

Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2021

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



Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 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	120.085.847,02	6,17%	1.026	1,28%	7º Ib
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREV...	D+1	Não há	113.211.656,70	5,82%	782	1,79%	7º Ib
19.303.795/0001-35	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	10.586.766,81	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	22.038.376,82	1,13%	92	5,11%	7º Ib
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	213.241.459,14	10,96%	952	1,63%	7º Ib
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	77.953.648,34	4,00%	76	5,46%	7º Ib
13.455.117/0001-01	SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC ...	D+1	Não há	112.310.710,82	5,77%	167	10,06%	7º Ib
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	86.999.394,90	4,47%	588	1,94%	7º IV a
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	26.483.000,00	1,36%	815	0,99%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	262.981.362,52	13,51%	839	3,87%	7º IV a
28.515.874/0001-09	BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC...	D+4	Não há	110.689.455,71	5,69%	194	9,29%	7º IV a
35.536.532/0001-22	CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA F...	D+1	Não há	24.670.390,10	1,27%	142	2,51%	7º IV a
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA C...	D+0	Não há	4.173,66	0,00%	16.057	0,00%	7º IV a
03.394.711/0001-86	BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+3	Não há	22.521.882,70	1,16%	52	7,81%	8º Ia
13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF A...	D+4	Não há	71.927.904,76	3,70%	113	12,84%	8º Ia
36.178.569/0001-99	BB BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+3	Não há	21.332.842,48	1,10%	47.856	0,82%	8º II a
09.005.805/0001-00	BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	D+3	Não há	38.880.815,64	2,00%	53.508	2,70%	8º II a
07.882.792/0001-14	BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+3	Não há	33.255.129,87	1,71%	27.327	2,55%	8º II a
03.660.879/0001-96	BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+4	Não há	56.529.854,16	2,90%	170	10,65%	8º II a
30.068.224/0001-04	CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇ...	D+25	Não há	32.299.597,35	1,66%	2.117	3,93%	8º II a



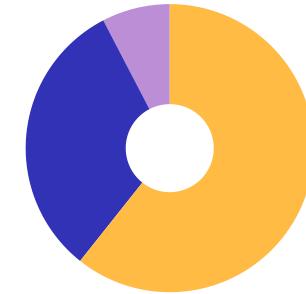
Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2021)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
30.068.169/0001-44	CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMIT...	D+15	Não há	32.594.594,50	1,67%	148	4,71%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	27.104.058,69	1,39%	518	0,72%	8º II a
24.571.992/0001-75	ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+24	Não há	49.384.614,31	2,54%	35.289	1,43%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	D+5	Não há	40.794.929,62	2,10%	51	4,91%	8º II a
32.665.845/0001-92	ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LI...	D+24	Não há	8.218.037,37	0,42%	18	2,90%	8º II a
32.666.326/0001-49	SAFRA AÇÕES LIVRE RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+33	Não há	960.416,52	0,05%	8.251	0,23%	8º II a
14.476.729/0001-43	SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB RESP LIMITADA FIF CIC ...	D+3	Não há	1.631.961,28	0,08%	429	0,60%	8º II a
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF M...	D+1	Não há	87.597.577,02	4,50%	19.656	2,46%	8º III
26.269.692/0001-61	ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+1	Não há	89.615.153,20	4,60%	1.265	3,88%	8º III
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.040.000,00	0,10%		1,49%	8º IV b
17.413.636/0001-68	BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	35.185.407,63	1,81%	92	1,44%	9º II
28.578.936/0001-13	BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVE...	D+5 du	Não há	37.550.615,47	1,93%	82	2,99%	9º II
39.528.038/0001-77	CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	25.471.704,69	1,31%	1.470	11,22%	9º II
35.727.674/0001-77	ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	6.915.918,04	0,36%	177	0,63%	9º II
17.804.792/0001-50	SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	36.820.001,12	1,89%	13.958	1,74%	9º II
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDRAÇÕES RESP LIMITA...	D+5	Não há	6.622.757,90	0,34%	1.250	0,17%	9º III
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.946.512.016,86					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				12.906,52			Artigo 6º	
				PL Total	1.946.524.923,38			



