



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS
SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
FUNSERV

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

RESUMO

Trata-se do Parecer do Comitê de Investimentos sobre os Investimentos dos Recursos da Previdência

Em referência ao mês de Novembro de 2020



Sumário

| | |
|---|----|
| 1. INTRODUÇÃO..... | 2 |
| 2. ANEXOS..... | 2 |
| 3. PARECER DO COMITÊ..... | 2 |
| 3.1 Análise do Cenário Econômico..... | 2 |
| 3.1.1 Resenha Macro Brasil..... | 2 |
| 3.1.2 Resenha Macro Internacional | 3 |
| 3.1.3 Perspectivas Econômicas..... | 4 |
| 3.2 Evolução da Execução Orçamentária do RPPS | 5 |
| 3.3 Análise da Carteira de Investimentos | 5 |
| 3.3.1 Enquadramento da Carteira Consolidada de Investimentos na Resolução CMN nº 3.922 e Política de Investimentos..... | 5 |
| 3.3.2 Rentabilidade sobre os Fundos de Investimentos..... | 6 |
| 3.3.3 Distribuição por Sub-segmento. | 6 |
| 3.3.4 Retorno X Meta Atuarial | 7 |
| 3.3.5 Evolução Patrimonial..... | 7 |
| 3.3.6 Fluxo de Caixa dos Investimentos..... | 8 |
| 3.4 Análises de Fundos de Investimentos | 9 |
| 3.5 Análise de Risco da Carteira de Investimentos | 9 |
| 4. CONCLUSÃO..... | 10 |

1. INTRODUÇÃO

Na busca por uma gestão previdenciária de qualidade e principalmente no que diz respeito às Aplicações dos Recursos, dispomos do parecer de deliberação e análise, promovido por este Comitê de Investimentos da FUNSERV.

Foi utilizado para a emissão desse Parecer: o Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco referente ao mês de Novembro de 2020, as análises de mercado de Instituições Financeiras e outros documentos complementares internos da FUNSERV.

2. ANEXOS

| Relatórios | Anexos |
|--|-----------|
| AnexoI_Relatório Analítico Investimentos Novembro-2020 | ANEXO I |
| AnexoII_Balanco_PrevNov2020 | ANEXO II |
| AnexoIII_SubIndicesAnbima020304_Dez2020 | ANEXO III |
| AnexoIV_HistoricoFundoRioBravo | ANEXO IV |

3. PARECER DO COMITÊ

3.1 Análise do Cenário Econômico

Cenário econômico extraído da Carta do Boletim Mensal elaborado pela Geico – Gerência de Investidores Corporativos da Caixa Econômica Federal do mês de Novembro/2020.

3.1.1 Resenha Macro Brasil

“ATIVIDADE ECONÔMICA: A maior parte dos setores apresentaram queda dos indicadores de confiança em Novembro. No agregado, apesar de o índice de situação atual continuar em ascensão, as expectativas recuaram 3,3 pontos, sendo, portanto, o principal vetor da piora na confiança. Os piores desempenhos se deram nos indicadores do comércio de serviços, com ambos se mantendo abaixo do nível pré-covid. A confiança do consumidor também recuou e ainda se mantém 21% abaixo do nível pré-covid. O destaque positivo continua sendo a indústria, com a confiança do setor sendo a única a avançar no mês, já atingindo patamar 27% acima do observado em fevereiro/20. Os dados do CAGED de outubro registraram criação de 394.989 vagas de empregos formais. Esse foi o maior saldo histórico para o mês de outubro, se situando bem acima do último recorde (230.956 em out/2009). O avanço do número de admissões mais que compensou o incremento nas demissões. Com o dado, houve a 4ª taxa positiva seguida e recuperação de 77% do que foi perdido nos quatro meses que representaram o auge da pandemia (mar-jun). Para novembro, os indicadores apontaram recuperação da atividade, mesmo que alguns dados sinalizem arrefecimento diante do menor impacto dos auxílios governamentais. O aumento do número de casos de COVID-19 coloca riscos adicionais à continuidade da recuperação, já que cidades importantes começam a retomar medidas restritivas, mesmo que de maneira ainda bastante gradual.

INFLAÇÃO: O IPCA-15 desacelerou de 0,94% para 0,81% na passagem de outubro para novembro. Com isso, a inflação em 12 meses avançou de 3,52% para 4,22% (A/A), ultrapassando a meta do Banco Central. O Grupo Alimentação e Bebidas continua sendo o principal vetor do índice e, apesar de ter apresentado desaceleração (de 2,24% para 2,16%), se mostrou mais elevado que a nossa expectativa (1,92%). A média dos 5 núcleos mais relevantes para o BCB recuou moderadamente (de 0,54% para 0,51%), entretanto, o índice de difusão segue em trajetória ascendente (de 64,0% para 66,5%). O IGP-M mostrou elevação de 3,23% para 3,28% em novembro, acima da projeção efetuada (3,14%) e da mediana do mercado (3,19%). O resultado continua muito influenciado pelo Índice de Preços ao Produtor (IPA), que acelerou de 4,15% para 4,92%. Entre os componentes do IPA, os produtos agropecuários aceleraram de 8,44% para 8,96%, superando de maneira relevante a projeção efetuada (8,35%). Os demais componentes do IGP-M desaceleraram em relação ao mês anterior, com o IPC avançando 0,72% (ante 0,77%) e o INCC 1,29% (ante 1,69%). Em 12 meses, o IGP-M acumula alta de 24,52% (A/A). Projeção de 0,34% para o IPCA de dezembro.

