

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2021

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



Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 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	167.087.055,43	8,50%	992	1,59%	7º Ib
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREV...	D+1	Não há	110.682.736,88	5,63%	745	1,92%	7º Ib
19.303.795/0001-35	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	10.540.381,03	0,54%	140	1,81%	7º Ib
20.734.931/0001-20	BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	15/08/2024	21.990.410,58	1,12%	92	5,11%	7º Ib
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	338.820.296,24	17,23%	974	2,11%	7º Ib
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	126.135.952,17	6,41%	79	7,85%	7º Ib
13.455.117/0001-01	SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC ...	D+1	Não há	159.637.172,44	8,12%	188	12,34%	7º Ib
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	152.255.815,09	7,74%	572	3,55%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	50.864.407,73	2,59%	659	1,30%	7º IV a
28.515.874/0001-09	BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC...	D+4	Não há	110.837.081,55	5,64%	196	7,38%	7º IV a
35.536.532/0001-22	CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA F...	D+1	Não há	24.831.148,12	1,26%	138	2,48%	7º IV a
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA C...	D+0	Não há	2.163,86	0,00%	16.043	0,00%	7º IV a
03.394.711/0001-86	BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+3	Não há	28.058.839,60	1,43%	50	7,87%	8º Ia
13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF A...	D+4	Não há	89.506.138,11	4,55%	117	10,46%	8º Ia
09.005.805/0001-00	BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	D+3	Não há	51.282.335,07	2,61%	56.940	2,81%	8º II a
03.660.879/0001-96	BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+4	Não há	73.999.468,43	3,76%	185	9,53%	8º II a
30.068.224/0001-04	CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇ...	D+25	Não há	42.105.855,05	2,14%	2.355	3,68%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	22.887.286,70	1,16%	427	0,80%	8º II a
24.571.992/0001-75	ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+24	Não há	61.162.189,61	3,11%	37.076	1,35%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	D+5	Não há	52.878.764,98	2,69%	56	4,38%	8º II a



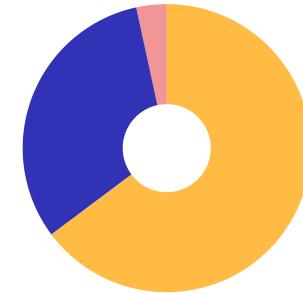
Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
32.665.845/0001-92	ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LI...	D+24	Não há	11.094.954,27	0,56%	18	2,77%	8º II a
02.436.763/0001-05	SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITA...	D+4	Não há	25.377.057,51	1,29%	3.246	6,72%	8º II a
08.070.841/0001-87	CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTI...	D+4	Não há	121.719.951,39	6,19%	16.692	2,75%	8º III
26.269.692/0001-61	ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+1	Não há	43.326.787,71	2,20%	1.255	1,97%	8º III
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.513.100,00	0,13%		1,90%	8º IV b
28.578.936/0001-13	BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	30.758.034,72	1,56%	90	2,83%	9º II
39.528.038/0001-77	CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	18.307.845,73	0,93%	1.080	10,40%	9º II
17.804.792/0001-50	SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	D+8	Não há	17.839.178,55	0,91%	13.324	0,91%	9º II
Total para cálculo dos limites da Resolução				1.966.502.408,55				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				12.687,32			Artigo 6º	
				PL Total	1.966.515.095,87			



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 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%	589.950.722,57
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	934.894.004,77	47,54%	12,00%	33,30%	90,00%	834.958.162,93
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	393.300.481,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	45,00%	338.790.616,35	17,23%	5,00%	23,00%	45,00%	546.135.467,50
Total Renda Fixa	100,00%	1.273.684.621,12	64,77%	17,00%	68,30%	185,00%	



- █ RENDA FIXA 1.273.684.621,12
- █ RENDA VARIÁVEL 625.912.728,43
- █ EXTERIOR 66.905.059,00

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!

