

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021

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



Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
	TÍTULOS PÚBLICOS			200.966.116,61	10,04%		0,00%	7º Ia
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	120.933.895,68	6,04%	1.035	1,30%	7º Ib
03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREV...	D+1	Não há	114.074.575,08	5,70%	788	1,77%	7º Ib
19.303.795/0001-35	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	10.657.025,45	0,53%	140	1,81%	7º Ib
20.734.931/0001-20	BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	15/08/2024	22.193.771,18	1,11%	92	5,11%	7º Ib
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	104.339.231,80	5,21%	945	0,83%	7º Ib
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	85.208.936,08	4,26%	1.060	0,77%	7º Ib
32.922.086/0001-04	ITAÚ IDKA 2 IPCA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	D+1	Não há	25.062.932,65	1,25%	46	10,16%	7º Ib
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	78.556.106,01	3,92%	80	5,38%	7º Ib
13.455.117/0001-01	SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC ...	D+1	Não há	113.171.444,33	5,65%	168	9,88%	7º Ib
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	87.661.576,57	4,38%	590	1,94%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	142.304.558,27	7,11%	854	1,97%	7º IV a
28.515.874/0001-09	BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC...	D+4	Não há	61.516.880,09	3,07%	193	5,34%	7º IV a
35.536.532/0001-22	CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA F...	D+1	Não há	24.867.463,41	1,24%	141	2,53%	7º IV a
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA C...	D+0	Não há	2.233,16	0,00%	15.848	0,00%	7º IV a
03.394.711/0001-86	BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+3	Não há	23.170.497,10	1,16%	53	7,69%	8º Ia
13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF A...	D+4	Não há	73.987.963,50	3,70%	112	12,97%	8º Ia
36.178.569/0001-99	BB BOLSA AMERICA NA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+3	Não há	44.384.042,00	2,22%	48.889	1,57%	8º II a
09.005.805/0001-00	BB RETORNO TOTAL FICA AÇÕES	D+3	Não há	39.465.395,29	1,97%	52.320	2,83%	8º II a
07.882.792/0001-14	BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+3	Não há	34.440.076,53	1,72%	27.197	2,43%	8º II a



Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
03.660.879/0001-96	BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+4	Não há	57.662.880,93	2,88%	166	10,77%	8º II a
30.068.224/0001-04	CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇ...	D+25	Não há	33.007.037,79	1,65%	2.016	3,99%	8º II a
30.068.169/0001-44	CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMIT...	D+15	Não há	34.478.893,77	1,72%	150	4,71%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	27.565.556,79	1,38%	529	0,71%	8º II a
24.571.992/0001-75	ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+24	Não há	49.864.145,02	2,49%	34.166	1,51%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	D+5	Não há	41.561.682,01	2,08%	50	4,94%	8º II a
32.665.845/0001-92	ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LI...	D+24	Não há	8.284.599,57	0,41%	17	3,05%	8º II a
32.666.326/0001-49	SAFRA AÇÕES LIVRE RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+33	Não há	992.923,30	0,05%	7.818	0,24%	8º II a
14.476.729/0001-43	SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB RESP LIMITADA FIF CIC ...	D+3	Não há	1.672.243,17	0,08%	412	0,62%	8º II a
30.036.235/0001-02	CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF M...	D+1	Não há	92.469.325,94	4,62%	19.787	2,45%	8º III
26.269.692/0001-61	ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	D+1	Não há	94.584.244,55	4,72%	1.259	3,98%	8º III
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.047.200,00	0,10%		1,47%	8º IV b
17.413.636/0001-68	BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	36.591.278,74	1,83%	92	1,45%	9º II
28.578.936/0001-13	BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVE...	D+5 du	Não há	38.018.308,04	1,90%	82	3,00%	9º II
39.528.038/0001-77	CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	25.101.155,64	1,25%	1.486	11,39%	9º II
35.727.674/0001-77	ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	7.040.395,56	0,35%	170	0,94%	9º II
17.804.792/0001-50	SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	37.146.522,35	1,86%	13.960	1,70%	9º II
19.436.818/0001-80	SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDRAÇÕES RESP LIMITA...	D+5	Não há	6.851.288,42	0,34%	1.229	0,17%	9º III



CRÉDITO
& MERCADO

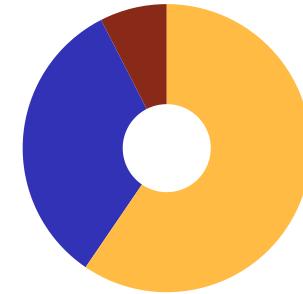
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
			Total para cálculo dos limites da Resolução	2.001.904.402,38				
			DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	8.485,06			Artigo 6º	
			PL Total	2.001.912.887,44				



