

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2021

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



Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 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	167.226.505,65	8,52%	1.007	1,61%	7º Ib
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREV...	D+1	Não há	110.707.732,51	5,64%	758	1,87%	7º Ib
19.303.795/0001-35	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	10.582.737,77	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	22.049.722,31	1,12%	92	5,11%	7º Ib
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	321.308.262,67	16,37%	984	2,02%	7º Ib
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	126.151.217,10	6,43%	80	8,18%	7º Ib
13.455.117/0001-01	SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC ...	D+1	Não há	159.649.078,33	8,13%	185	12,24%	7º Ib
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	137.121.598,97	6,99%	582	3,07%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	47.057.881,23	2,40%	687	1,13%	7º IV a
28.515.874/0001-09	BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC...	D+4	Não há	110.615.209,31	5,64%	197	7,35%	7º IV a
35.536.532/0001-22	CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA F...	D+1	Não há	24.680.440,12	1,26%	144	2,26%	7º IV a
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA C...	D+0	Não há	2.171,72	0,00%	16.062	0,00%	7º IV a
03.394.711/0001-86	BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+3	Não há	26.946.238,35	1,37%	51	7,98%	8º Ia
13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF A...	D+4	Não há	86.018.621,60	4,38%	115	12,42%	8º Ia
09.005.805/0001-00	BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	D+3	Não há	48.999.893,66	2,50%	59.091	2,61%	8º II a
07.882.792/0001-14	BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+3	Não há	14.834.347,25	0,76%	27.293	1,17%	8º II a
03.660.879/0001-96	BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+4	Não há	70.393.998,02	3,59%	182	9,59%	8º II a
30.068.224/0001-04	CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇ...	D+25	Não há	40.080.536,61	2,04%	2.359	3,69%	8º II a
30.068.169/0001-44	CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMIT...	D+15	Não há	14.175.083,84	0,72%	124	2,19%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	24.127.863,37	1,23%	454	0,78%	8º II a



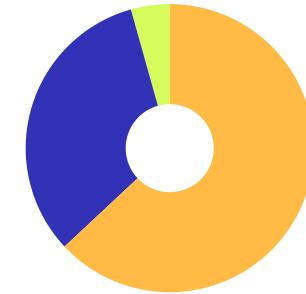
Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
24.571.992/0001-75	ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+24	Não há	59.280.610,02	3,02%	36.608	1,35%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	D+5	Não há	50.474.526,58	2,57%	56	4,37%	8º II a
32.665.845/0001-92	ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LI...	D+24	Não há	10.576.530,97	0,54%	18	2,77%	8º II a
02.436.763/0001-05	SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITA...	D+4	Não há	24.326.518,81	1,24%	3.364	6,79%	8º II a
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF M...	D+1	Não há	82.985.852,58	4,23%	17.306	3,03%	8º III
26.269.692/0001-61	ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+1	Não há	84.879.866,24	4,32%	1.262	3,65%	8º III
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.227.500,00	0,11%		1,52%	8º IV b
17.413.636/0001-68	BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	7.657.496,80	0,39%	98	0,35%	9º II
28.578.936/0001-13	BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	33.179.796,97	1,69%	90	2,86%	9º II
39.528.038/0001-77	CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	19.048.998,30	0,97%	1.106	10,19%	9º II
35.727.674/0001-77	ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	6.717.267,73	0,34%	202	0,35%	9º II
17.804.792/0001-50	SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	18.766.494,91	0,96%	13.001	0,92%	9º II
Total para cálculo dos limites da Resolução				1.962.850.600,30				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				12.112,40			Artigo 6º	
				PL Total	1.962.862.712,70			



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 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%	588.855.180,09
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	917.675.256,34	46,75%	12,00%	33,30%	90,00%	848.890.283,93
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	392.570.120,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	45,00%	319.477.301,35	16,28%	5,00%	23,00%	45,00%	563.805.468,79
Total Renda Fixa	100,00%	1.237.152.557,69	63,03%	17,00%	68,30%	185,00%	



- █ RENDA FIXA 1.237.152.557,69
- █ RENDA VARIÁVEL 640.327.987,90
- █ EXTERIOR 85.370.054,71

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!

