	9,78%	4,25%	-	11,52%	42,42%

IFIX (Benchmark)	0,32%	0,32%	4,07%	5,35%	-6,43%	19,49%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-16,62%	-16,62%	-23,42%	-34,04%	-34,79%	9,20%	9,52%	51,45%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2021)



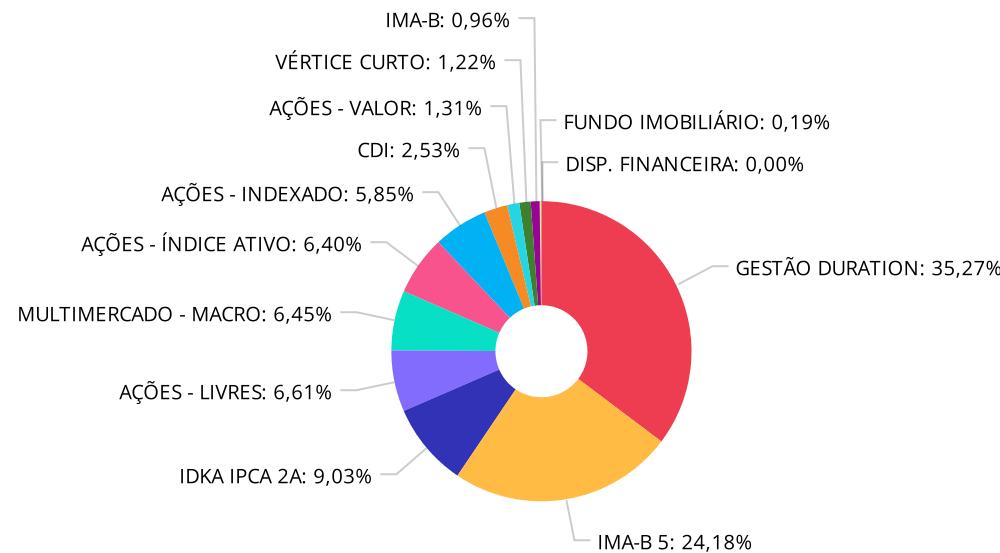


CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/01/2021

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2021)



■ GESTÃO DURATION	644.370.401,62	■ IMA-B 5	441.805.612,41	■ IDKA IPCA 2A	165.042.239,51	■ AÇÕES - LIVRES	120.681.476,03
■ MULTIMERCADO - MACRO	117.934.212,77	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	116.943.115,80	■ AÇÕES - INDEXADO	106.887.988,69	■ CDI	46.197.138,65
■ AÇÕES - VALOR	23.975.836,00	■ VÉRTICE CURTO	22.304.887,73	■ IMA-B	17.478.043,75	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	3.423.300,00
■ DISP. FINANCEIRA	26.775,69						



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/01/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/01/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/01/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

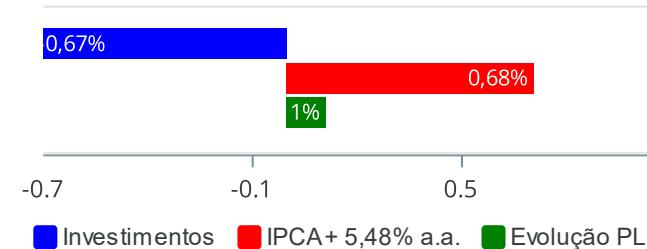


CRÉDITO
& MERCADO

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	1.862.483.620,53	49.706.982,08	35.173.000,00	1.864.490.065,59	-12.527.537,02	-12.527.537,02	-0,67%	-0,67%	0,68%	0,68%	-98,82%	3,38%