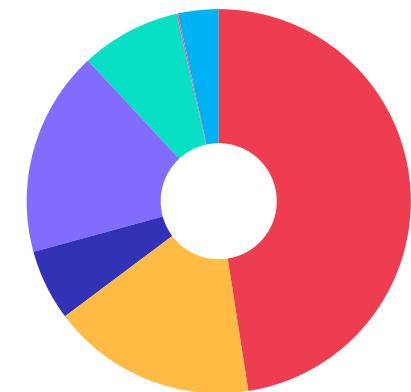




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2021)

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%	117.564.977,71	5,98%	1,00%	4,30%	35,00%	570.710.865,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	25,00%	340.787.911,62	17,33%	5,00%	16,00%	25,00%	150.837.690,52
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	165.046.739,10	8,39%	2,00%	7,90%	10,00%	31.603.501,76
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	2.513.100,00	0,13%	0,00%	0,30%	1,00%	17.151.924,09
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	625.912.728,43	31,83%	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%	66.905.059,00	3,40%	0,00%	1,50%	10,00%	129.745.181,86
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	10,00%	196.650.240,86
Total Exterior	10,00%	66.905.059,00	3,40%	0,00%	3,00%	20,00%	





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 (Junho / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM S.A	660.693.785,20	33,60	0,11
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	595.461.176,53	30,28	0,03
ITAU ASSET MANAGEMENT	230.624.929,49	11,73	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	202.853.408,50	10,32	0,05
BANCO BRADESCO	184.836.549,98	9,40	-
ITAU DTVM	63.973.719,25	3,25	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	28.058.839,60	1,43	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 Junho/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,32%	1,87%	1,91%	1,87%	7,06%	16,45%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	-0,09%	1,42%	1,42%	1,42%	6,38%	15,08%	1,36%	2,03%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,13%	1,29%	1,44%	1,29%	6,07%	15,42%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,15%	1,19%	1,38%	1,19%	5,83%	14,95%	1,53%	2,35%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,19%	1,17%	1,37%	1,17%	5,78%	14,87%	1,55%	2,38%
ITAU INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,15%	1,17%	1,38%	1,17%	5,81%	14,95%	1,53%	2,36%
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,16%	0,42%	0,36%	0,42%	0,48%	0,97%	0,01%	0,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	0,05%	-0,39%	1,36%	-0,39%	3,22%	-	1,46%	4,05%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIA DO PREVID...	0,33%	1,32%	0,82%	1,32%	2,35%	6,51%	0,02%	0,29%
IPCA (Benchmark)	0,53%	3,77%	1,68%	3,77%	8,35%	10,66%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	1,24%	1,60%	1,24%	5,75%	14,64%	1,30%	2,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,14%	1,56%	1,57%	1,56%	5,93%	14,11%	1,13%	1,98%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	0,11%	0,72%	0,83%	0,72%	2,29%	-	0,73%	1,84%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,33%	-0,80%	1,29%	-0,80%	2,01%	8,38%	1,16%	3,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,00%	0,72%	0,90%	0,72%	2,68%	12,77%	0,97%	2,14%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIMERCADO LP	-0,17%	3,12%	2,40%	3,12%	7,86%	14,62%	1,32%	3,98%

Global BDRX (Benchmark)	-0,28%	10,06%	-3,18%	10,06%	27,98%	98,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,19%	8,36%	-4,36%	8,36%	26,23%	95,14%	5,33%	17,15%

Ibovespa (Benchmark)	0,46%	6,54%	8,72%	6,54%	33,40%	25,59%	-	-
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	-0,26%	12,99%	10,48%	12,99%	34,12%	41,19%	4,50%	19,60%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	1,03%	2,61%	8,97%	2,61%	24,87%	12,43%	4,68%	19,41%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	0,43%	6,32%	8,57%	6,32%	32,82%	24,90%	10,95%	22,43%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	0,42%	6,36%	8,60%	6,36%	32,97%	24,85%	5,63%	22,61%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	0,58%	6,06%	8,72%	6,06%	29,92%	27,76%	4,65%	19,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	0,53%	5,83%	9,13%	5,83%	29,36%	38,26%	4,55%	18,02%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	1,66%	7,83%	10,35%	7,83%	27,85%	34,45%	4,45%	19,54%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-0,21%	12,22%	11,00%	12,22%	37,29%	31,25%	4,87%	16,72%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	2,09%	5,73%	11,88%	5,73%	34,96%	16,77%	4,46%	16,05%