Enquadramento e Política de Investimento (RENDAS FIXAS) - base (Dezembro / 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%	200.966.116,61	10,04%	0,00%	10,00%	30,00%	399.605.204,10
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	674.197.918,26	33,68%	12,00%	33,30%	90,00%	1.127.516.043,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	400.380.880,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	45,00%	316.352.711,50	15,80%	5,00%	23,00%	45,00%	584.504.269,57
Total Renda Fixa	100,00%	1.191.516.746,37	59,52%	17,00%	68,30%	185,00%	



- █ RENDA FIXA 1.191.516.746,37
- █ RENDA VARIÁVEL 659.638.707,26
- █ EXTERIOR 150.748.948,75

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!



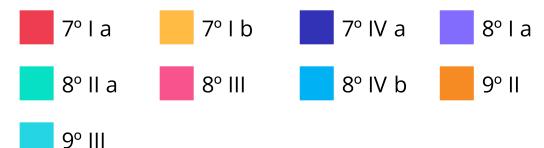
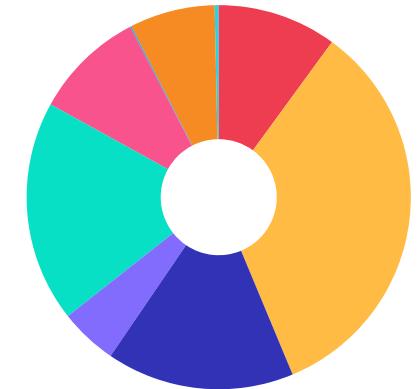


CRÉDITO
& MERCADO

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 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%	97.158.460,60	4,85%	1,00%	4,30%	35,00%	603.508.080,23
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	25,00%	373.379.476,17	18,65%	5,00%	16,00%	25,00%	127.096.624,43
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	187.053.570,49	9,34%	2,00%	7,90%	10,00%	13.136.869,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	2.047.200,00	0,10%	0,00%	0,30%	1,00%	17.971.844,02
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	659.638.707,26	32,95%	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%	143.897.660,33	7,19%	0,00%	1,50%	10,00%	56.292.779,91
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.851.288,42	0,34%	0,00%	1,50%	10,00%	193.339.151,82
Total Exterior	10,00%	150.748.948,75	7,53%	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 (Dezembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	690.724.502,83	34,50	0,03
CAIXA DTVM S.A	503.074.997,88	25,13	1,59
ITÁU ASSET MANAGEMENT	255.107.823,79	12,74	0,02
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...)	200.966.116,61	10,04	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	150.317.966,68	7,51	0,04
BANCO BRADESCO	119.179.761,02	5,95	-
ITAÚ DTVM	49.846.281,58	2,49	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	23.170.497,10	1,16	0,00
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	9.516.454,89	0,48	-

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 Dezembro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,83%	4,97%	1,84%	3,05%	4,97%	14,02%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,71%	4,65%	1,86%	3,18%	4,65%	12,93%	1,05%	3,12%
ITAU IDKA 2 IPCA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,72%	4,61%	1,81%	3,03%	4,61%	13,05%	1,09%	3,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	0,72%	4,66%	1,82%	3,05%	4,66%	13,07%	1,10%	3,26%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,79%	4,57%	2,03%	3,24%	4,57%	12,97%	-	-
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	4,27%	1,94%	3,06%	4,27%	12,38%	1,04%	3,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,77%	4,35%	1,99%	3,14%	4,35%	12,52%	1,02%	3,21%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,77%	4,35%	1,98%	3,12%	4,35%	12,52%	1,02%	3,21%

CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	0,76%	0,54%	1,40%	0,93%	0,54%	-	0,79%	2,56%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVID...	0,80%	4,62%	1,93%	3,26%	4,62%	7,13%	0,03%	0,70%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,55%	2,39%	1,27%	1,96%	2,39%	2,54%	0,02%	0,57%

IPCA (Benchmark)	0,73%	10,06%	2,96%	6,07%	10,06%	15,03%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,78%	-0,16%	1,52%	0,65%	-0,16%	4,50%	0,70%	2,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,83%	-0,11%	1,07%	-0,82%	-0,11%	6,55%	0,23%	2,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,89%	1,92%	3,61%	4,89%	12,74%	0,69%	2,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	5,47%	1,89%	3,84%	5,47%	12,76%	0,57%	2,52%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2021