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Novembro / 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%	583.953.605,06
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	669.428.465,65	34,39%	12,00%	33,30%	90,00%	1.082.432.349,52
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	389.302.403,37
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	45,00%	511.827.776,89	26,29%	5,00%	23,00%	45,00%	364.102.630,70
Total Renda Fixa	100,00%	1.181.256.242,54	60,69%	17,00%	68,30%	185,00%	



- █ RENDA FIXA 1.181.256.242,54
- █ RENDA VARIÁVEL 616.689.369,47
- █ EXTERIOR 148.566.404,85

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!

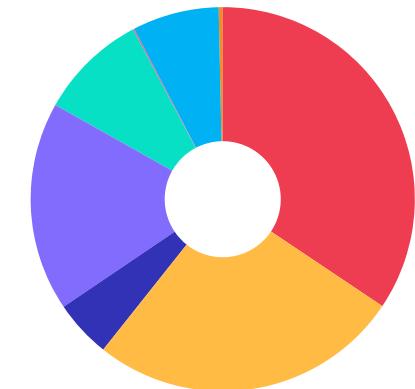




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Novembro / 2021)

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%	94.449.787,46	4,85%	1,00%	4,30%	35,00%	586.829.418,44
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	25,00%	342.986.851,79	17,62%	5,00%	16,00%	25,00%	143.641.152,43
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	177.212.730,22	9,10%	2,00%	7,90%	10,00%	17.438.471,47
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	2.040.000,00	0,10%	0,00%	0,30%	1,00%	17.425.120,17
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	616.689.369,47	31,68%	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%	141.943.646,95	7,29%	0,00%	1,50%	10,00%	52.707.554,74
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.622.757,90	0,34%	0,00%	1,50%	10,00%	188.028.443,79
Total Exterior	10,00%	148.566.404,85	7,63%	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 █ 9º III



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 (Novembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	808.591.215,86	41,54	0,04
CAIXA DTVM S.A	516.951.459,91	26,56	1,61
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	223.869.333,89	11,50	0,01
BANCO BRADESCO	167.219.309,87	8,59	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	149.130.711,94	7,66	0,04
ITAÚ DTVM	49.012.966,99	2,52	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	22.521.882,70	1,16	0,00
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	9.215.135,70	0,47	-

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 Novembro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	2,51%	4,11%	2,12%	1,88%	5,91%	14,44%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	2,43%	3,91%	2,19%	2,36%	5,50%	13,43%	1,11%	3,32%

IMA-B 5 (Benchmark)	2,50%	3,75%	2,25%	2,30%	5,65%	13,47%	-	-
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,47%	3,48%	2,16%	2,10%	5,35%	12,86%	1,23%	3,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	2,48%	3,55%	2,20%	2,20%	5,43%	13,02%	1,20%	3,51%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	2,48%	3,56%	2,20%	2,18%	5,43%	13,03%	1,19%	3,51%

CDI (Benchmark)	0,59%	3,60%	1,51%	2,62%	3,77%	6,87%	-	-
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVID...	0,63%	3,80%	1,59%	2,78%	4,06%	6,66%	0,03%	0,54%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,51%	2,58%	1,26%	2,04%	2,69%	4,56%	0,00%	0,50%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,41%	1,83%	0,98%	1,56%	1,84%	2,03%	0,00%	0,45%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	1,54%	-0,22%	0,74%	0,22%	2,47%	-	1,19%	3,65%

IPCA (Benchmark)	0,95%	9,26%	3,40%	5,86%	10,74%	15,51%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,91%	-0,93%	0,60%	-1,64%	0,38%	6,30%	0,40%	2,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,18%	4,16%	2,36%	2,92%	6,06%	13,28%	0,97%	3,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,03%	4,77%	2,43%	3,31%	6,46%	13,24%	0,90%	2,77%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	0,71%	-0,04%	1,27%	-0,65%	0,96%	-	0,17%	2,27%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,46%	-0,93%	0,57%	0,20%	1,53%	4,57%	1,14%	3,47%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2021