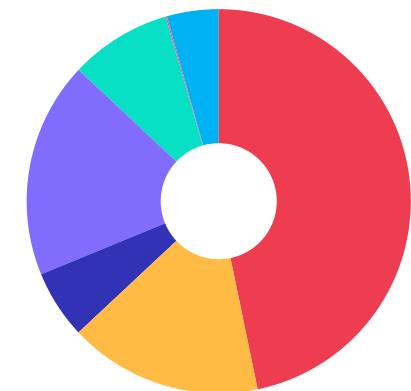




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2021)

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%	112.964.859,95	5,76%	1,00%	4,30%	35,00%	574.032.850,16
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	25,00%	357.269.909,13	18,20%	5,00%	16,00%	25,00%	133.442.740,95
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	167.865.718,82	8,55%	2,00%	7,90%	10,00%	28.419.341,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	2.227.500,00	0,11%	0,00%	0,30%	1,00%	17.401.006,00
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	640.327.987,90	32,62%	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%	85.370.054,71	4,35%	0,00%	1,50%	10,00%	110.915.005,32
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	10,00%	196.285.060,03
Total Exterior	10,00%	85.370.054,71	4,35%	0,00%	3,00%	20,00%	



■ 7º I b ■ 7º IV a ■ 8º I a ■ 8º II a
■ 8º III ■ 8º IV b ■ 9º II



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 (Julho / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM S.A	614.655.330,81	31,31	0,10
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	599.417.713,12	30,54	0,03
ITAU ASSET MANAGEMENT	277.028.961,09	14,11	0,02
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	202.742.092,05	10,33	0,05
BANCO BRADESCO	181.009.207,33	9,22	-
ITAU DTVM	61.051.057,55	3,11	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	26.946.238,35	1,37	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 Julho/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,18%	1,68%	0,38%	1,54%	5,88%	15,07%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,08%	1,50%	0,66%	1,32%	5,61%	14,05%	0,88%	2,05%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,03%	1,31%	0,59%	1,21%	5,06%	14,34%	-	-
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	1,19%	0,52%	1,09%	4,79%	13,79%	1,02%	2,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,01%	1,19%	0,53%	1,10%	4,80%	13,87%	1,00%	2,34%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,01%	1,20%	0,53%	1,11%	4,82%	13,88%	1,00%	2,33%
CDI (Benchmark)	0,36%	1,64%	0,94%	1,49%	2,44%	6,76%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	-0,11%	-0,50%	0,54%	-0,04%	1,16%	-	1,10%	3,64%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIA DO PREVID...	0,39%	1,72%	1,01%	1,55%	2,51%	6,34%	0,01%	0,35%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,18%	0,60%	0,47%	0,59%	0,65%	1,04%	0,00%	0,22%
IPCA (Benchmark)	0,96%	4,76%	2,34%	4,50%	8,99%	11,51%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	-0,61%	0,11%	-0,31%	0,02%	0,72%	-	1,80%	1,80%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,20%	-1,00%	0,56%	-0,42%	0,10%	7,17%	1,03%	3,42%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,78%	-0,06%	-0,54%	-0,09%	0,90%	10,67%	1,68%	2,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27%	1,51%	0,96%	1,43%	5,02%	13,90%	0,77%	2,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	1,97%	1,23%	1,82%	5,59%	13,55%	0,63%	1,97%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,91%	16,57%	1,55%	9,86%	33,20%	107,01%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	5,42%	14,23%	0,22%	7,98%	30,62%	103,08%	7,99%	17,47%

Ibovespa (Benchmark)	-3,94%	2,34%	2,44%	5,85%	18,35%	19,63%	-	-
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-4,87%	0,58%	2,94%	3,14%	16,66%	9,20%	8,64%	15,45%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	-4,45%	7,96%	-2,22%	11,50%	18,84%	30,73%	8,76%	19,88%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-2,78%	2,87%	2,04%	8,25%	23,66%	34,95%	8,28%	24,34%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-4,14%	-1,64%	2,73%	1,46%	9,91%	6,32%	8,87%	18,72%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-3,90%	2,18%	2,39%	5,69%	18,03%	19,10%	9,12%	22,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMITADA FIF CICAÇ...	-4,67%	0,89%	0,90%	2,56%	12,59%	27,40%	8,49%	17,38%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-3,97%	2,14%	2,34%	5,68%	18,00%	18,94%	9,08%	22,58%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-4,66%	14,33%	0,55%	18,56%	28,29%	36,95%	7,70%	20,14%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	-4,55%	1,24%	0,92%	3,66%	14,33%	19,32%	8,24%	19,80%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-4,81%	2,65%	1,63%	5,36%	11,43%	21,62%	7,73%	19,08%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	-3,08%	8,77%	4,14%	10,39%	23,74%	22,61%	6,67%	16,79%