POLÍTICA MONETÁRIA: Em novembro, não houve reunião do COPOM. O presidente do BCB seguiu reforçando a necessidade de aprovação de reformas estruturantes para a manutenção de Selic em níveis baixos e manteve a avaliação de que a recente alta da inflação é um choque temporário. SELIC em 2,00% a.a. Boletim Focus do BCB (11/dez) projeta SELIC para 3,00% ao final de 2021.

3.1.2 Resenha Macro Internacional

EUA: Com relação à Atividade, a 2ª prévia do PIB do 3T2020 manteve inalterada a expansão de 33,1% (T/T, base anualizada) contra -31,4% do trimestre anterior, confirmando o bom momento da economia norte-americana após superada a fase mais aguda da pandemia de COVID-19. Novembro trouxe o resultado da corrida presidencial, confirmando a vitória do candidato da oposição democrata, Joe Biden, na disputa contra o atual, o republicano Donald J. Trump. Considerando a corrida para o legislativo, o resultado manteve o Congresso dividido, com a House of Representatives se mantendo com maioria democrata e o Senado com maioria republicana. O resultado final ainda depende do runoff (2º turno) da Geórgia no dia 05/Jan, onde suas cadeiras ao Senado serão decididas. No campo Político, o mês deu sequência ao impasse sobre novas medidas de estímulos fiscais no Congresso norte-americano. Dado que após a eleição de 03/nov um acordo nas duas casas ficou ainda mais distante, um grupo bipartidário de senadores apresentou uma proposta de estímulos com montante de US\$ 908 bi, o que não foi bem recebido pela líder da maioria republicana na casa, Mitch McConnell.

EUROPA: Em Novembro não houve reunião do Comitê de Política Monetária do Banco Central Europeu (BCE), assim, as atenções ficaram com a divulgação da ata da reunião de outubro. No documento, a descrição do cenário econômico destacou o ambiente persistentemente desinflacionário – seja pela perspectiva da inflação corrente, seja pela das expectativas – e que a forte recuperação ocorrida no 3T20 deverá ser seguida por uma contração no 4T20 (doubledip recession). No Reino Unido, a reunião de política monetária de Novembro do Banco da Inglaterra (BoE) manteve a taxa básica de juros inalterada em 0,1% e aumentou o orçamento do programa de compras de ativos em £150 bi, passando de £745 bi para £895 bi. Com relação à atividade, o mês trouxe a 2ª prévia do PIB do 3T2020 na Zona do Euro, que revisou a expansão de 12,7% (T/T) para 12,6%, contra -11,8% do trimestre anterior. Com relação ao mercado de trabalho, a taxa de desemprego de outubro na Zona do Euro ficou em linha com a expectativa de mercado, avançando para 8,4% contra 8,3% da última medição (revisado de 8,5%), enquanto que no Reino Unido, no dado de setembro, o mesmo indicador avançou para 4,8% contra 4,5% da medição anterior, em linha com a expectativa do mercado.

CHINA E JAPÃO: Na China, o PMI manufatura de novembro ficou em 52,1 pontos contra 51,4 da medição anterior, enquanto o PMI não manufatura foi de 56,4 contra 56,2 pontos, ambos em patamares que indicam expansão importante da atividade. Dados do setor externo indicaram que, em outubro, as exportações avançaram 11,4% (A/A) contra 9,9% da medição anterior, enquanto as importações variaram 4,7% (A/A) contra 13,2% do mês anterior. No Japão, o PMI de manufatura de outubro avançou para 48,7 pontos contra 47,7 da medição anterior, enquanto o PMI de serviços alcançou 47,7 pontos contra 46,9, ambos em patamar que indica contração da atividade.

GLOBAL: Na América Latina, o aumento no número de novos casos diários no Brasil, México e Colômbia reforça a visão de que está em curso uma ressurgência sustentada da pandemia na região, contudo, a desaceleração do contágio na Argentina e Peru em conjunto com a estabilização no Chile indicou que há elevada heterogeneidade na evolução da doença. Na África também houve uma ressurgência dos casos influenciado pelo avanço da doença no Marrocos.

3.1.3 Perspectivas Econômicas

3.1.3.1 Renda Fixa

Em novembro aconteceram alguns movimentos importantes nas curvas de juros brasileiras, entretanto, o net foi algo muito próximo da estabilidade para os ativos prefixados e pequeno fechamento nas taxas das NTN-B, especialmente nas mais curtas. A Inflação Implícita, por sua vez, viu mais um período de alta, em linha com as pressões inflacionárias observadas recentemente e com a deterioração das expectativas por parte do mercado. Com relação às LFT, houve uma nova rodada de deságio nos títulos mais longos, com intensidade bem menor que as observadas em setembro e início de outubro, mas suficiente para fazer o IMA-S desempenhar significativamente abaixo do CDI em novembro: 0,10% (66,99% do CDI). A quase estabilidade notada no movimento líquido das curvas de juros locais em novembro, contribuiu com o desempenho dos principais sub-índices de Renda Fixa da ANBIMA. As carteiras teóricas formadas por TPF prefixados superaram o CDI em função do carregamento dos papéis, enquanto aquelas compostas por NTN-B tiveram desempenhos ainda mais expressivos, com o alto carregamento e algum fechamento observado nas taxas dos títulos. Apesar das surpresas com a inflação corrente e das relevantes revisões recentes em nossas projeções para o IPCA, mantemos a leitura de SELIC em 2,00% este ano, 3,00% em 2021 e 5,00% em 2022. Contudo, o risco para concretização do nosso cenário base é crescente e a depender da evolução das expectativas de inflação para o biênio 2021/22 e do quadro fiscal brasileiro, podemos revisar nosso atual call de normalização da SELIC, com início previsto apenas no 3T21. Há percepção de melhora no ambiente doméstico, com o destaque para o viés positivo trazido pela extensão do auxílio emergencial, dados robustos de atividade econômica e bom andamento do desenvolvimento da vacina para o coronavírus, o quadro para recuperação ainda é desafiador, demandando forte ajuste fiscal em ambiente de deterioração do mercado de trabalho e de contração do investimento. Assim, permanecemos com nossa proposta de alocação primordialmente em ativos corporativos de prazo mais curto e de baixo risco de crédito. Da mesma forma, entendemos que as aquisições de ativos bancários para o próximo período devam ocorrer de forma cautelosa e pontual, atentando-se para as peculiaridades de cada instituição.