IFIX (Benchmark)	-2,19%	-4,02%	-3,23%	-4,02%	-1,83%	4,90%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-8,55%	-38,79%	-15,80%	-38,79%	-46,30%	-18,83%	13,68%	39,15%



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

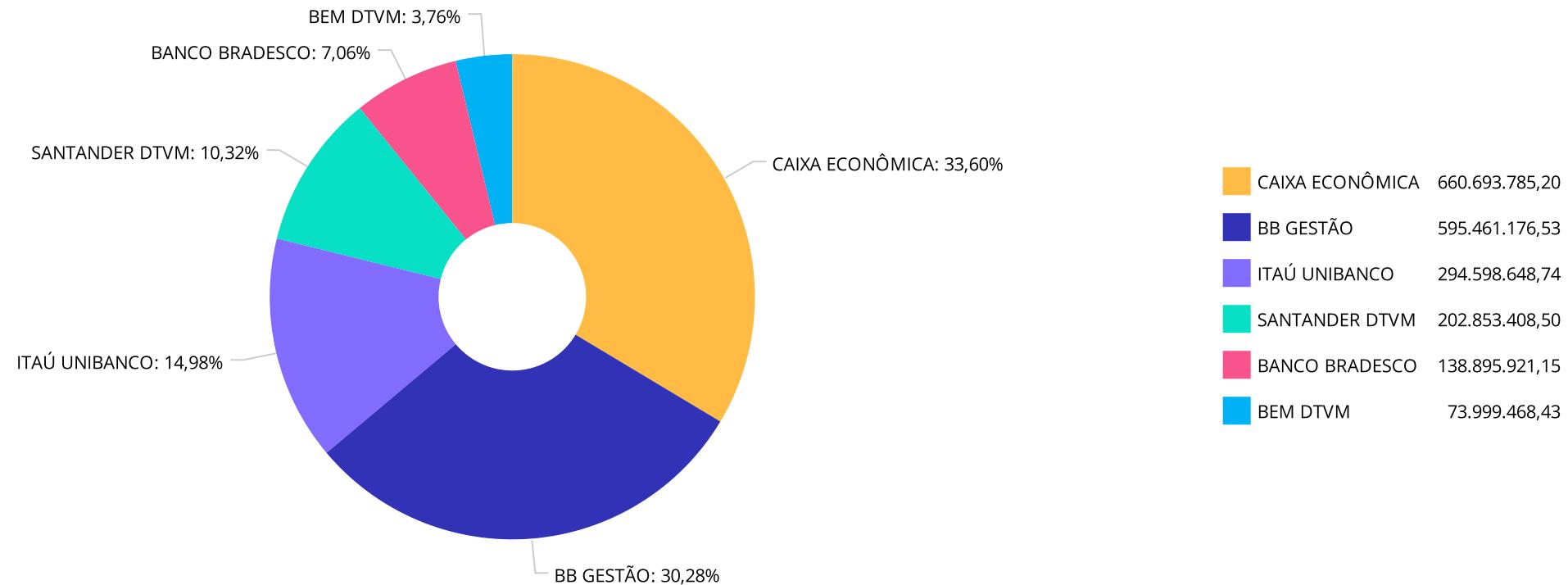
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	2,22%	14,41%	8,17%	14,41%	38,62%	46,09%	-	-
ITAU S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	2,68%	16,13%	8,75%	16,13%	39,42%	45,94%	4,67%	14,64%