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

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,67%	31,40%	10,22%	19,05%	32,63%	99,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,89%	28,32%	9,66%	17,02%	29,21%	95,10%	9,33%	13,64%

Ibovespa (Benchmark)	-1,53%	-14,37%	-14,20%	-19,25%	-6,41%	-5,84%	-	-
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-1,53%	-14,63%	-14,27%	-19,39%	-6,69%	-6,37%	10,69%	18,25%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-0,52%	-0,16%	-10,02%	-17,47%	6,32%	13,57%	10,18%	18,77%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	-2,06%	-18,18%	-16,56%	-22,40%	-11,33%	-9,51%	11,33%	17,67%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-5,68%	-20,56%	-25,60%	-28,65%	-14,84%	-7,87%	18,12%	22,08%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-2,37%	-17,28%	-17,11%	-22,02%	-10,96%	-8,53%	11,44%	17,58%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-1,44%	-9,39%	-14,82%	-19,43%	-3,68%	-6,80%	9,97%	15,89%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-1,96%	-19,23%	-17,83%	-22,01%	-12,84%	-16,60%	11,74%	17,92%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	-3,26%	-14,33%	-18,31%	-24,38%	-7,49%	-9,26%	10,49%	19,91%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-1,49%	-9,49%	-10,16%	-15,14%	-0,06%	13,16%	9,51%	18,94%
SAFRA AÇÕES LIVRE RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-7,24%	-25,36%	-29,13%	-31,76%	-20,34%	-9,80%	20,27%	22,87%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-1,54%	-14,56%	-14,24%	-19,30%	-6,66%	-6,21%	10,66%	18,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-2,69%	-21,61%	-19,28%	-25,54%	-15,85%	-9,03%	13,00%	18,04%

IFIX (Benchmark)	-3,64%	-10,16%	-6,23%	-8,45%	-8,19%	-10,79%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-4,20%	-50,31%	-7,48%	-25,76%	-52,78%	-49,82%	7,55%	19,63%