3.1.3.2 Renda Variável

Em novembro, os índices acionários tiveram forte valorização, após três meses consecutivos de perdas. Além das bolsas de valores, as commodities também subiram no mês enquanto o dólar recuou perante seus pares. Nesse contexto, o Ibovespa fechou o mês com avanço de 15,90%,

puxado pelos setores financeiro e imobiliário. Além disso, a valorização do Ibovespa no mês teve um forte componente externo uma vez que não houve alívio nos riscos associados ao ambiente doméstico, sobretudo o risco fiscal. Ademais, observou-se piora adicional no balanço de riscos domésticos devido à persistente alta da inflação e consequente risco de elevação dos juros pelo Bacen antes do previsto. Neste sentido, entendemos que tais fatores adicionam risco à materialização do upside para a bolsa doméstica em 2021, no entanto, sem alterar o viés positivo para o próximo ano. Em termos de performance, nos EUA, os principais índices americanos registram forte alta no período, justificado, sobretudo, pelos avanços das pesquisas dos imunizantes contra o COVID-19 com divulgação de resultados com níveis de eficácia em 95% e pela possibilidade de aprovação do pacote de estímulos monetários no montante de US\$ 908 bilhões. Na zona do Euro, a atividade econômica melhorou de forma mais expressiva e, dado isso, os índices acionários modificaram a tendência de lateralidade e recuperaram parte relevante das perdas provocadas pela crise do coronavírus. Neste contexto, os índices IBEX35, FTSE MIB e CAC fecharam o mês com performance positiva de 25,18%, 22,95% e 20,12%, respectivamente. Nessa perspectiva, no continente asiático, os índices de Hong Kong, Shanghai e Nikkei, concluíram o período favoravelmente em 9,27%, 5,19% e 15,04%, respectivamente.

Mantivemos nossa visão positiva para a bolsa de valores dado uma tendência de retomada da atividade econômica brasileira. Porém, as contas públicas brasileiras devem continuar refletindo às políticas de combate ao COVID-19, observando ainda uma pressão política para extensão do programa de auxílio à renda e, também, notou-se piora adicional no balanço de riscos domésticos devido à persistente alta da inflação e consequente risco de elevação dos juros pelo Bacen antecipadamente. Além disso, avaliamos também que o nível global de incerteza econômica foi reduzido de forma significativa em decorrência das eleições presidenciais e legislativas nos EUA. Enxergamos boas oportunidades nos mercados de bolsa, corroborada, especialmente, pela retomada econômica e avanço nas reformas estruturais como fiscal e administrativa.

3.2 Evolução da Execução Orçamentária do RPPS

Segue em anexo (ANEXO II) o balanço orçamentário de Novembro de 2020 que demonstra que todas as contribuições dos servidores foram repassadas de acordo com a legislação vigente e as despesas com pagamento de benefícios e despesas de administração foram devidamente contabilizadas. As receitas patrimoniais estão sendo lançadas em Variação Patrimonial Aumentativa e Variação Patrimonial Diminutiva, sendo que só é lançada a receita patrimonial orçamentária quando o resgate do investimento é efetivado. Foram realizados resgates parciais do fundo BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO, resgates para pagamento de benefícios previdenciários o que gerou uma receita orçamentária no montante de R\$ 49.896,28. Procedimento este adotado atendendo as regras do Manual de Contabilidade Aplicada ao Setor Público – MCASP/STN (*1) e Tribunal de Contas do Estado de São Paulo.

(*1) Regulamentações: Portaria Conjunta STN/SOF nº 06, de 18 de dezembro de 2018, Portaria Conjunta STN/SPREV nº 07, de 18 de dezembro de 2018 e Portaria STN nº 877, de 18 de dezembro de 2018.