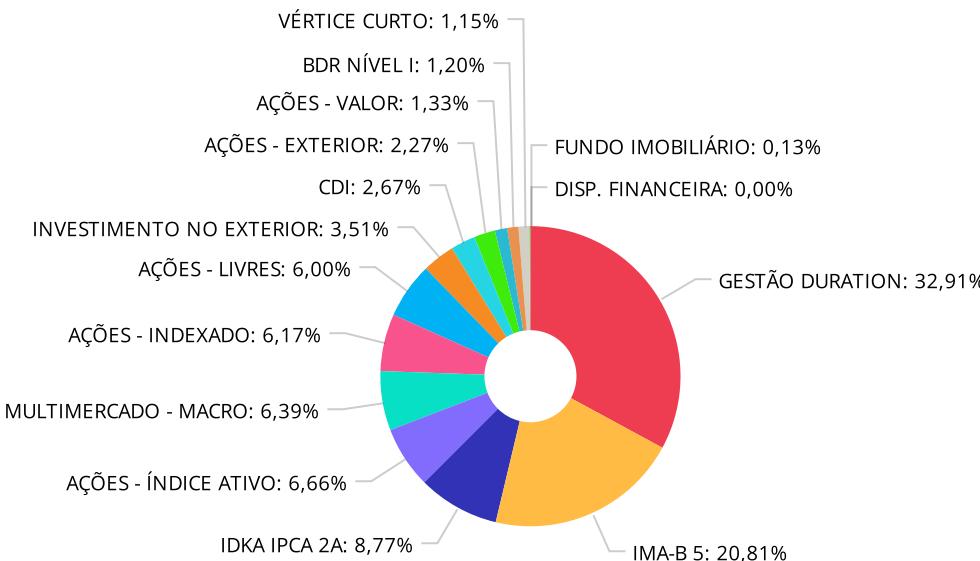


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	-3,06%	7,96%	-5,78%	7,96%	25,18%	80,80%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR R...	-2,82%	7,38%	-5,26%	7,38%	27,97%	93,72%	5,26%	14,339%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP L...	0,21%	3,03%	-3,04%	3,03%	-	-	5,68%	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	-3,94%	7,50%	-6,12%	7,50%	36,16%	105,20%	7,04%	14,057%

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



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


■ GESTÃO DURATION	626.744.341,00	■ IMA-B 5	396.455.861,49	■ IDKA IPCA 2A	167.087.055,43	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	126.878.233,41
■ MULTIMERCADO - MACRO	121.719.951,39	■ AÇÕES - INDEXADO	117.564.977,71	■ AÇÕES - LIVRES	114.362.998,93	■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR	66.905.059,00
■ CDI	50.866.571,59	■ AÇÕES - EXTERIOR	43.326.787,71	■ AÇÕES - VALOR	25.377.057,51	■ BDR NÍVEL I	22.887.286,70
■ VÉRTICE CURTO	21.990.410,58	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.513.100,00	■ Disp. FINANCEIRA	12.687,32		



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 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: 30/06/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 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: 30/06/2021

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

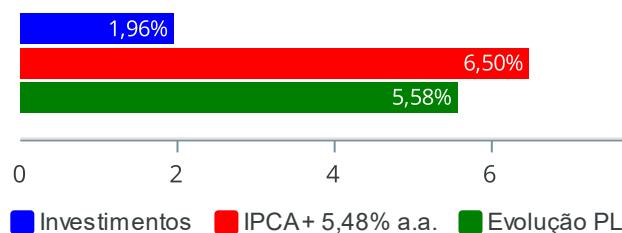
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------



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%
Fevereiro	1.864.490.065,59	36.947.580,18	26.752.292,81	1.852.854.695,14	-21.830.657,82	-34.358.194,84	-1,16%	-1,82%	1,25%	1,93%	-94,57%	3,44%
Março	1.852.854.695,14	39.865.308,79	48.287.832,47	1.861.911.407,02	17.479.235,56	-16.878.959,28	0,92%	-0,92%	1,42%	3,38%	-27,15%	3,65%
Abril	1.861.911.407,02	62.415.274,17	34.014.544,28	1.913.007.018,22	22.694.881,31	5.815.922,03	1,20%	0,27%	0,74%	4,14%	6,57%	2,37%
Maio	1.913.007.018,22	120.318.723,83	109.062.779,77	1.954.165.549,26	29.902.586,98	35.718.509,01	1,55%	1,83%	1,28%	5,47%	33,45%	2,87%
Junho	1.954.165.549,26	61.459.292,38	51.620.045,66	1.966.502.408,55	2.497.612,57	38.216.121,58	0,13%	1,96%	0,98%	6,50%	30,14%	2,60%