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA LP	0,74%	0,70%	1,52%	-0,02%	0,70%	-	0,06%	2,17%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2021

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70%	30,51%	11,81%	20,44%	30,51%	101,98%	8,95%	13,55%

Ibovespa (Benchmark)	2,85%	-11,93%	-5,55%	-17,33%	-11,93%	-9,36%	-	-
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	2,00%	-17,61%	-8,61%	-22,08%	-17,61%	-20,64%	10,24%	15,52%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	1,50%	-13,05%	-10,15%	-23,04%	-13,05%	-16,06%	8,94%	17,84%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	3,56%	-6,27%	-3,10%	-11,41%	-6,27%	6,89%	9,21%	15,87%
SAFRA AÇÕES LIVRE RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	3,39%	-22,84%	-19,53%	-31,61%	-22,84%	-12,19%	14,07%	21,75%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	2,86%	-12,11%	-5,59%	-17,34%	-12,11%	-9,70%	8,95%	15,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMITADA FIF CICAÇ...	0,81%	-20,98%	-12,77%	-25,33%	-20,98%	-15,30%	7,14%	15,65%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	2,88%	-12,17%	-5,55%	-17,42%	-12,17%	-9,90%	9,08%	15,43%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	5,78%	5,61%	-1,11%	-11,93%	5,61%	8,48%	8,04%	18,54%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	1,88%	-16,64%	-8,99%	-21,40%	-16,64%	-14,85%	7,56%	14,98%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	2,47%	-18,60%	-16,83%	-29,19%	-18,60%	-12,24%	12,37%	20,59%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	2,19%	-15,47%	-10,34%	-21,61%	-15,47%	-14,48%	9,07%	15,42%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	0,97%	-8,51%	-7,99%	-18,47%	-8,51%	-12,97%	6,70%	14,33%

IFIX (Benchmark)	8,78%	-2,28%	3,28%	1,81%	-2,28%	-12,28%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,35%	-50,14%	-5,25%	-18,54%	-50,14%	-54,20%	8,41%	20,64%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2021

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	4,36%	26,89%	10,65%	10,91%	26,89%	47,52%	-	-
BB BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	5,28%	30,30%	12,24%	12,99%	30,30%	-	7,90%	11,22%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF MULTIMERCADO LP	5,56%	32,83%	13,07%	14,36%	32,83%	47,69%	7,98%	11,33%
ITAU S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CICAÇÕES	5,55%	32,74%	13,02%	14,31%	32,74%	49,91%	7,93%	11,41%



CRÉDITO
& MERCADO

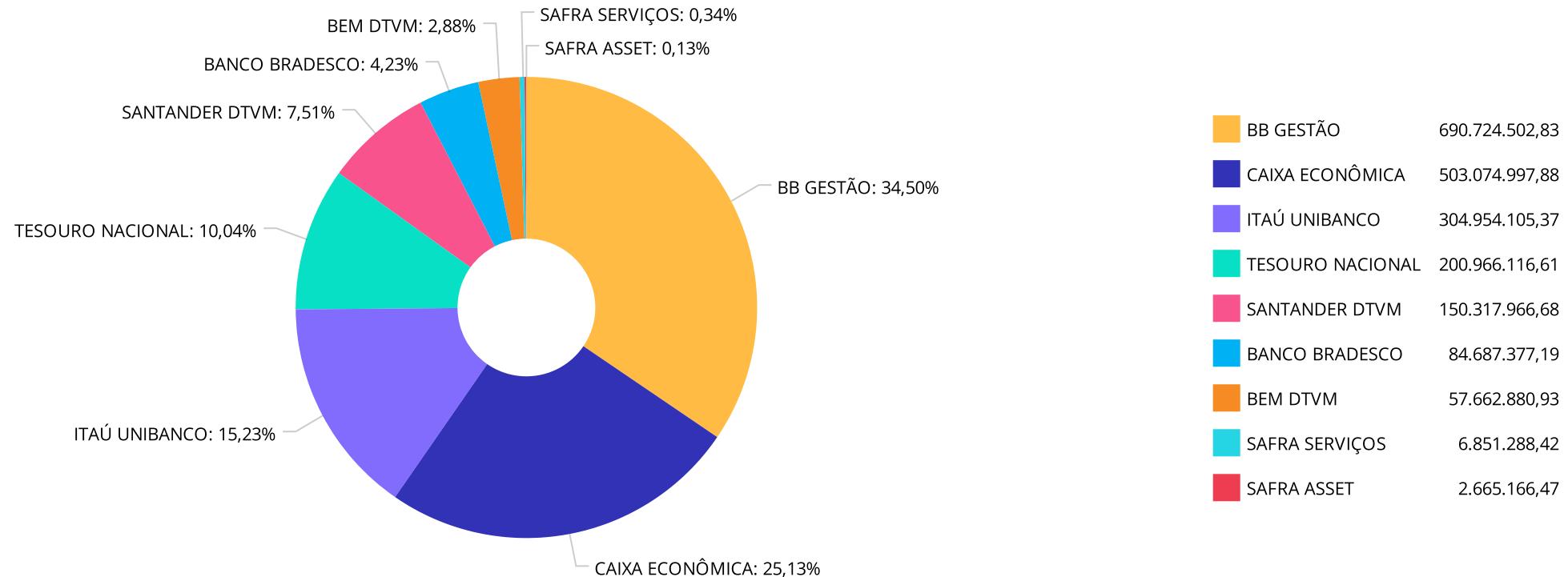
FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2021