3.3 Análise da Carteira de Investimentos

3.3.1 Enquadramento da Carteira Consolidada de Investimentos na Resolução CMN nº 3.922 e Política de Investimentos

Ao analisar o enquadramento segundo os limites permitidos da Resolução e Política de Investimentos, foi identificado que não há desenquadramento.

| Tipo de Ativo | Enquadramento Resolução CMN Nº 3.922 | Enquadramento Política de Investimentos |
|---|--|---|
| Renda Fixa | Enquadrado | Enquadrado |
| Renda Variável e Investimento no Exterior | Enquadrado | Enquadrado |
| Enquadramento por Gestor de Recursos | Enquadrado | Enquadrado |

3.3.2 Rentabilidade sobre os Fundos de Investimentos.

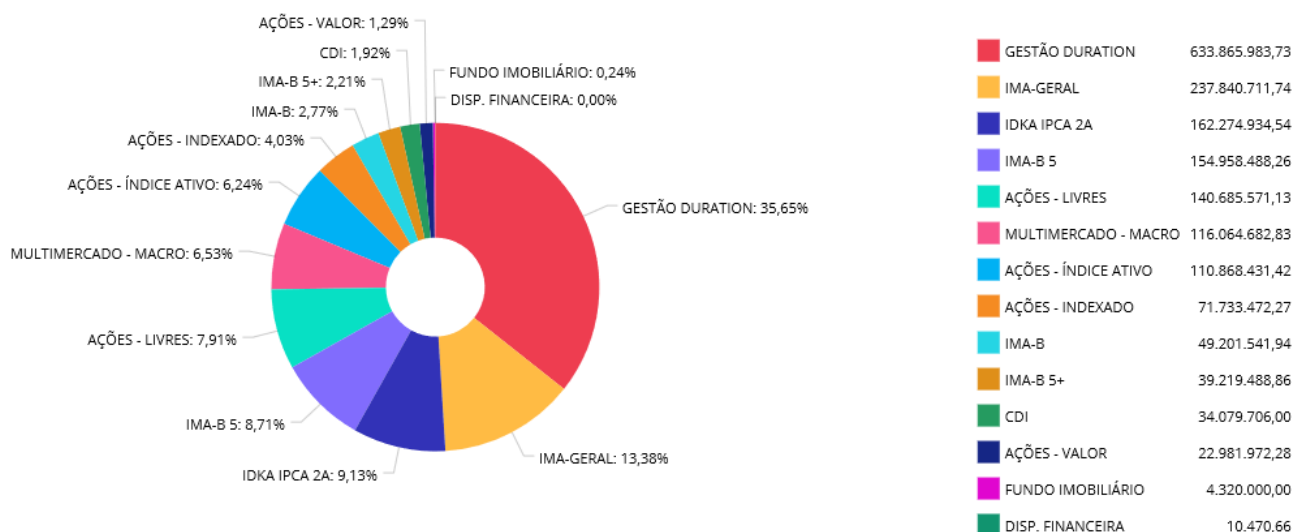
Considerando os retornos apresentados pelos fundos de investimentos, podemos identificar que todos estão dentro das expectativas, considerando o cenário econômico atual, bem como os riscos atrelados a eles.

Os fundos de investimentos classificados como renda fixa, representam um montante de R\$ 1.311.440.855,07 (um bilhão, trezentos e onze milhões, quatrocentos e quarenta mil, oitocentos e cinquenta e cinco reais e sete centavos). Apresentaram no mês um retorno de 0,99%, representando um montante de R\$ 13.236.838,26 (treze milhões, duzentos e trinta e seis mil, oitocentos e trinta e oito reais e vinte e seis centavos).

Os fundos de investimentos classificados como renda variável, representam um montante de R\$ 466.654.129,93 (quatrocentos e sessenta e seis milhões, seiscentos e cinquenta e quatro mil, cento e vinte e nove reais e noventa e três centavos), apresentaram no mês um retorno de 9,75%, representando um montante de R\$ 41.444.659,28 (quarenta e um milhões, quatrocentos e quarenta e quatro mil, seiscentos e cinquenta e nove reais e vinte e oito centavos).

3.3.3 Distribuição por Sub-segmento.

Ao analisar a distribuição da carteira de investimentos do mês em referência, podemos destacar que a atual distribuição corresponde às expectativas da FUNSERV e efetivamente busca o entendimento da análise de cenário econômico. Segue quadro de Distribuição da Carteira de Investimentos:



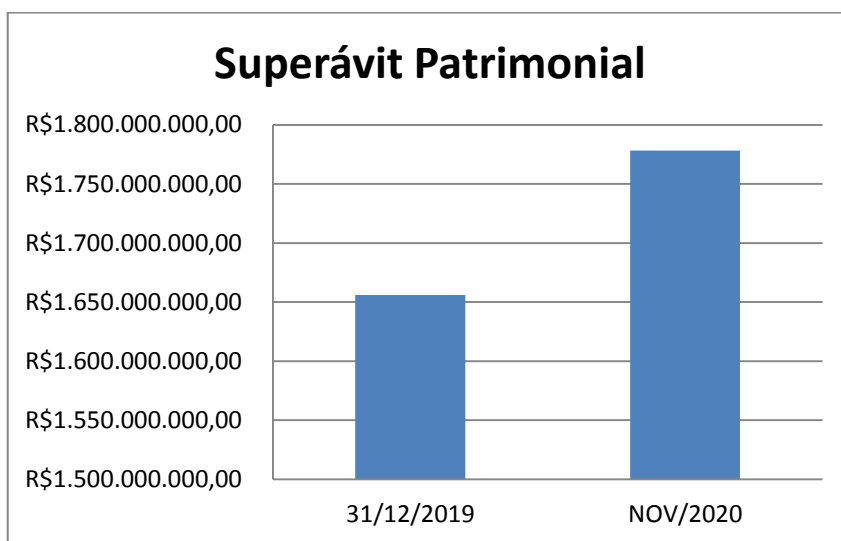
3.3.4 Retorno X Meta Atuarial

No mês de Novembro de 2020, a FUNSERV obteve um retorno positivo de 3,17%, correspondente ao montante de R\$ 54.681.497,54 (cinquenta e quatro milhões, seiscentos e oitenta e um mil, quatrocentos e noventa e sete reais e cinquenta e quatro centavos), sendo o retorno de 0,99% no total de renda fixa e retorno de 9,75% no total de renda variável.