Investimentos x Meta de Rentabilidade x PL





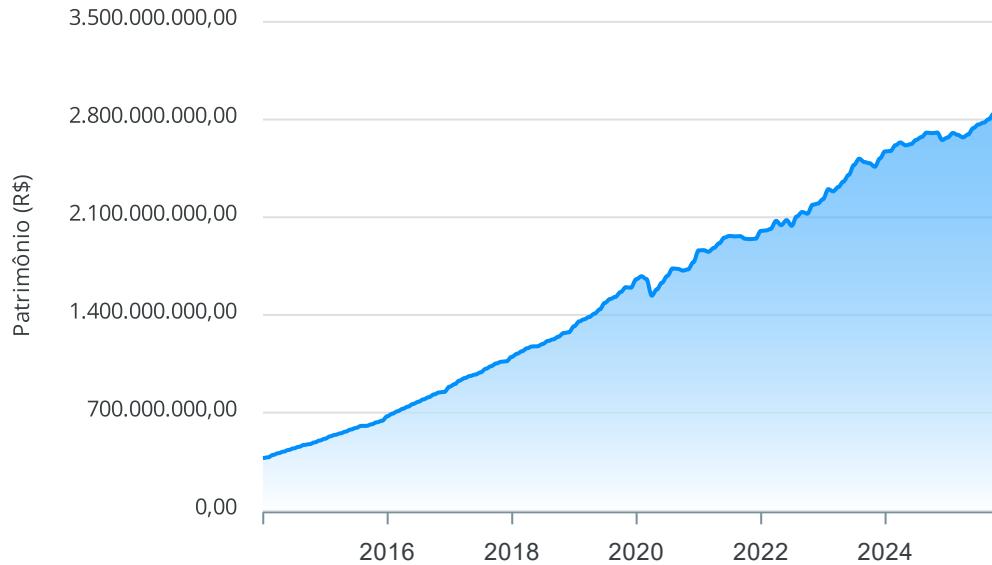
CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

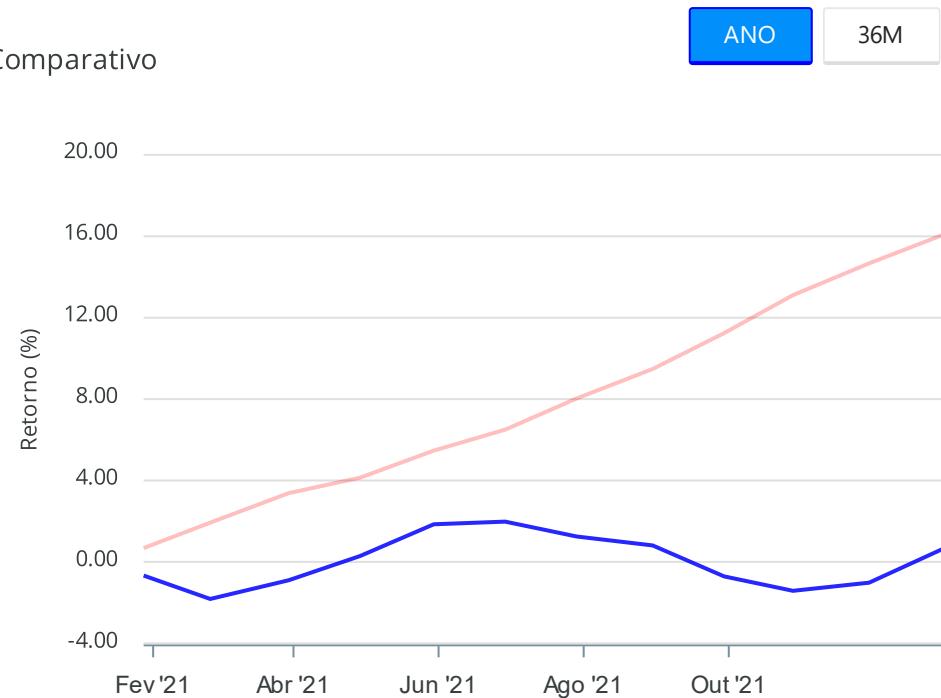
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2021