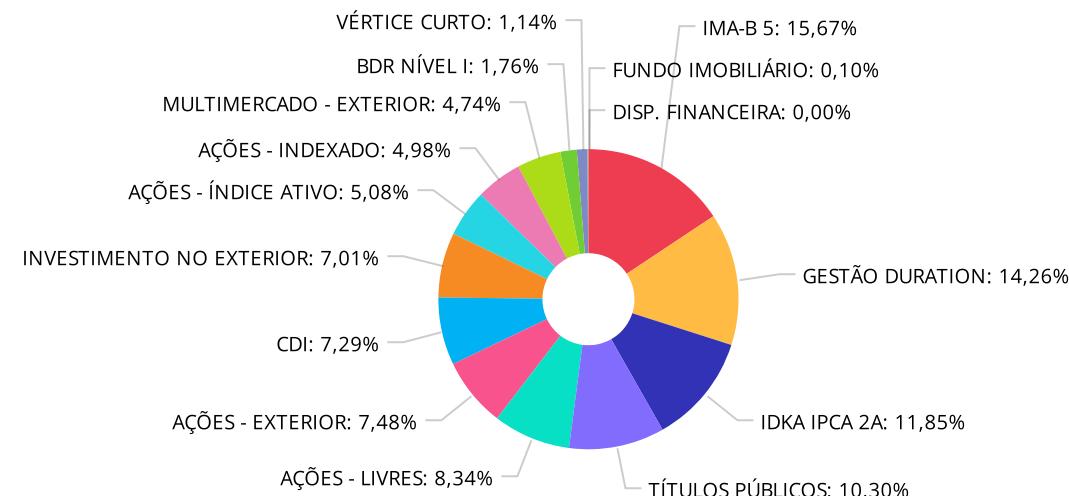
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDRAÇÕES RESP LIMITADA FIF AÇÕES	3,45%	33,92%	12,50%	21,19%	33,92%	93,45%	8,58%	11,211%
MSCI WORLD (Benchmark)	3,46%	29,01%	10,28%	19,49%	29,01%	89,71%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP LIMITADA FI...	4,00%	32,35%	10,14%	21,25%	32,35%	101,00%	7,32%	12,623%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR R...	0,89%	23,65%	6,63%	15,15%	23,65%	99,50%	6,65%	12,242%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP LIMITADA F...	1,80%	6,63%	1,40%	3,20%	6,63%	-	8,51%	12,304%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR RESP L...	-1,45%	11,65%	4,08%	8,37%	11,65%	-	7,16%	11,650%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	1,25%	32,87%	11,07%	23,60%	32,87%	119,47%	7,03%	12,904%

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



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



IMA-B 5	305.802.125,42	GESTÃO DURATION	278.385.151,87	IDKA IPCA 2A	231.205.764,41	TÍTULOS PÚBLICOS	200.966.116,61
AÇÕES - LIVRES	162.739.919,15	AÇÕES - EXTERIOR	146.008.682,11	CDI	142.306.791,43	INVESTIMENTO NO EXTERIOR	36.857.264,77
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	99.224.562,94	AÇÕES - INDEXADO	97.158.460,60	MULTIMERCADO - EXTERIOR	92.469.325,94	BDR NÍVEL I	34.416.845,21
VÉRTICE CURTO	22.193.771,18	FUNDO IMOBILIÁRIO	2.047.200,00	DISP. FINANCEIRA	8.485,06		



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2021

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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	17/12/2021	13.149	3.802,324181	3.820,721242	49.996.760,66	50.238.663,61	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	17/12/2021	39.450	3.779,800361	3.820,721242	149.113.124,24	150.727.453,00	Curva



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2021

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 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: 31/12/2021