No ano, o retorno acumulado corresponde a 0,74% contra a meta atuarial de 8,27%, ou seja, um gap de 8,90% no cumprimento da meta para o exercício de 2020. Um superávit nas aplicações que corresponde ao total de R\$ 16.200.228,16 (dezesesseis milhões, duzentos mil, duzentos e vinte e oito reais e dezesseis centavos).

3.3.5 Evolução Patrimonial

| Evolução Patrimonial | | |
|----------------------|----------------------|-----------------------|
| 31/12/2019 | NOV/2020 | SUPERÁVIT PATRIMÔNIAL |
| R\$ 1.655.970.751,91 | R\$ 1.778.094.985,00 | R\$ 122.124.233,09 |



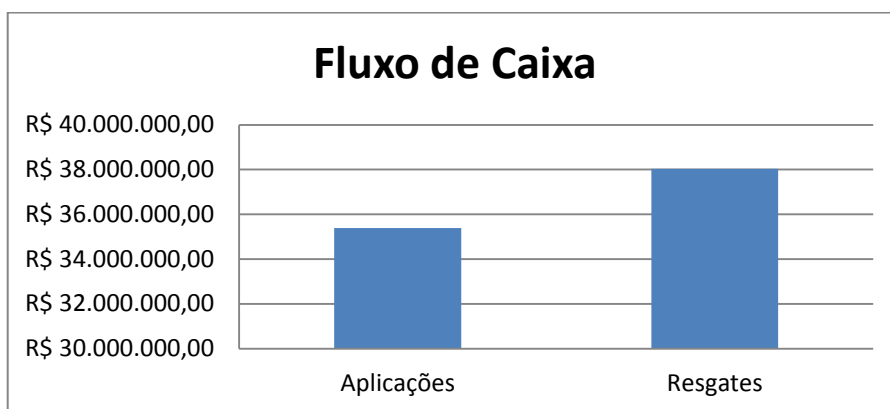
No início do exercício de 2020, a FUNSERV apresentava um patrimônio líquido de R\$ 1.655.970.751,91 (um bilhão, seiscentos e cinquenta e cinco milhões, novecentos e setenta mil, setecentos e cinquenta e um reais e noventa e um centavos).

No final do mês de novembro de 2020, a FUNSERV apresenta um patrimônio líquido de R\$ 1.778.094.985,00 (Um bilhão, setecentos e setenta e oito milhões, noventa e quatro mil, novecentos e oitenta e cinco reais).

Houve uma aumento do patrimônio líquido da FUNSERV de R\$ 122.124.233,09 (cento e vinte e dois milhões, cento e vinte e quatro mil, duzentos e trinta e três reais e nove centavos). Este superávit patrimonial se deu devido à rentabilidade dos investimentos, aportes das contribuições dos funcionários do Fundo Previdenciário e Recursos do Compre.

3.3.6 Fluxo de Caixa dos Investimentos

| Fluxo de Caixa | | |
|-------------------|-------------------|-------------------|
| Aplicações | Resgates | Entradas e Saídas |
| R\$ 35.388.161,31 | R\$ 38.029.596,09 | R\$ 73.417.757,40 |



O valor superior de resgates sobre as aplicações neste mês ocorreu devido ao pagamento da primeira parcela do décimo terceiro salário aos beneficiários da FUNSERV.

O Comitê de Investimentos entende não haver quaisquer indícios de apurações equivocadas.

3.4 Análises de Fundos de Investimentos

A gestora de Recursos propõe ao comitê a solicitação de análise do fundo CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO, C.N.P.J. : 39.528.038/0001-77, por ter como estratégia a alocação em fundos com grande expertise em investimentos no exterior, possibilitando assim maior diversificação e dispersão de risco além de uma correlação negativa com os investimentos no Brasil.

3.5 Análise de Risco da Carteira de Investimentos

Em se tratando de risco de liquidez, a carteira de investimentos da FUNSERV possui liquidez imediata de 98,15% para auxílio no cumprimento das suas obrigações.

Quanto ao risco de crédito, não houve aplicações em fundos de investimentos que possuem em sua carteira ativos de risco de crédito.

Agora, quando se trata de risco de mercado, consideramos a relação risco x retorno observando o indicador de desempenho VaR – Value at Risk, adotado pela FUNSERV na nossa Política de Investimentos.

| Retorno | VaR da Carteira | VaR de RF | VaR de RV |
|---------|-----------------|-----------|-----------|
| 3,17% | 3,00% | 1,31% | 8,25% |

O VaR da carteira de investimentos em renda fixa se encontra em conformidade com sua estratégia de risco de mercado traçada na Política de Investimentos para 2020, limitado a 2,30% do valor alocado neste segmento. Já o VaR da carteira de investimentos em renda variável se encontra em desconformidade com sua estratégia de risco de mercado traçada na Política de Investimentos para 2020, limitado a 6,13% do valor alocado neste segmento.