IFIX (Benchmark)	2,51%	-1,60%	-1,29%	-1,92%	3,33%	6,19%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-11,36%	-45,74%	-21,84%	-34,93%	-57,08%	-31,06%	9,70%	35,30%

S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	2,27%	17,02%	5,12%	18,34%	34,37%	47,47%	-	-
--------------------------------------	-------	--------	-------	--------	--------	--------	---	---



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

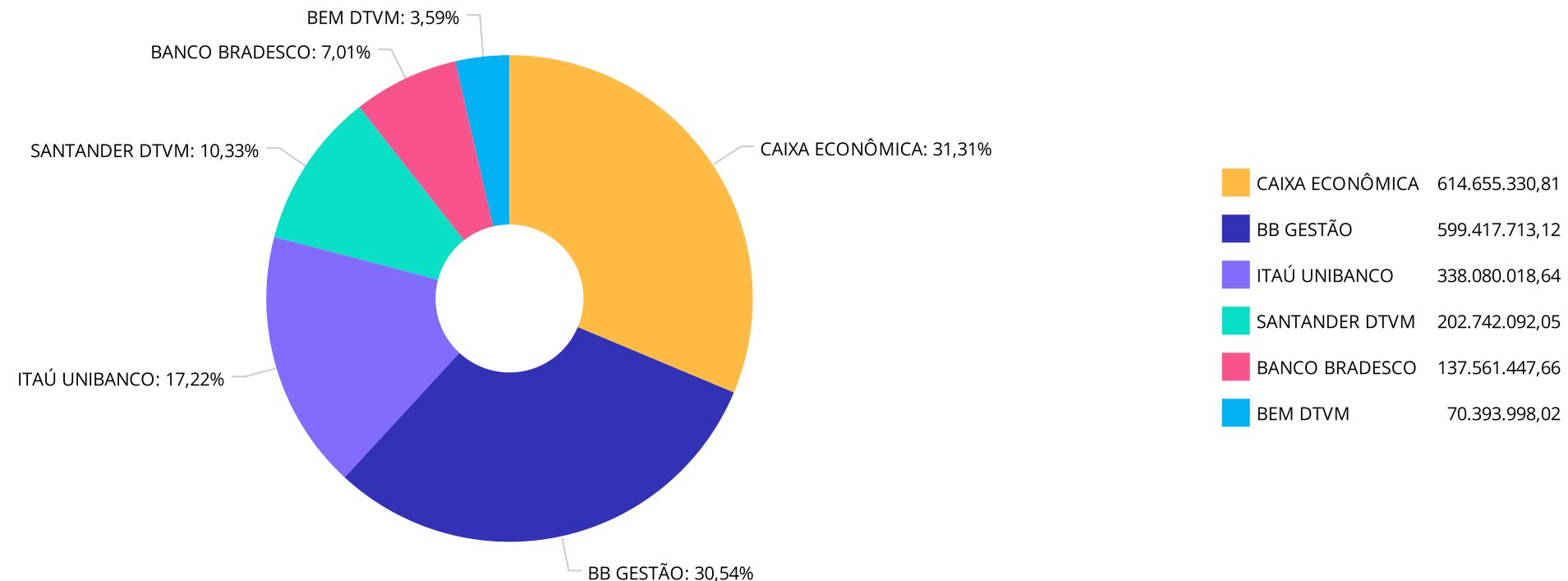
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICA NA RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	2,63%	19,20%	5,92%	19,27%	34,66%	45,15%	5,66%	14,42%
ITAU S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	2,58%	19,12%	5,74%	19,34%	35,33%	47,54%	5,67%	14,32%