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

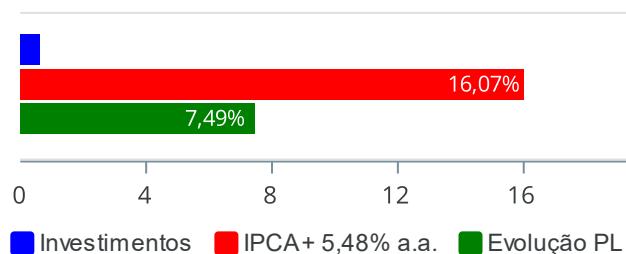
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------



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%
Dezembro	1.946.512.016,86	685.144.327,51	662.811.579,72	2.001.904.402,38	33.059.637,73	12.636.206,13	1,68%	0,61%	1,22%	16,07%	3,81%	4,09%

Investimentos x Meta de Rentabilidade x PL





CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

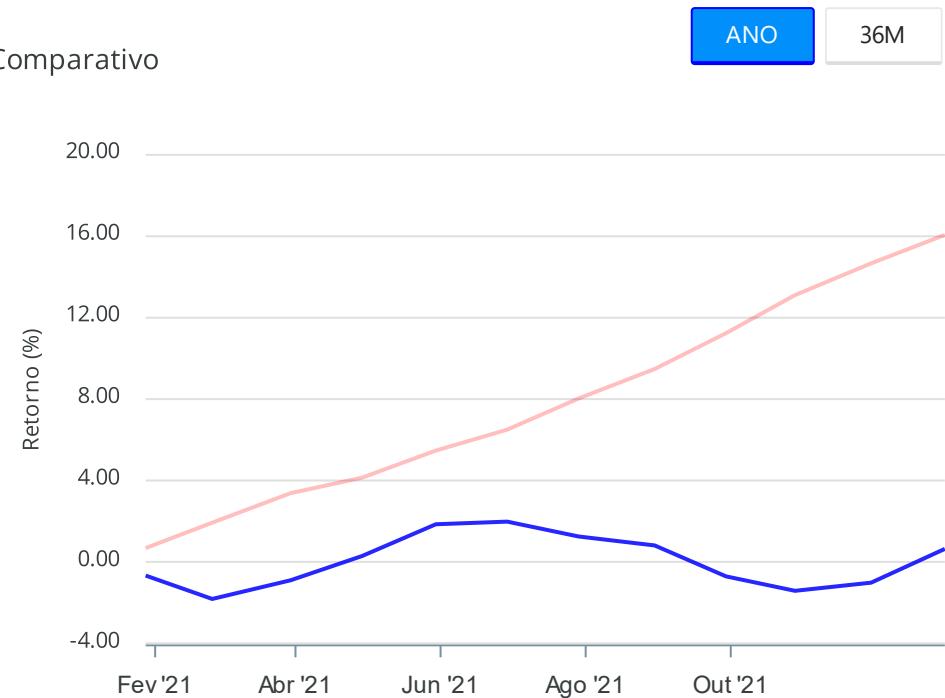
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2021