Entendemos que o motivo pelo qual o VaR de renda variável encontra-se superior ao estipulado, decorre dos principais acontecimentos mercadológicos que vem apresentando altas volatilidades, devido a instabilidade gerada pela pandemia de COVID-19. Optamos pelo acompanhamento continuado buscando a melhor saída para o retorno das aplicações, em um contexto favorável ao desinvestimento.

O Comitê vem acompanhando a rentabilidade dos fundos de renda variável e observa que a rentabilidade do fundo ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES, C.N.P.J. : 23.731.629/0001-07, está se apresentando bem abaixo de seu benchmark e está propondo o envio de um questionamento ao Gestor do fundo acerca da composição atual da carteira e quais seriam suas estratégias para retorno da performance do referido fundo.

4. CONCLUSÃO

Em relação às aplicações dos RPPS entendemos que devemos manter os atuais 35,65% dos recursos em fundos de investimento em títulos públicos que possuem a gestão duration. Esses fundos possuem a carteira dinâmica, o que significa que é permitido ao gestor realizar realocações de acordo com as oscilações no cenário econômico, assim diminuindo os riscos da carteira e auxiliando por outro lado na obtenção de retornos para o cumprimento da meta atuarial.

Para os vértices de longuíssimo prazo (especificamente o IMA-B5+), a Gestora comunica aos membros do Comitê que foi solicitado o resgate no último dia 04 de dezembro de 2020 do fundo BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO, C.N.P.J. : 13.327.340/0001-73, quando o mesmo atingiu rentabilidade anual positiva, ocorrida em 03 de dezembro, conforme acordado na última reunião deste Comitê em 18 de novembro de 2020 (segue anexado sub-índices da anbiima de 02, 03 e 04 de dezembro de 2020).

Para os vértices médios (IMA-B 5, IDKa 2A e IRF-M Total) entendemos uma exposição de até 35% e para os vértices de curto prazo, representados pelos fundos DI, entendemos ser necessária apenas uma parcela suficiente para honrar os compromissos atuais do instituto, pois as despesas com o Fundo Financeiro estão sendo cobertas pelos entes, através da cobertura do déficit, conforme preconiza a lei 8.336/2007. O Fundo de Reserva está em fase de Capitalização e do Fundo Previdenciário, atualmente são utilizados apenas 10% dos recursos de contribuição para honrar os compromissos com pagamento de benefícios previdenciários e os 90% restantes estão sendo Capitalizados para honrar pagamentos futuros.

Quanto à renda variável, nossa política de investimentos definida em dezembro de 2019 prevê uma exposição máxima de 30%, pela sua importância como fator de diversificação de portfólio, em um momento em que as taxas de juros dos títulos públicos estão muito longe de atingir a meta atuarial. Neste segmento nossa carteira está com 26,24%, por entendermos que no longo prazo serão os que ajudarão a honrar os compromissos. Os novos recursos (compreendidos pela contribuição patronal e dos servidores do fundo previdenciário do mês de janeiro, já deduzido o valor para pagamento de benefícios previdenciários e despesas administrativas) e repasse do COMPREV, no valor total aproximado de R\$ 10.000.000,00 (dez milhões de reais), após estudo do contexto atual, pelo aumento do fluxo de capital estrangeiro para o Brasil, motivados pelo otimismo dos mercados com a liberação das vacinas para COVID-19, serão investidos no fundo: CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES, CNPJ: 13.058.816/0001-18, estando em linha com a política de investimentos para 2020.



Segue anexado a este, histórico da rentabilidade na carteira do fundo Imobiliário Rio Bravo, que diverge da performance da lâmina, pois nela não estão embutidos os pagamentos de rendimentos e houve Split das cotas, o que ocasionou distorção da rentabilidade.

Os recursos provenientes do rendimento do Fundo Imobiliário Rio Bravo, no montante aproximado de R\$ 21.000,00 (vinte e um mil reais) serão aplicados no fundo: CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA, CNPJ: 23.215.097/0001-55, pois este vem apresentando boa performance no ano.

No contexto geral da análise proferida e após conferência das APR's de novembro de 2020 e por estarem em concordância com o que foi definido em reunião ordinária deste comitê, no dia vinte e seis de outubro do corrente exercício, entendemos que não há indícios ou números que prejudique a aprovação das aplicações dos recursos da FUNSERV mencionadas nesse parecer.

Sem mais,

Silvana M. S. Duarte Chinelatto
Presidente Funserv

José Antônio de Oliveira Junior
Diretor Administrativo e Financeiro

Marise de Souza Simão
Gestora de Recursos do RPPS

Maria do Socorro Souza Lima
Membro do Comitê de Investimento

Ana Paula Fávero Sakano
Membro do Comitê de Investimento

Maria W. L. A. Sie
Membro do Comitê de Investimento

Carlos Eduardo Barbosa João
Membro do Comitê de Investimentos

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2020



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2020)