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

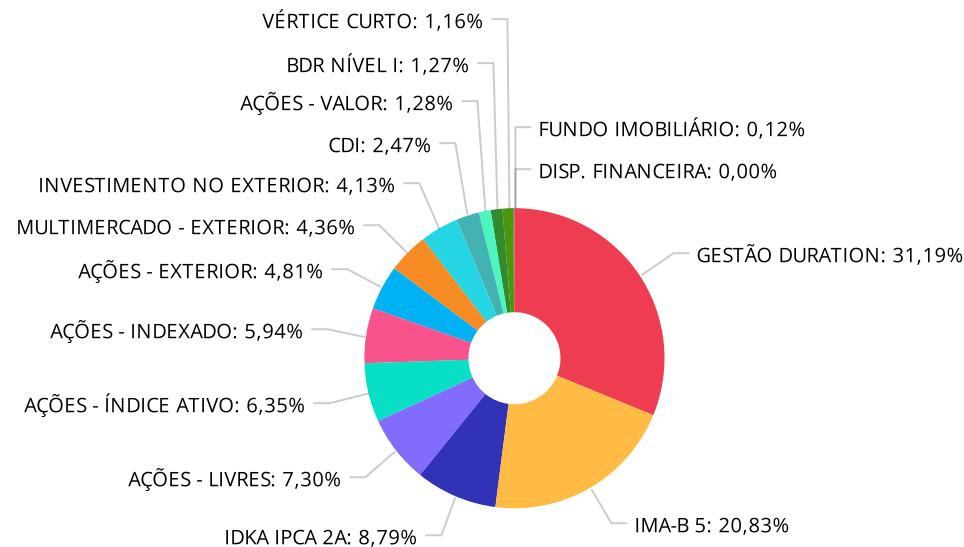
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	4,15%	12,45%	-1,01%	7,85%	31,07%	90,86%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP LIMITADA FI...	6,75%	16,53%	-0,22%	11,09%	38,64%	103,45%	8,15%	17,067%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR R...	5,20%	12,97%	-1,36%	6,94%	32,38%	107,65%	7,57%	14,642%
ITÁU MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP LIMITADA F...	-1,53%	1,74%	-6,69%	-6,24%	23,64%	-	9,42%	14,756%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP L...	4,05%	7,20%	-0,75%	3,06%	-	-	7,13%	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	7,87%	15,96%	0,91%	9,34%	41,19%	121,71%	8,36%	14,957%

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





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



GESTÃO DURATION	593.725.511,07	IMA-B 5	396.508.027,94	IDKA IPCA 2A	167.226.505,65	AÇÕES - LIVRES	138.947.108,69
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	120.868.524,60	AÇÕES - INDEXADO	112.964.859,95	AÇÕES - EXTERIOR	91.597.133,97	MULTIMERCADO - EXTERIOR	82.985.852,58
INVESTIMENTO NO EXTERIOR	78.652.786,98	CDI	47.060.052,95	AÇÕES - VALOR	24.326.518,81	BDR NÍVEL I	24.127.863,37
VÉRTICE CURTO	22.049.722,31	FUNDO IMOBILIÁRIO	2.227.500,00	DISP. FINANCEIRA	12.112,40		



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/07/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 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: 30/07/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 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: 30/07/2021

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

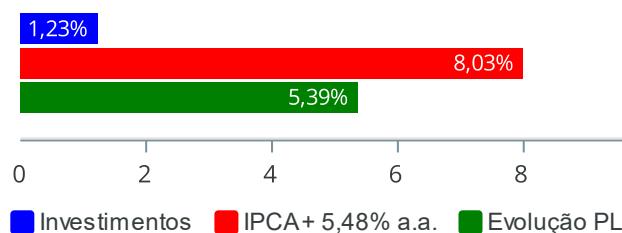
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------



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%
Julho	1.966.502.408,55	193.947.735,09	183.525.184,67	1.962.850.600,30	-14.074.358,67	24.141.762,91	-0,71%	1,23%	1,43%	8,03%	15,37%	3,56%