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 Junho/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	130.426.525,51	0,00	20.000.000,00	110.837.081,55	410.556,04	0,31%	0,33%	1,16%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	50.416.982,38	26.899.000,00	26.598.300,00	50.864.407,73	146.725,35	0,19%	0,33%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.525.190,92	0,00	0,00	10.540.381,03	15.190,11	0,14%	0,14%	1,13%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	24.805.003,16	0,00	0,00	24.831.148,12	26.144,96	0,11%	0,11%	0,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	152.184.551,08	0,00	0,00	152.255.815,09	71.264,01	0,05%	0,05%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	21.982.161,28	0,00	0,00	21.990.410,58	8.249,30	0,04%	0,04%	1,30%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RESP LIMITADA F...	0,00	5.000.000,00	5.001.271,08	0,00	1.271,08	0,03%	0,31%	0,01%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	1,37	6.436,67	4.274,58	2.163,86	0,40	0,01%	0,16%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	338.814.286,83	16.201,35	0,00	338.820.296,24	-10.191,94	0,00%	0,00%	0,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	167.243.442,25	0,00	0,00	167.087.055,43	-156.386,82	-0,09%	-0,09%	1,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	126.323.723,20	0,00	0,00	126.135.952,17	-187.771,03	-0,15%	-0,15%	1,53%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RE...	159.880.958,55	0,00	0,00	159.637.172,44	-243.786,11	-0,15%	-0,15%	1,53%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	110.888.813,63	0,00	0,00	110.682.736,88	-206.076,75	-0,19%	-0,19%	1,55%
Total Renda Fixa	1.293.491.640,16	31.921.638,02	51.603.845,66	1.273.684.621,12	-124.811,40	-0,01%		1,24%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	42.196.527,09	0,00	0,00	43.326.787,71	1.130.260,62	2,68%	2,68%	4,67%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	72.483.507,50	0,00	0,00	73.999.468,43	1.515.960,93	2,09%	2,09%	4,46%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕE...	41.419.089,42	0,00	0,00	42.105.855,05	686.765,63	1,66%	1,66%	4,45%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITADA...	25.118.253,78	0,00	0,00	25.377.057,51	258.803,73	1,03%	1,03%	4,68%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	52.572.634,63	0,00	0,00	52.878.764,98	306.130,35	0,58%	0,58%	4,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMI...	11.036.869,16	0,00	0,00	11.094.954,27	58.085,11	0,53%	0,53%	4,55%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕ...	89.124.460,74	0,00	0,00	89.506.138,11	381.677,37	0,43%	0,43%	10,95%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	27.940.441,91	0,00	0,00	28.058.839,60	118.397,69	0,42%	0,42%	5,63%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIME...	121.925.664,36	0,00	0,00	121.719.951,39	-205.712,97	-0,17%	-0,15%	1,32%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	61.291.532,60	0,00	0,00	61.162.189,61	-129.342,99	-0,21%	-0,21%	4,87%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	51.414.541,53	0,00	0,00	51.282.335,07	-132.206,46	-0,26%	-0,26%	4,50%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.748.000,00	0,00	16.200,00	2.513.100,00	-218.700,00	-7,96%	-8,55%	13,68%
Total Renda Variável	599.271.522,72	0,00	16.200,00	603.025.441,73	3.770.119,01	0,63%		4,97%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	13.220.977,08	5.000.000,00	0,00	18.307.845,73	86.868,65	0,48%	-0,32%	5,68%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	18.047.688,52	5.000.000,00	0,00	22.887.286,70	-160.401,82	-0,70%	-1,19%	5,33%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	13.192.979,22	5.001.271,08	0,00	17.839.178,55	-355.071,75	-1,95%	-2,82%	5,26%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	16.940.741,56	14.536.383,28	0,00	30.758.034,72	-719.090,12	-2,28%	-3,94%	7,04%