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 SMLL IDIV



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITÁÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	77.953.648,34	0,00	0,00	78.556.106,01	602.457,67	0,77%	0,77%	1,02%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RE...	112.310.710,82	0,00	0,00	113.171.444,33	860.733,51	0,77%	0,77%	1,02%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	113.211.656,70	0,00	0,00	114.074.575,08	862.918,38	0,76%	0,76%	1,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	86.999.394,90	0,00	0,00	87.661.576,57	662.181,67	0,76%	0,76%	0,79%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	110.689.455,71	0,00	50.000.000,00	61.516.880,09	827.424,38	0,75%	0,78%	0,70%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	24.670.390,10	13.500,00	0,00	24.867.463,41	183.573,31	0,74%	0,74%	0,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	120.085.847,02	0,00	0,00	120.933.895,68	848.048,66	0,71%	0,71%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	22.038.376,82	0,00	0,00	22.193.771,18	155.394,36	0,71%	0,71%	0,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.586.766,81	0,00	0,00	10.657.025,45	70.258,64	0,66%	0,66%	0,57%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	213.241.459,14	0,00	110.000.000,00	104.339.231,80	1.097.772,66	0,51%	0,83%	0,23%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	199.998.449,60	0,00	200.966.116,61	967.667,01	0,48%	-	-
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	262.981.362,52	327.535.308,10	449.821.047,54	142.304.558,27	1.608.935,19	0,27%	0,80%	0,03%
ITÁÚ IDKA 2 IPCA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,00	25.000.000,00	0,00	25.062.932,65	62.932,65	0,25%	0,71%	1,09%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	0,00	85.000.000,00	0,00	85.208.936,08	208.936,08	0,25%	0,72%	1,10%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	4.173,66	13.500,00	15.456,48	2.233,16	15,98	0,09%	0,55%	0,02%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	26.483.000,00	26.465.000,00	52.961.575,70	0,00	13.575,70	0,03%	0,67%	0,02%
Total Renda Fixa	1.181.256.242,54	664.025.757,70	662.798.079,72	1.191.516.746,37	9.032.825,85	0,76%		0,73%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITADA...	32.594.594,50	0,00	0,00	34.478.893,77	1.884.299,27	5,78%	5,78%	8,04%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF MUL...	87.597.577,02	0,00	0,00	92.469.325,94	4.871.748,92	5,56%	5,56%	7,98%
ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	89.615.153,20	0,00	0,00	94.584.244,55	4.969.091,35	5,54%	5,54%	7,93%
BB BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	21.332.842,48	21.118.569,81	0,00	44.384.042,00	1.932.629,71	4,55%	5,28%	7,90%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	33.255.129,87	0,00	0,00	34.440.076,53	1.184.946,66	3,56%	3,56%	9,21%
SAFRA AÇÕES LIVRE RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	960.416,52	0,00	0,00	992.923,30	32.506,78	3,38%	3,38%	14,07%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	22.521.882,70	0,00	0,00	23.170.497,10	648.614,40	2,88%	2,88%	9,08%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕ...	71.927.904,76	0,00	0,00	73.987.963,50	2.060.058,74	2,86%	2,86%	8,95%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	1.631.961,28	0,00	0,00	1.672.243,17	40.281,89	2,47%	2,47%	12,37%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕE...	32.299.597,35	0,00	0,00	33.007.037,79	707.440,44	2,19%	2,19%	9,07%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	56.529.854,16	0,00	0,00	57.662.880,93	1.133.026,77	2,00%	2,00%	10,24%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	40.794.929,62	0,00	0,00	41.561.682,01	766.752,39	1,88%	2,01%	7,56%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	38.880.815,64	0,00	0,00	39.465.395,29	584.579,65	1,50%	1,50%	8,94%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.040.000,00	0,00	13.500,00	2.047.200,00	20.700,00	1,01%	0,35%	8,41%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	49.384.614,31	0,00	0,00	49.864.145,02	479.530,71	0,97%	0,97%	6,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMI...	8.218.037,37	0,00	0,00	8.284.599,57	66.562,20	0,81%	0,81%	7,14%
Total Renda Variável	589.585.310,78	21.118.569,81	13.500,00	632.073.150,47	21.382.769,88	3,50%		8,40%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR R...	35.185.407,63	0,00	0,00	36.591.278,74	1.405.871,11	4,00%	4,00%	7,32%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDRAÇÕES RESP LIMITADA...	6.622.757,90	0,00	0,00	6.851.288,42	228.530,52	3,45%	3,45%	8,58%
ITAU MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6.915.918,04	0,00	0,00	7.040.395,56	124.477,52	1,80%	1,80%	8,51%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	27.104.058,69	0,00	0,00	27.565.556,79	461.498,10	1,70%	1,70%	8,95%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	37.550.615,47	0,00	0,00	38.018.308,04	467.692,57	1,25%	1,25%	7,03%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	36.820.001,12	0,00	0,00	37.146.522,35	326.521,23	0,89%	0,89%	6,65%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	25.471.704,69	0,00	0,00	25.101.155,64	-370.549,05	-1,45%	-1,45%	7,16%