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

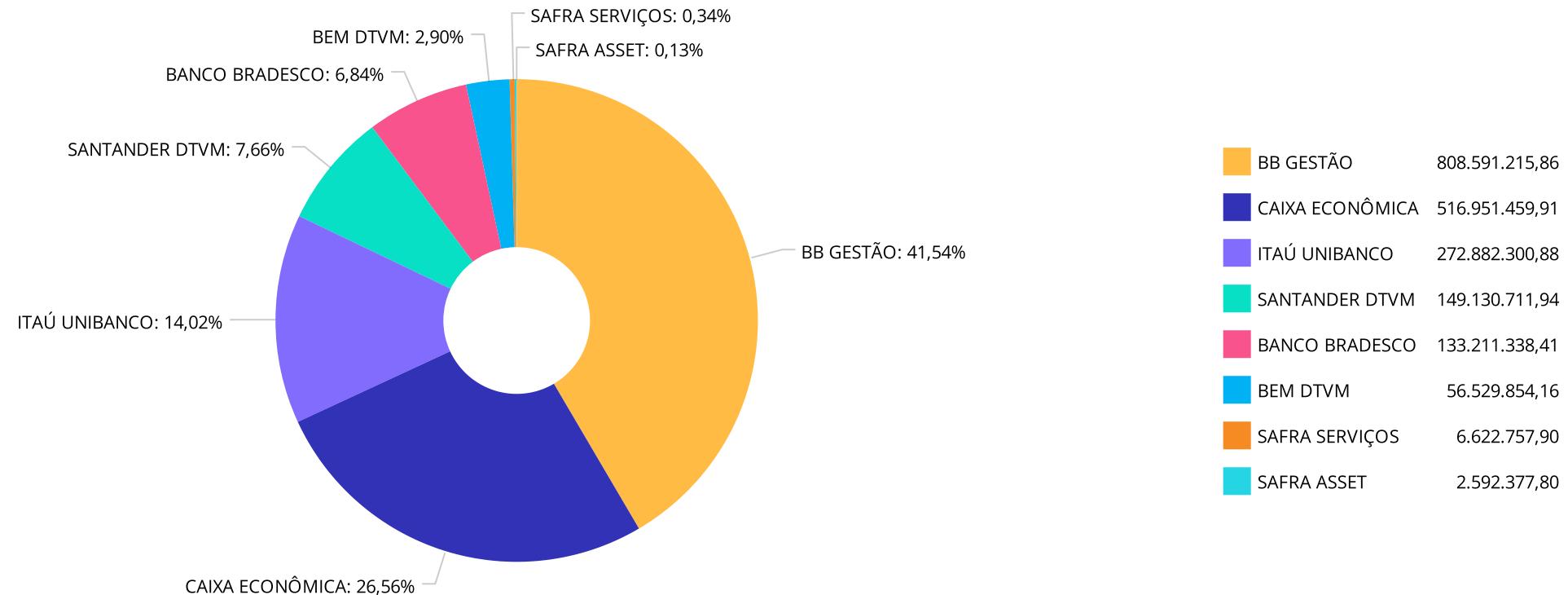
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	-0,83%	21,59%	0,98%	8,63%	26,10%	45,40%	-	-
BB BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-0,54%	23,77%	1,51%	10,22%	27,35%	-	7,09%	10,77%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	-0,49%	25,83%	2,15%	11,27%	29,78%	43,53%	7,09%	10,86%
ITAU S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-0,51%	25,77%	2,15%	11,20%	29,61%	45,79%	7,08%	10,93%



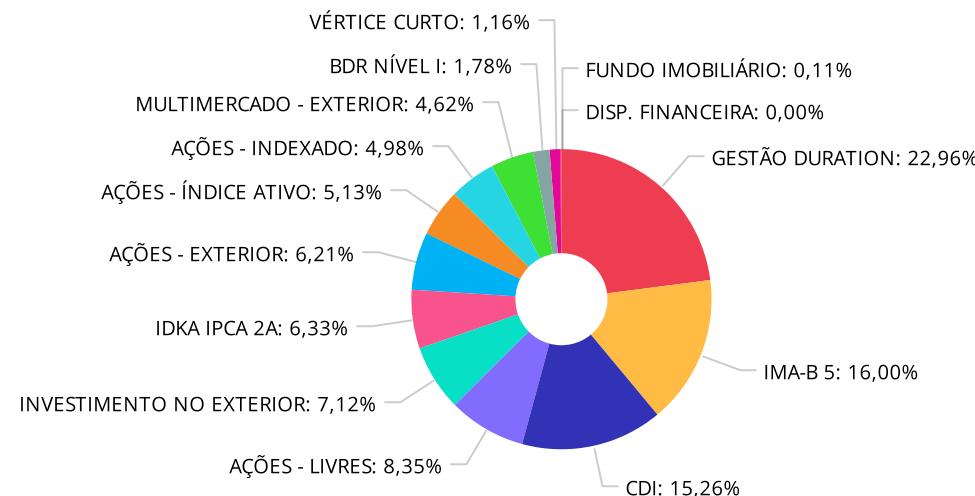
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,67%	31,40%	10,22%	19,05%	32,63%	99,29%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR AÇÕES RESP LIMITADA FIF AÇÕES	0,21%	29,45%	7,87%	16,90%	29,90%	84,71%	9,31%	11,355%
MSCI WORLD (Benchmark)	-2,70%	24,70%	7,89%	11,96%	26,57%	80,03%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR R...	-2,01%	22,57%	7,10%	10,92%	23,15%	93,41%	7,81%	12,284%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP LIMITADA F...	-3,88%	4,75%	1,95%	-2,13%	9,26%	-	10,18%	12,816%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP L...	-1,80%	13,30%	4,84%	10,20%	14,95%	-	7,44%	11,347%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	1,84%	31,24%	10,03%	17,27%	33,49%	110,91%	9,38%	12,864%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP LIMITADA FI...	-0,80%	27,26%	8,23%	11,21%	28,65%	89,66%	8,10%	12,562%