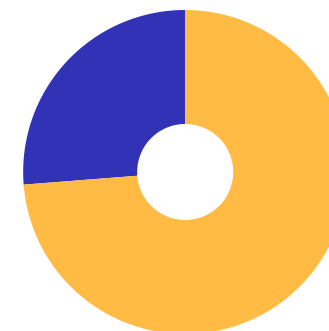
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922 |
|---|---------|------------|----------------|--------------------|----------|------------------|------------------------------------|
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | D+0 | Não possui | 331.893.698,42 | 18,67% | 879 | 2,34% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1 | Não há | 162.274.934,54 | 9,13% | 916 | 2,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI... | D+2 | Não há | 39.219.488,86 | 2,21% | 303 | 2,19% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR... | D+0 | 15/08/2024 | 21.888.769,54 | 1,23% | 93 | 5,11% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+3 | Não há | 237.840.711,74 | 13,38% | 589 | 2,50% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 154.958.488,26 | 8,71% | 163 | 13,32% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI... | D+0 | 15/08/2024 | 10.486.290,46 | 0,59% | 140 | 1,81% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 16.826.481,94 | 0,95% | 117 | 0,84% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | D+1 du | Não há | 24.409.323,49 | 1,37% | 98 | 3,30% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P... | D+3 du | Não há | 148.843.196,54 | 8,37% | 412 | 6,77% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 128.719.765,28 | 7,24% | 195 | 9,23% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0 | Não há | 34.079.706,00 | 1,92% | 584 | 1,42% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES | D+4 | Não há | 47.595.968,02 | 2,68% | 118 | 6,91% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a ' |
| BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES | D+3 | Não há | 24.137.504,25 | 1,36% | 52 | 6,97% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕ... | D+24 | Não há | 9.765.764,24 | 0,55% | 16 | 3,23% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | D+25 | Não há | 36.274.593,19 | 2,04% | 2.429 | 3,79% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | D+5 | Não há | 46.007.980,74 | 2,59% | 56 | 4,59% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 51.273.142,11 | 2,88% | 44.170 | 1,23% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 17.764.632,49 | 1,00% | 145 | 0,90% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | D+4 | Não há | 64.860.450,68 | 3,65% | 203 | 8,45% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2020)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922 |
|--|------------|---------------|-------------------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------------------|
| SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 22.981.972,28 | 1,29% | 3.143 | 4,05% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a ' |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 25.607.439,10 | 1,44% | 42.610 | 1,95% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a ' |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | D+4 | Não há | 116.064.682,83 | 6,53% | 19.277 | 2,33% | Artigo 8º, Inciso III |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | Não se ... | Não se aplica | 4.320.000,00 | 0,24% | | 1,90% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b ' |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 1.778.094.985,00 | | | | |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 10.470,66 | Artigo 6º | | | |
| PL Total | | | 1.778.105.455,66 | | | | |

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Novembro / 2020)

| Artigos - Renda Fixa | Resolução Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2020 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|-----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 958.562.381,82 | 53,91% | 15,00% | 45,00% | 80,00% | 463.913.606,18 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 65,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 177.809.498,50 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 45,00% | 352.878.473,25 | 19,85% | 10,00% | 25,00% | 40,00% | 358.359.520,75 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 88.904.749,25 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 88.904.749,25 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 88.904.749,25 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 1.311.440.855,07 | 73,76% | 25,00% | 70,00% | 145,00% | |



RENTA FIXA 1.311.440.855,07

RENTA VARIÁVEL 466.654.129,93

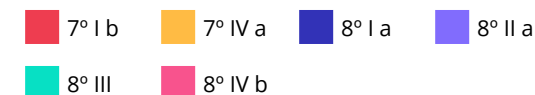
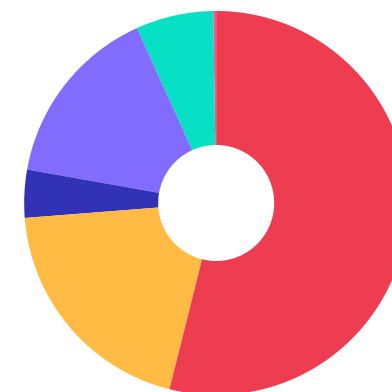
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Novembro / 2020)

| Artigos - Renda Variável | Resolução Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2020 | | | GAP Superior |
|----------------------------------|-----------------------------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|---------------|-----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a' | 35,00% | 71.733.472,27 | 4,03% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 17.171.276,98 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' | 25,00% | 274.535.974,83 | 15,44% | 7,00% | 15,00% | 20,00% | 81.083.022,17 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 116.064.682,83 | 6,53% | 0,00% | 9,00% | 10,00% | 61.744.815,67 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 88.904.749,25 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b' | 5,00% | 4.320.000,00 | 0,24% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 84.584.749,25 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 88.904.749,25 |
| Total Renda Variável | 35,00% | 466.654.129,93 | 26,24% | 7,00% | 30,00% | 50,00% | |

| Artigos - Exterior | Resolução Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2020 | | | GAP Superior |
|--------------------------|-----------------------------------|-------------|--------------|--|--------------|---------------|-----------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º - A, Inciso II | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 177.809.498,50 |
| Total Exterior | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | |



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Novembro / 2020)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 680.240.536,78 | 38,26 | 0,04 |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 560.558.265,95 | 31,53 | 0,10 |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT | 234.544.202,15 | 13,19 | 0,03 |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM... | 177.940.460,54 | 10,01 | 0,04 |
| ITAU UNIBANCO | 69.037.774,60 | 3,88 | 0,00 |
| ITAU DTVM | 55.773.744,98 | 3,14 | 0,00 |