Total Exterior	175.670.463,54	0,00	0,00	178.314.505,54	2.644.042,00	1,51%		7,44%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	300.087.341,94	371.630.377,92	534.340.992,72	142.304.558,27	4.927.831,13	0,73%	1,93%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	118.725.267,06	0,00	0,00	120.933.895,68	2.208.628,62	1,86%	1,86%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RE...	110.975.641,50	0,00	0,00	113.171.444,33	2.195.802,83	1,98%	1,98%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	111.905.803,59	0,00	0,00	114.074.575,08	2.168.771,49	1,94%	1,94%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	267.689.018,98	0,00	165.000.000,00	104.339.231,80	1.650.212,82	0,62%	1,07%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	109.888.541,29	0,00	50.000.000,00	61.516.880,09	1.628.338,80	1,48%	1,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	77.027.488,33	0,00	0,00	78.556.106,01	1.528.617,68	1,98%	1,98%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	86.453.698,23	0,00	0,00	87.661.576,57	1.207.878,34	1,40%	1,40%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	199.998.449,60	0,00	200.966.116,61	967.667,01	0,48%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	21.775.817,66	0,00	0,00	22.193.771,18	417.953,52	1,92%	1,92%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	24.454.270,23	40.500,00	0,00	24.867.463,41	372.693,18	1,52%	1,52%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	0,00	85.000.000,00	0,00	85.208.936,08	208.936,08	0,25%	1,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.459.681,57	0,00	0,00	10.657.025,45	197.343,88	1,89%	1,89%
ITAÚ IDKA 2 IPCA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,00	25.000.000,00	0,00	25.062.932,65	62.932,65	0,25%	1,81%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	0,00	52.948.000,00	52.961.575,70	0,00	13.575,70	0,03%	1,58%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	8.108,15	64.561,57	70.479,29	2.233,16	42,73	0,06%	1,26%
Total Renda Fixa	1.239.450.678,53	734.681.889,09	802.373.047,71	1.191.516.746,37	19.757.226,46	1,00%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	83.687.286,79	0,00	0,00	94.584.244,55	10.896.957,76	13,02%	13,02%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF MUL...	81.778.954,37	0,00	0,00	92.469.325,94	10.690.371,57	13,07%	13,07%
BB BOLSA AMERICA NA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	0,00	41.118.569,81	0,00	44.384.042,00	3.265.472,19	7,94%	12,24%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	24.653.660,62	0,00	0,00	27.565.556,79	2.911.896,17	11,81%	11,81%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.160.600,00	0,00	40.500,00	2.047.200,00	-72.900,00	-3,37%	-5,25%
SAFRA AÇÕES LIVRE RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.233.973,45	0,00	0,00	992.923,30	-241.050,15	-19,53%	-19,53%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	2.010.728,03	0,00	0,00	1.672.243,17	-338.484,86	-16,83%	-16,83%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITADA...	24.855.948,33	10.000.000,00	0,00	34.478.893,77	-377.054,56	-1,08%	-1,11%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	25.529.050,89	10.000.000,00	0,00	34.440.076,53	-1.088.974,36	-3,07%	-3,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMI...	9.497.078,09	0,00	0,00	8.284.599,57	-1.212.478,52	-12,77%	-12,77%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	24.532.704,10	0,00	0,00	23.170.497,10	-1.362.207,00	-5,55%	-5,55%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕE...	36.812.981,23	0,00	0,00	33.007.037,79	-3.805.943,44	-10,34%	-10,34%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	45.664.561,93	0,00	0,00	41.561.682,01	-4.102.879,92	-8,98%	-8,98%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	54.192.452,39	0,00	0,00	49.864.145,02	-4.328.307,37	-7,99%	-7,99%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕ...	78.370.306,61	0,00	0,00	73.987.963,50	-4.382.343,11	-5,59%	-5,59%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	43.922.070,52	0,00	0,00	39.465.395,29	-4.456.675,23	-10,15%	-10,15%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	63.098.096,84	0,00	0,00	57.662.880,93	-5.435.215,91	-8,61%	-8,61%
Total Renda Variável	602.000.454,19	61.118.569,81	40.500,00	659.638.707,26	-3.439.816,74	-0,52%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	40.008.009,74	899.801.792,71	804.347.512,49	142.304.558,27	6.842.268,31	2,79%	4,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	164.750.646,12	100.000,00	50.100.000,00	120.933.895,68	6.183.249,56	4,33%	4,65%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM RESP LIMITADA FIF CIC RE...	157.760.931,92	0,00	50.000.000,00	113.171.444,33	5.410.512,41	4,06%	4,35%
BB IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA PREVID...	129.185.043,61	0,00	20.000.000,00	114.074.575,08	4.889.531,47	4,23%	4,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	154.478.086,10	0,00	80.000.000,00	78.556.106,01	4.078.019,91	3,78%	4,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	22.287.404,29	0,00	1.137.904,92	22.193.771,18	1.044.271,81	4,90%	4,89%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	199.998.449,60	0,00	200.966.116,61	967.667,01	0,48%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.655.451,01	0,00	557.121,89	10.657.025,45	558.696,33	5,45%	5,47%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	0,00	85.000.000,00	0,00	85.208.936,08	208.936,08	0,25%	4,66%
CAIXA BRASIL ATIVA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	24.653.966,09	40.500,00	0,00	24.867.463,41	172.997,32	0,69%	0,70%
ITAÚ IDKA 2 IPCA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,00	25.000.000,00	0,00	25.062.932,65	62.932,65	0,25%	4,61%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	0,00	54.354.309,01	54.368.092,35	0,00	13.783,34	0,04%	3,27%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM RESP LIMITADA F...	0,00	11.000.000,00	11.002.103,93	0,00	2.103,93	0,04%	4,33%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	0,00	3.762.332,41	3.760.195,42	2.233,16	96,17	0,28%	2,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	152.856.750,87	0,00	65.000.000,00	87.661.576,57	-195.174,30	0,42%	0,53%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC R...	131.911.704,88	0,00	70.000.000,00	61.516.880,09	-394.824,79	-0,22%	-0,16%
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%	-2,34%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	336.298.000,44	147.005,72	230.000.000,00	104.339.231,80	-2.105.774,36	-0,26%	-0,11%
Total Renda Fixa	1.342.504.339,98	1.279.204.389,45	1.457.341.427,28	1.191.516.746,37	27.149.444,22	1,04%	