Investimentos x Meta de Rentabilidade x PL





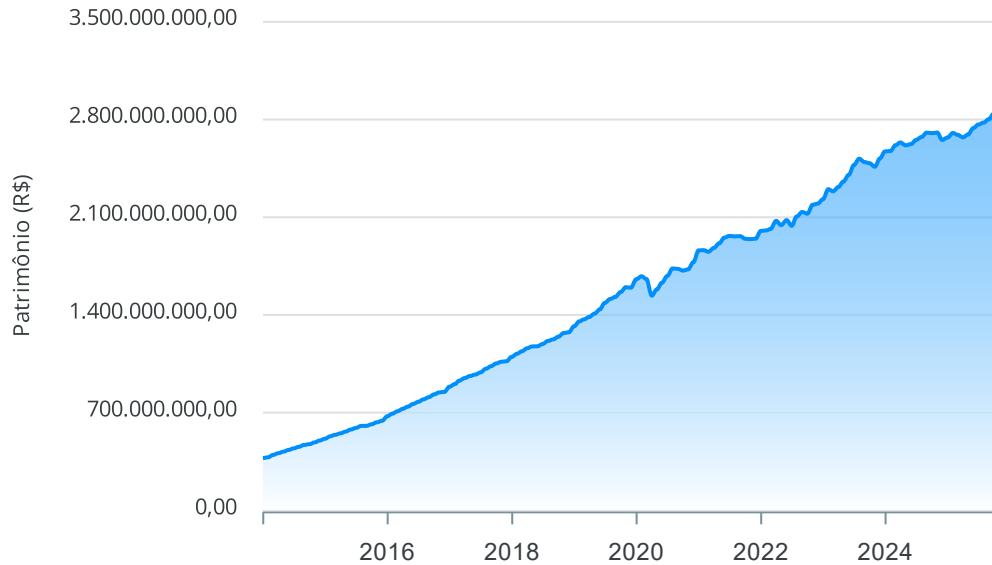
CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

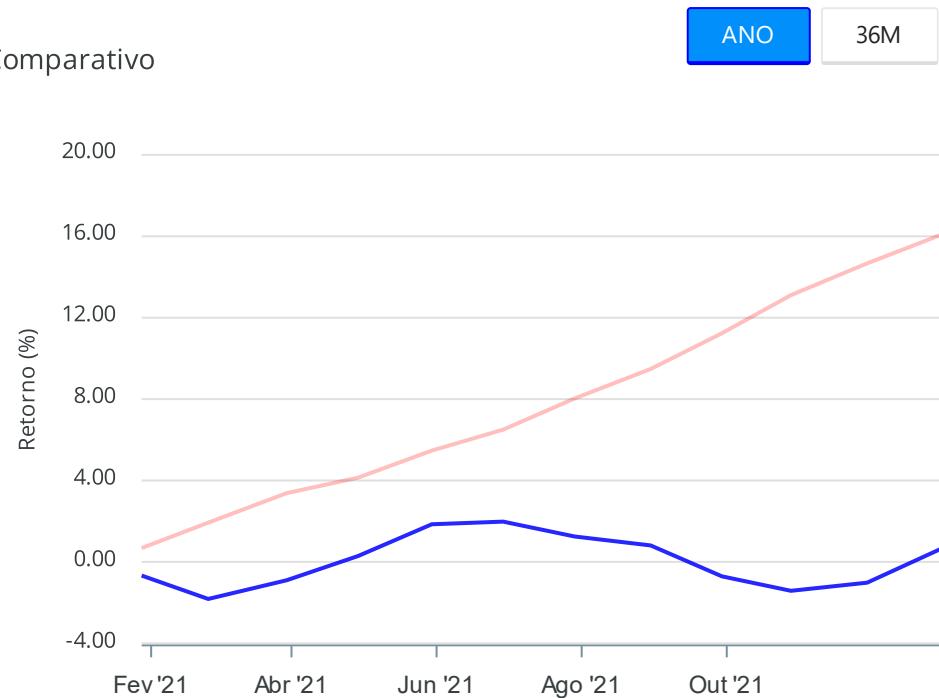
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/07/2021