Total Exterior	61.402.386,38	29.537.654,36	0,00	89.792.345,70	-1.147.695,04	-1,26%		5,97%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	335.740.187,14	52.204,67	0,00	338.820.296,24	3.027.904,43	0,90%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	164.745.191,72	0,00	0,00	167.087.055,43	2.341.863,71	1,42%	1,42%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RE...	157.457.854,99	0,00	0,00	159.637.172,44	2.179.317,45	1,38%	1,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	150.212.039,13	0,00	0,00	152.255.815,09	2.043.775,96	1,36%	1,36%
ITAU INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	154.159.733,56	0,00	30.000.000,00	126.135.952,17	1.976.218,61	1,28%	1,38%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	128.928.258,94	0,00	20.000.000,00	110.682.736,88	1.754.477,94	1,36%	1,37%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	129.187.308,29	0,00	20.000.000,00	110.837.081,55	1.649.773,26	1,28%	1,29%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	47.871.812,97	99.141.632,71	96.503.307,65	50.864.407,73	354.269,70	0,24%	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	21.645.090,50	0,00	0,00	21.990.410,58	345.320,08	1,60%	1,60%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	24.626.983,76	0,00	0,00	24.831.148,12	204.164,36	0,83%	0,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.377.669,03	0,00	0,00	10.540.381,03	162.712,00	1,57%	1,57%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC...	17.051.487,69	0,00	17.068.496,28	0,00	17.008,59	0,10%	2,15%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RESP LIMITADA F...	0,00	11.000.000,00	11.002.103,93	0,00	2.103,93	0,02%	0,73%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	0,06	73.421,03	71.261,85	2.163,86	4,62	0,01%	0,36%
Total Renda Fixa	1.342.003.617,78	110.267.258,41	194.645.169,71	1.273.684.621,12	16.058.914,64	1,11%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	66.140.290,11	0,00	0,00	73.999.468,43	7.859.178,32	11,88%	11,88%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕ...	82.443.686,15	0,00	0,00	89.506.138,11	7.062.451,96	8,57%	8,57%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	55.099.961,92	0,00	0,00	61.162.189,61	6.062.227,69	11,00%	11,00%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	48.639.078,94	0,00	0,00	52.878.764,98	4.239.686,04	8,72%	8,72%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕE...	38.158.498,49	0,00	0,00	42.105.855,05	3.947.356,56	10,34%	10,34%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	28.282.154,16	20.000.000,00	0,00	51.282.335,07	3.000.180,91	6,21%	10,48%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIME...	118.871.224,89	0,00	0,00	121.719.951,39	2.848.726,50	2,40%	2,40%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	25.835.846,14	0,00	0,00	28.058.839,60	2.222.993,46	8,60%	8,60%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITADA...	23.288.045,11	0,00	0,00	25.377.057,51	2.089.012,40	8,97%	8,97%
ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	11.329.175,80	30.000.000,00	0,00	43.326.787,71	1.997.611,91	4,83%	8,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMI...	10.166.836,73	0,00	0,00	11.094.954,27	928.117,54	9,13%	9,13%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.984.700,00	0,00	52.200,00	2.513.100,00	-419.400,00	-14,05%	-15,80%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	1.129.917,03	22.777.596,69	0,00	22.887.286,70	-1.020.227,02	-4,27%	-4,36%
Total Renda Variável	512.369.415,47	72.777.596,69	52.200,00	625.912.728,43	40.817.916,27	6,98%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	336.298.000,44	109.226,72	0,00	338.820.296,24	2.413.069,08	-0,26%	0,72%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	164.750.646,12	100.000,00	100.000,00	167.087.055,43	2.336.409,31	4,33%	1,42%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RE...	157.760.931,92	0,00	0,00	159.637.172,44	1.876.240,52	4,06%	1,19%