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2021

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ S&P500® BRL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	80.933.107,37	0,00	94.584.244,55	13.651.137,18	28,14%	32,74%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF MUL...	0,00	82.069.849,16	0,00	92.469.325,94	10.399.476,78	12,67%	32,83%
CAIXA alocação MACRO RESP LIMITADA FIF CIC MULTIME...	118.038.465,20	0,00	122.069.849,16	0,00	4.031.383,96	3,42%	1,44%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	0,00	23.895.709,40	0,00	27.565.556,79	3.669.847,39	14,63%	30,51%
BB BOLSA AMERICANA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	0,00	41.118.569,81	0,00	44.384.042,00	3.265.472,19	11,51%	30,30%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR RESP LIMITADA...	24.731.655,27	0,00	24.368.235,34	0,00	-363.419,93	-1,48%	-20,59%
SAFRA AÇÕES LIVRE RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	1.406.516,65	0,00	992.923,30	-413.593,35	-29,41%	-22,84%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	0,00	2.300.000,00	0,00	1.672.243,17	-627.756,83	-27,30%	-18,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CICA...	19.180.359,77	0,00	18.465.636,27	0,00	-714.723,50	-3,73%	-17,09%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4.105.500,00	0,00	187.479,00	2.047.200,00	-1.870.821,00	-46,30%	-50,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS RESP LIMI...	10.483.515,61	0,00	0,00	8.284.599,57	-2.198.916,04	-20,96%	-20,97%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO RESP LIMITAD...	0,00	37.184.117,66	0,00	34.478.893,77	-2.705.223,89	-11,86%	5,61%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	37.184.117,66	0,00	34.440.076,53	-2.744.041,13	-9,41%	-6,26%
BRADESCO IBOVESPA PLUS RESP LIMITADA FIF AÇÕES	26.381.080,23	0,00	0,00	23.170.497,10	-3.210.583,13	-12,17%	-12,17%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	54.500.960,47	0,00	0,00	49.864.145,02	-4.636.815,45	-8,51%	-8,51%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕE...	39.047.858,44	0,00	0,00	33.007.037,79	-6.040.820,65	-15,47%	-15,47%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	27.652.454,51	20.000.000,00	0,00	39.465.395,29	-8.187.059,22	-13,78%	-13,05%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	49.856.820,63	0,00	0,00	41.561.682,01	-8.295.138,62	-16,64%	-16,64%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕ...	76.013.410,43	8.400.000,00	0,00	73.987.963,50	-10.425.446,93	-12,37%	-12,11%
BRADESCO SELECTION RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	69.987.199,99	0,00	0,00	57.662.880,93	-12.324.319,06	-17,61%	-17,61%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2021

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Variável	519.979.280,55	334.491.987,71	165.091.199,77	659.638.707,26	-29.741.361,23	-4,31%	



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2021

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	0,00	31.717.464,05	0,00	38.018.308,04	6.300.843,99	20,10%	32,87%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR R...	0,00	32.968.199,40	0,00	36.591.278,74	3.623.079,34	15,25%	32,35%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	0,00	34.784.098,22	0,00	37.146.522,35	2.362.424,13	6,19%	23,65%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	0,00	23.178.868,15	0,00	25.101.155,64	1.922.287,49	10,50%	11,65%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB BDRAÇÕES RESP LIMITADA...	0,00	6.000.000,00	0,00	6.851.288,42	851.288,42	14,18%	33,92%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	0,00	6.872.195,79	0,00	7.040.395,56	168.199,77	2,45%	6,63%
Total Exterior	0,00	135.520.825,61	0,00	150.748.948,75	15.228.123,14	11,24%	

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.