Investimentos x Meta de Rentabilidade x PL

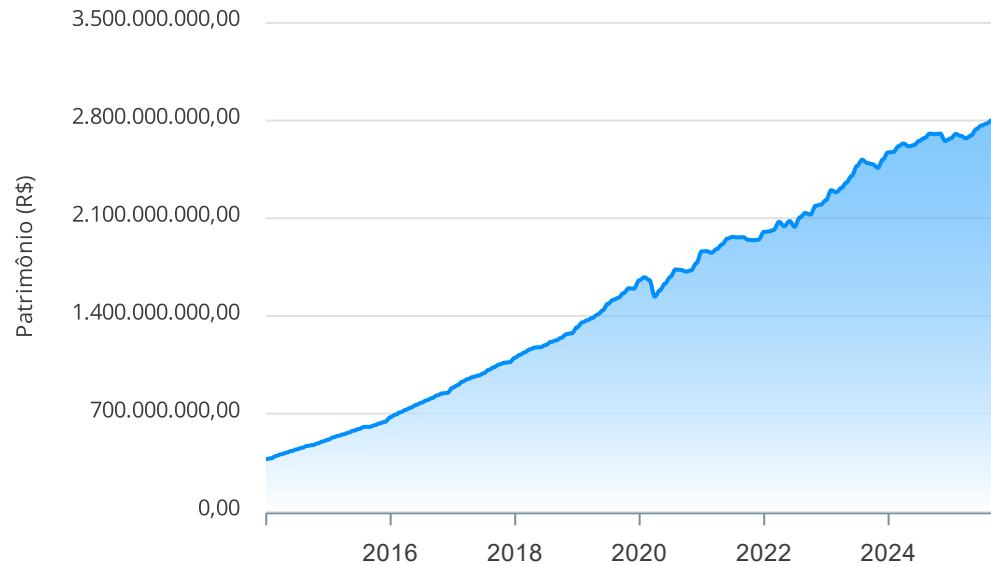




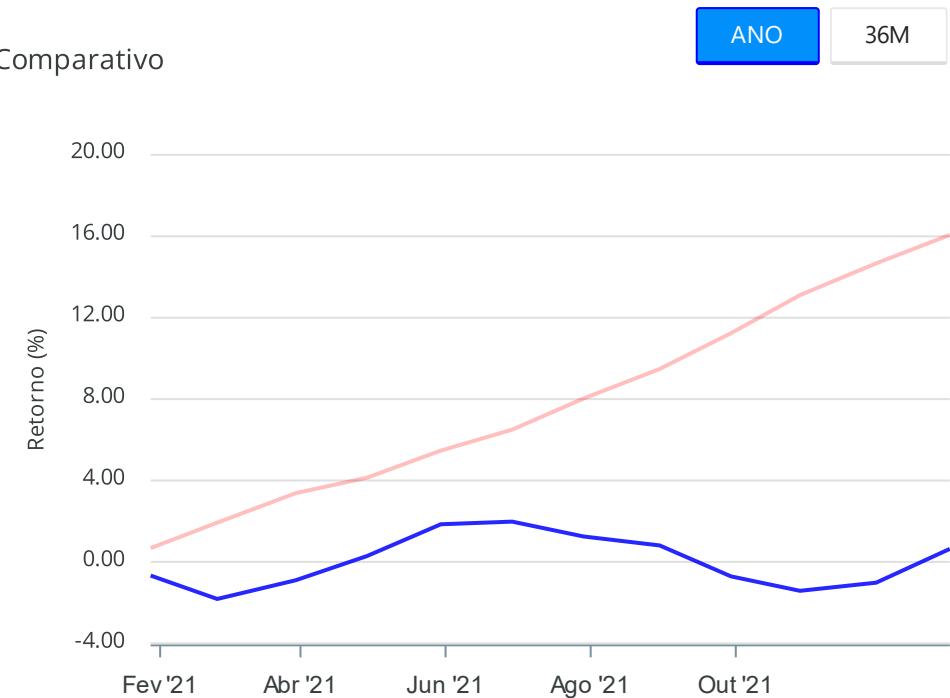
CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMML IDIV



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	164.750.646,12	0,00	0,00	165.042.239,51	291.593,39	0,18%	0,18%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.655.451,01	0,00	0,00	10.671.348,92	15.897,91	0,15%	0,15%	0,88%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	129.185.043,61	0,00	0,00	129.309.645,51	124.601,90	0,10%	0,10%	1,04%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	24.653.966,09	0,00	0,00	24.674.555,42	20.589,33	0,08%	0,08%	0,82%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RE...	157.760.931,92	0,00	0,00	157.891.963,96	131.032,04	0,08%	0,08%	1,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	154.478.086,10	0,00	0,00	154.604.002,94	125.916,84	0,08%	0,08%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	22.287.404,29	0,00	0,00	22.304.887,73	17.483,44	0,08%	0,08%	1,05%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	40.008.009,74	41.285.982,08	35.152.000,00	46.197.138,65	55.146,83	0,07%	0,17%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	336.298.000,44	21.000,00	0,00	336.404.084,15	85.083,71	0,03%	0,03%	0,76%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	152.856.750,87	0,00	0,00	152.144.187,73	-712.563,14	-0,47%	-0,47%	1,56%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	131.911.704,88	0,00	0,00	131.147.574,32	-764.130,56	-0,58%	-0,58%	1,40%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC...	17.658.344,91	0,00	0,00	17.478.043,75	-180.301,16	-1,02%	-1,02%	2,80%
Total Renda Fixa	1.342.504.339,98	41.306.982,08	35.152.000,00	1.347.869.672,59	-789.649,47	-0,06%		1,03%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIME...	118.038.465,20	0,00	0,00	117.934.212,77	-104.252,43	-0,09%	-0,09%	1,73%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	54.500.960,47	0,00	0,00	53.703.066,31	-797.894,16	-1,46%	-1,46%	10,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMI...	10.483.515,61	0,00	0,00	10.312.517,32	-170.998,29	-1,63%	-1,63%	11,52%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	49.856.820,63	0,00	0,00	48.691.982,21	-1.164.838,42	-2,34%	-2,34%	11,57%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	69.987.199,99	0,00	0,00	68.251.133,59	-1.736.066,40	-2,48%	-2,48%	12,40%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕE...	39.047.858,44	0,00	0,00	38.042.944,46	-1.004.913,98	-2,57%	-2,57%	11,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CICA...	19.180.359,77	0,00	0,00	18.622.947,94	-557.411,83	-2,91%	-2,91%	13,45%
SANTA NDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITADA...	24.731.655,27	0,00	0,00	23.975.836,00	-755.819,27	-3,06%	-3,06%	11,65%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	27.652.454,51	0,00	0,00	26.774.463,71	-877.990,80	-3,18%	-3,18%	13,37%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	26.381.080,23	0,00	0,00	25.498.731,16	-882.349,07	-3,34%	-3,34%	11,82%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕ...	76.013.410,43	8.400.000,00	0,00	81.389.257,53	-3.024.152,90	-3,58%	-3,32%	11,72%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4.105.500,00	0,00	21.000,00	3.423.300,00	-661.200,00	-16,11%	-16,62%	9,52%
Total Renda Variável	519.979.280,55	8.400.000,00	21.000,00	516.620.393,00	-11.737.887,55	-2,22%		9,50%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