ITÁU INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	154.478.086,10	0,00	30.000.000,00	126.135.952,17	1.657.866,07	3,78%	1,17%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	129.185.043,61	0,00	20.000.000,00	110.682.736,88	1.497.693,27	4,23%	1,17%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	40.008.009,74	194.014.614,79	183.708.212,41	50.864.407,73	549.995,61	2,79%	1,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	22.287.404,29	0,00	568.343,99	21.990.410,58	271.350,28	4,90%	1,24%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	24.653.966,09	0,00	0,00	24.831.148,12	177.182,03	0,69%	0,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.655.451,01	0,00	278.571,25	10.540.381,03	163.501,27	5,45%	1,56%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RESP LIMITADA F...	0,00	11.000.000,00	11.002.103,93	0,00	2.103,93	0,00%	1,18%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	0,00	3.612.067,87	3.609.930,86	2.163,86	26,85	0,00%	0,42%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B RESP LIMITADA FIF CIC...	17.658.344,91	0,00	17.068.496,28	0,00	-589.848,63	-3,33%	-1,36%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	152.856.750,87	0,00	0,00	152.255.815,09	-600.935,78	0,42%	-0,39%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	131.911.704,88	0,00	20.000.000,00	110.837.081,55	-1.074.623,33	-0,22%	-0,80%
Total Renda Fixa	1.342.504.339,98	208.835.909,38	286.335.658,72	1.273.684.621,12	8.680.030,48	0,56%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	54.500.960,47	0,00	0,00	61.162.189,61	6.661.229,14	-8,51%	12,22%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕ...	76.013.410,43	8.400.000,00	0,00	89.506.138,11	5.092.727,68	-12,37%	6,32%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	69.987.199,99	0,00	0,00	73.999.468,43	4.012.268,44	-17,61%	5,73%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIME...	118.038.465,20	0,00	0,00	121.719.951,39	3.681.486,19	3,42%	3,12%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	27.652.454,51	20.000.000,00	0,00	51.282.335,07	3.629.880,56	-13,78%	12,99%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕE...	39.047.858,44	0,00	0,00	42.105.855,05	3.057.996,61	-15,47%	7,83%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	49.856.820,63	0,00	0,00	52.878.764,98	3.021.944,35	-16,64%	6,06%
ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	0,00	40.933.107,37	0,00	43.326.787,71	2.393.680,34	28,14%	16,13%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	26.381.080,23	0,00	0,00	28.058.839,60	1.677.759,37	-12,17%	6,36%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITADA...	24.731.655,27	0,00	0,00	25.377.057,51	645.402,24	-1,48%	2,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMI...	10.483.515,61	0,00	0,00	11.094.954,27	611.438,66	-20,96%	5,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CICA...	19.180.359,77	0,00	18.465.636,27	0,00	-714.723,50	-3,73%	9,96%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	0,00	23.895.709,40	0,00	22.887.286,70	-1.008.422,70	14,63%	8,36%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4.105.500,00	0,00	109.200,00	2.513.100,00	-1.483.200,00	-46,30%	-38,79%
Total Renda Variável	519.979.280,55	93.228.816,77	18.574.836,27	625.912.728,43	31.279.467,38	5,26%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	0,00	18.178.868,15	0,00	18.307.845,73	128.977,58	10,50%	3,03%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	0,00	18.752.103,08	0,00	17.839.178,55	-912.924,53	6,19%	7,38%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	0,00	31.717.464,05	0,00	30.758.034,72	-959.429,33	20,10%	7,50%
Total Exterior	0,00	68.648.435,28	0,00	66.905.059,00	-1.743.376,28	-2,54%	

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.