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



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



■ GESTÃO DURATION	435.600.699,85	■ IMA-B 5	303.476.015,86	■ CDI	289.468.536,18	■ AÇÕES - LIVRES	158.344.351,20
■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR	35.027.728,91	■ IDKA IPCA 2A	120.085.847,02	■ AÇÕES - EXTERIOR	117.863.913,72	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	97.324.783,78
■ AÇÕES - INDEXADO	94.449.787,46	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	87.597.577,02	■ BDR NÍVEL I	33.726.816,59	■ VÉRTICE CURTO	22.038.376,82
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.040.000,00	■ Disp. Financeira	12.906,52				



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Novembro / 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: 30/11/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Novembro / 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: 30/11/2021

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

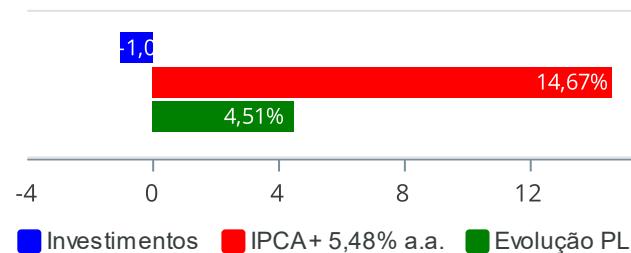
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------



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%
Agosto	1.962.850.600,30	64.080.791,79	53.465.794,37	1.964.849.412,77	-8.616.184,95	15.525.577,96	-0,44%	0,79%	1,34%	9,48%	8,36%	3,40%
Setembro	1.964.849.412,77	289.158.060,42	278.117.605,31	1.946.071.733,32	-29.818.134,56	-14.292.556,60	-1,51%	-0,73%	1,61%	11,24%	-6,49%	3,82%
Outubro	1.946.071.733,32	102.747.607,44	92.166.382,78	1.942.634.945,14	-14.018.012,84	-28.310.569,44	-0,72%	-1,44%	1,68%	13,11%	-10,99%	4,62%
Novembro	1.942.634.945,14	43.425.519,09	47.435.585,21	1.946.512.016,86	7.887.137,84	-20.423.431,60	0,40%	-1,05%	1,38%	14,67%	-7,15%	4,10%

Investimentos x Meta de Rentabilidade x PL





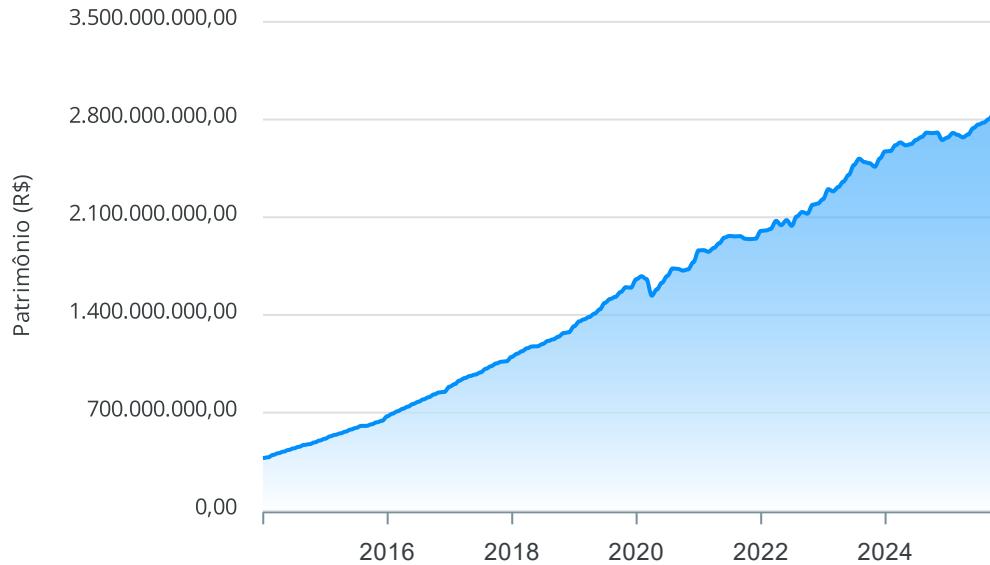
CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