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 Julho/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.540.381,03	0,00	0,00	10.582.737,77	42.356,74	0,40%	0,40%	0,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	21.990.410,58	0,00	0,00	22.049.722,31	59.311,73	0,27%	0,27%	0,77%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	50.864.407,73	27.446.000,00	31.412.195,79	47.057.881,23	159.669,29	0,20%	0,39%	0,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	167.087.055,43	0,00	0,00	167.226.505,65	139.450,22	0,08%	0,08%	0,88%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	2.163,86	32.360,72	32.360,72	2.171,72	7,86	0,02%	0,18%	0,00%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	110.682.736,88	0,00	0,00	110.707.732,51	24.995,63	0,02%	0,02%	1,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	126.135.952,17	0,00	0,00	126.151.217,10	15.264,93	0,01%	0,01%	1,00%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RE...	159.637.172,44	0,00	0,00	159.649.078,33	11.905,89	0,01%	0,01%	1,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	152.255.815,09	0,00	15.000.000,00	137.121.598,97	-134.216,12	-0,09%	-0,11%	1,10%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	110.837.081,55	0,00	0,00	110.615.209,31	-221.872,24	-0,20%	-0,20%	1,03%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	24.831.148,12	0,00	0,00	24.680.440,12	-150.708,00	-0,61%	-0,61%	1,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	338.820.296,24	10.779,00	15.000.000,00	321.308.262,67	-2.522.812,57	-0,74%	-0,78%	1,68%
Total Renda Fixa	1.273.684.621,12	27.489.139,72	61.444.556,51	1.237.152.557,69	-2.576.646,64	-0,20%		1,15%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/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	43.326.787,71	40.000.000,00	0,00	84.879.866,24	1.553.078,53	1,86%	2,58%	5,67%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF MUL...	0,00	82.069.849,16	0,00	82.985.852,58	916.003,42	1,12%	2,63%	5,66%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIME...	121.719.951,39	0,00	122.069.849,16	0,00	349.897,77	0,29%	-0,36%	1,59%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	15.000.000,00	0,00	14.834.347,25	-165.652,75	-1,10%	-2,78%	8,28%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	61.162.189,61	0,00	0,00	59.280.610,02	-1.881.579,59	-3,08%	-3,08%	6,67%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕ...	89.506.138,11	0,00	0,00	86.018.621,60	-3.487.516,51	-3,90%	-3,90%	9,12%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	28.058.839,60	0,00	0,00	26.946.238,35	-1.112.601,25	-3,97%	-3,97%	9,08%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITADA...	25.377.057,51	0,00	0,00	24.326.518,81	-1.050.538,70	-4,14%	-4,14%	8,87%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	51.282.335,07	0,00	0,00	48.999.893,66	-2.282.441,41	-4,45%	-4,45%	8,76%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	52.878.764,98	0,00	0,00	50.474.526,58	-2.404.238,40	-4,55%	-4,55%	8,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMI...	11.094.954,27	0,00	0,00	10.576.530,97	-518.423,30	-4,67%	-4,67%	8,49%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕE...	42.105.855,05	0,00	0,00	40.080.536,61	-2.025.318,44	-4,81%	-4,81%	7,73%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	73.999.468,43	0,00	0,00	70.393.998,02	-3.605.470,41	-4,87%	-4,87%	8,64%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITADA...	0,00	15.000.000,00	0,00	14.175.083,84	-824.916,16	-5,50%	-4,66%	7,70%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.513.100,00	0,00	10.779,00	2.227.500,00	-274.821,00	-10,94%	-11,36%	9,70%
Total Renda Variável	603.025.441,73	152.069.849,16	122.080.628,16	616.200.124,53	-16.814.538,20	-2,66%		7,63%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	30.758.034,72	0,00	0,00	33.179.796,97	2.421.762,25	7,87%	7,87%	8,36%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	22.887.286,70	0,00	0,00	24.127.863,37	1.240.576,67	5,42%	5,42%	7,99%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	17.839.178,55	0,00	0,00	18.766.494,91	927.316,36	5,20%	5,20%	7,57%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	18.307.845,73	0,00	0,00	19.048.998,30	741.152,57	4,05%	4,05%	7,13%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR R...	0,00	7.516.550,42	0,00	7.657.496,80	140.946,38	1,88%	6,75%	8,15%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	0,00	6.872.195,79	0,00	6.717.267,73	-154.928,06	-2,25%	-1,53%	9,42%
Total Exterior	89.792.345,70	14.388.746,21	0,00	109.497.918,08	5.316.826,17	5,10%		7,98%

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.