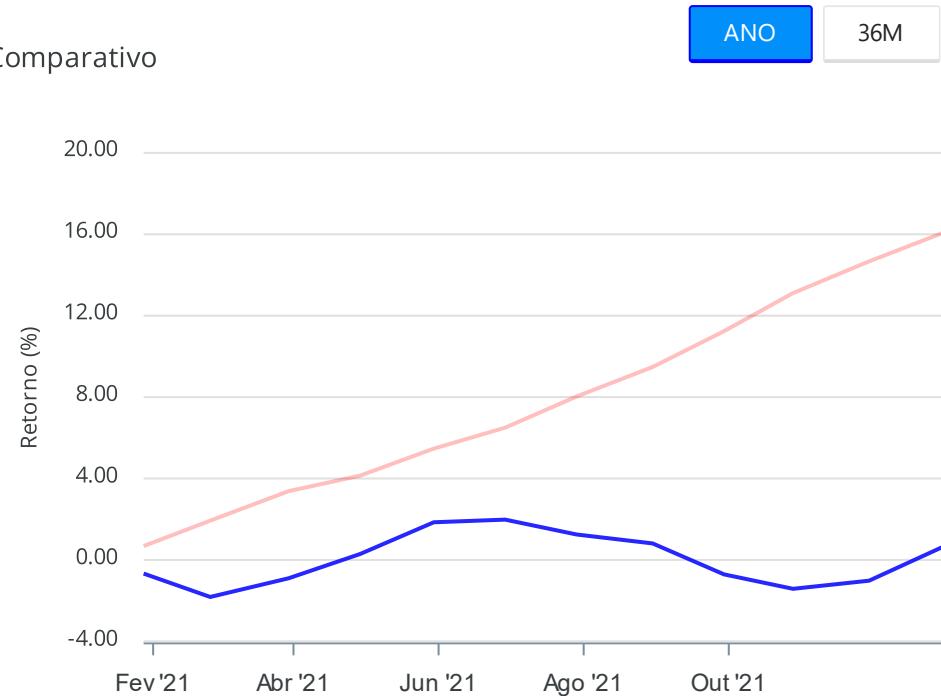
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2021

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 Novembro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAU INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	76.064.085,71	0,00	0,00	77.953.648,34	1.889.562,63	2,48%	2,48%	1,20%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RE...	109.588.456,23	0,00	0,00	112.310.710,82	2.722.254,59	2,48%	2,48%	1,19%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	110.479.272,42	0,00	0,00	113.211.656,70	2.732.384,28	2,47%	2,47%	1,23%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	117.237.925,42	0,00	0,00	120.085.847,02	2.847.921,60	2,43%	2,43%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	21.568.567,83	0,00	0,00	22.038.376,82	469.808,99	2,18%	2,18%	0,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.376.426,90	0,00	0,00	10.586.766,81	210.339,91	2,03%	2,03%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	85.678.846,39	0,00	0,00	86.999.394,90	1.320.548,51	1,54%	1,54%	1,19%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	109.102.235,14	0,00	0,00	110.689.455,71	1.587.220,57	1,45%	1,45%	1,14%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	211.326.970,73	0,00	0,00	213.241.459,14	1.914.488,41	0,91%	0,91%	0,40%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	24.482.194,38	13.500,00	0,00	24.670.390,10	174.695,72	0,71%	0,71%	0,17%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	301.910.358,30	6.591.927,45	47.388.877,49	262.981.362,52	1.867.954,26	0,61%	0,63%	0,03%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	2.201,18	35.164,19	33.207,72	4.173,66	16,01	0,04%	0,40%	0,00%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	0,00	26.483.000,00	0,00	26.483.000,00	0,00	0,00%	0,51%	0,00%
Total Renda Fixa	1.177.817.540,63	33.123.591,64	47.422.085,21	1.181.256.242,54	17.737.195,48	1,51%		0,72%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICA NA RESP LIMITADA FIF MUL...	88.028.895,76	0,00	0,00	87.597.577,02	-431.318,74	-0,49%	-0,49%	7,09%
ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	90.073.668,74	0,00	0,00	89.615.153,20	-458.515,54	-0,51%	-0,51%	7,08%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITADA...	32.766.082,74	0,00	0,00	32.594.594,50	-171.488,24	-0,52%	-0,52%	10,18%
BB BOLSA AMERICA NA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	21.448.834,46	0,00	0,00	21.332.842,48	-115.991,98	-0,54%	-0,54%	7,09%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	50.108.249,40	0,00	0,00	49.384.614,31	-723.635,09	-1,44%	-1,44%	9,97%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	33.758.304,62	0,00	0,00	33.255.129,87	-503.174,75	-1,49%	-1,49%	9,51%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	22.871.573,22	0,00	0,00	22.521.882,70	-349.690,52	-1,53%	-1,53%	10,69%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕ...	73.050.676,27	0,00	0,00	71.927.904,76	-1.122.771,51	-1,54%	-1,54%	10,66%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	57.660.952,88	0,00	0,00	56.529.854,16	-1.131.098,72	-1,96%	-1,96%	11,74%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	41.653.392,27	0,00	0,00	40.794.929,62	-858.462,65	-2,06%	-2,06%	11,33%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕE...	33.083.709,45	0,00	0,00	32.299.597,35	-784.112,10	-2,37%	-2,37%	11,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMI...	8.445.582,46	0,00	0,00	8.218.037,37	-227.545,09	-2,69%	-2,69%	13,00%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	40.189.821,57	0,00	0,00	38.880.815,64	-1.309.005,93	-3,26%	-3,26%	10,49%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.129.400,00	0,00	13.500,00	2.040.000,00	-75.900,00	-3,56%	-3,59%	7,55%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB RESP LIMITADA FIF CICAÇ...	1.730.314,21	0,00	0,00	1.631.961,28	-98.352,93	-5,68%	-5,68%	18,12%
SAFRA AÇÕES LIVRE RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	1.035.392,96	0,00	0,00	960.416,52	-74.976,44	-7,24%	-7,24%	20,27%
Total Renda Variável	598.034.851,01	0,00	13.500,00	589.585.310,78	-8.436.040,23	-1,41%		9,55%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Novembro / 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...	36.872.403,35	0,00	0,00	37.550.615,47	678.212,12	1,84%	1,84%	9,38%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDR AÇÕES RESP LIMITADA...	6.608.695,47	0,00	0,00	6.622.757,90	14.062,43	0,21%	0,21%	9,31%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	27.348.020,46	0,00	0,00	27.104.058,69	-243.961,77	-0,89%	-0,89%	9,33%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR R...	31.025.550,19	4.485.000,00	0,00	35.185.407,63	-325.142,56	-0,92%	-0,80%	8,10%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	25.939.495,82	0,00	0,00	25.471.704,69	-467.791,13	-1,80%	-1,80%	7,44%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	31.793.412,15	5.816.927,45	0,00	36.820.001,12	-790.338,48	-2,10%	-2,01%	7,81%
ITAU MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	7.194.976,06	0,00	0,00	6.915.918,04	-279.058,02	-3,88%	-3,88%	10,18%
Total Exterior	166.782.553,50	10.301.927,45	0,00	175.670.463,54	-1.414.017,41	-0,80%		8,54%

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.