Artigo 14º - 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)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos | Estratégia de Alocação - 2020 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira \$ | Carteira % | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 958.562.381,82 | 53,91 | 15,00 | 90,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 352.878.473,25 | 19,85 | 10,00 | 40,00 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a ' | 71.733.472,27 | 4,03 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 274.535.974,83 | 15,44 | 7,00 | 20,00 |
| Artigo 8º, Inciso III | 116.064.682,83 | 6,53 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 4.320.000,00 | 0,24 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 9º - A, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2020 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|--------|--------|-------|-------|--------|---------|------------------|
| IMA Geral ex-C (Benchmark) | 0,70% | 2,67% | -0,02% | 1,86% | 3,60% | 17,00% | - | - |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,85% | 2,65% | 0,02% | 1,84% | 3,63% | 17,42% | 0,01% | 0,04% |
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 1,25% | 6,77% | 1,31% | 4,33% | 8,05% | 20,89% | - | - |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,34% | 6,29% | 1,79% | 4,57% | 7,52% | 19,65% | 0,01% | 0,03% |
| IMA-B 5+ (Benchmark) | 2,59% | -1,87% | 0,14% | 6,53% | 0,68% | 30,33% | - | - |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,49% | -2,25% | -0,01% | 6,20% | 0,41% | 29,47% | 0,04% | 0,15% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 1,32% | 6,10% | 1,40% | 3,99% | 7,41% | 21,69% | - | - |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 1,30% | 5,92% | 1,34% | 3,83% | 7,21% | 21,19% | 0,01% | 0,03% |
| IMA-B (Benchmark) | 2,00% | 1,48% | 0,67% | 5,31% | 3,52% | 26,83% | - | - |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 2,01% | 1,29% | 0,47% | 5,20% | 3,33% | 26,56% | 0,02% | 0,10% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,35% | 5,56% | 1,27% | 3,75% | 6,81% | 21,99% | 0,01% | 0,03% |
| CDI (Benchmark) | 0,15% | 2,59% | 0,46% | 1,03% | 2,97% | 9,24% | - | - |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 0,16% | 2,14% | 0,34% | 1,02% | 2,50% | 8,51% | 0,00% | 0,00% |
| IPCA (Benchmark) | 0,89% | 3,13% | 2,41% | 3,29% | 4,31% | 7,73% | - | - |

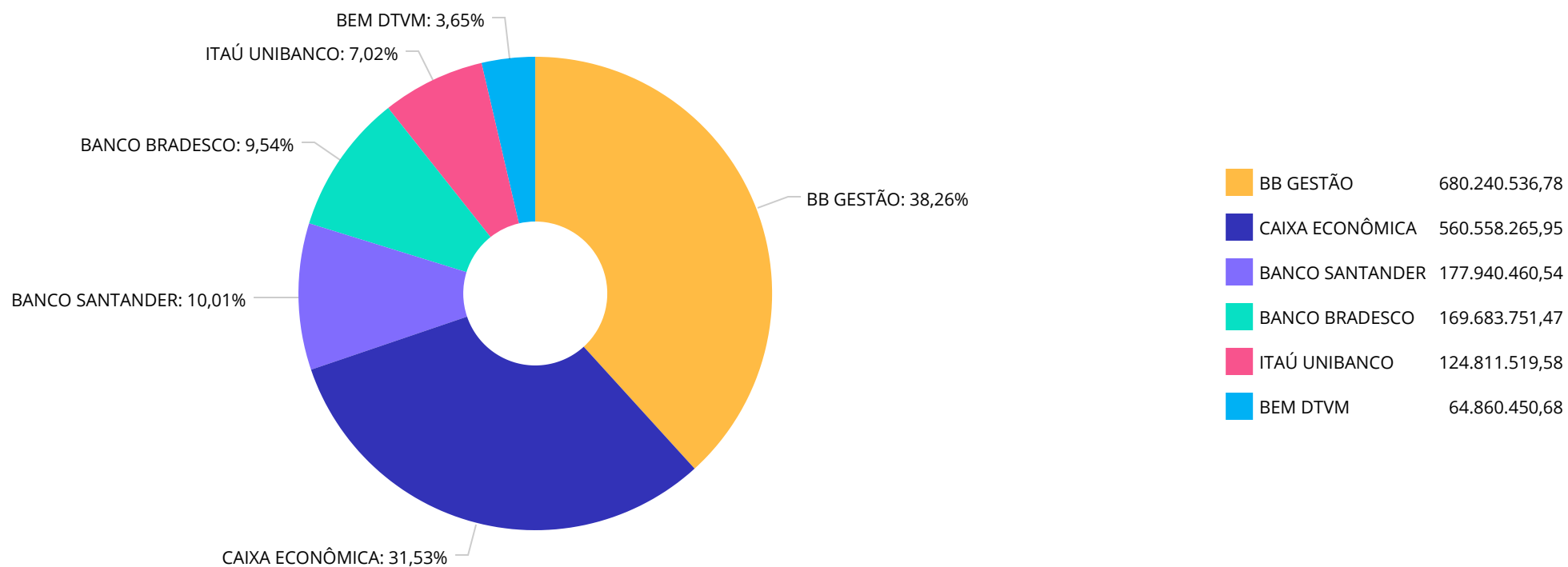
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2020 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|-------|--------|-------|-------|--------|---------|------------------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,29% | 5,22% | 1,47% | 3,76% | 6,37% | 20,22% | 0,01% | 0,03% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 0,82% | 5,27% | 0,21% | 1,37% | 5,90% | 24,20% | 0,01% | 0,02% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,78% | 2,13% | -0,49% | 1,30% | 3,00% | 16,24% | 0,01% | 0,04% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,01% | - | 0,05% | 1,86% | - | - | 0,01% | - |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 0,68% | - | -0,03% | 1,22% | - | - | 0,00% | - |

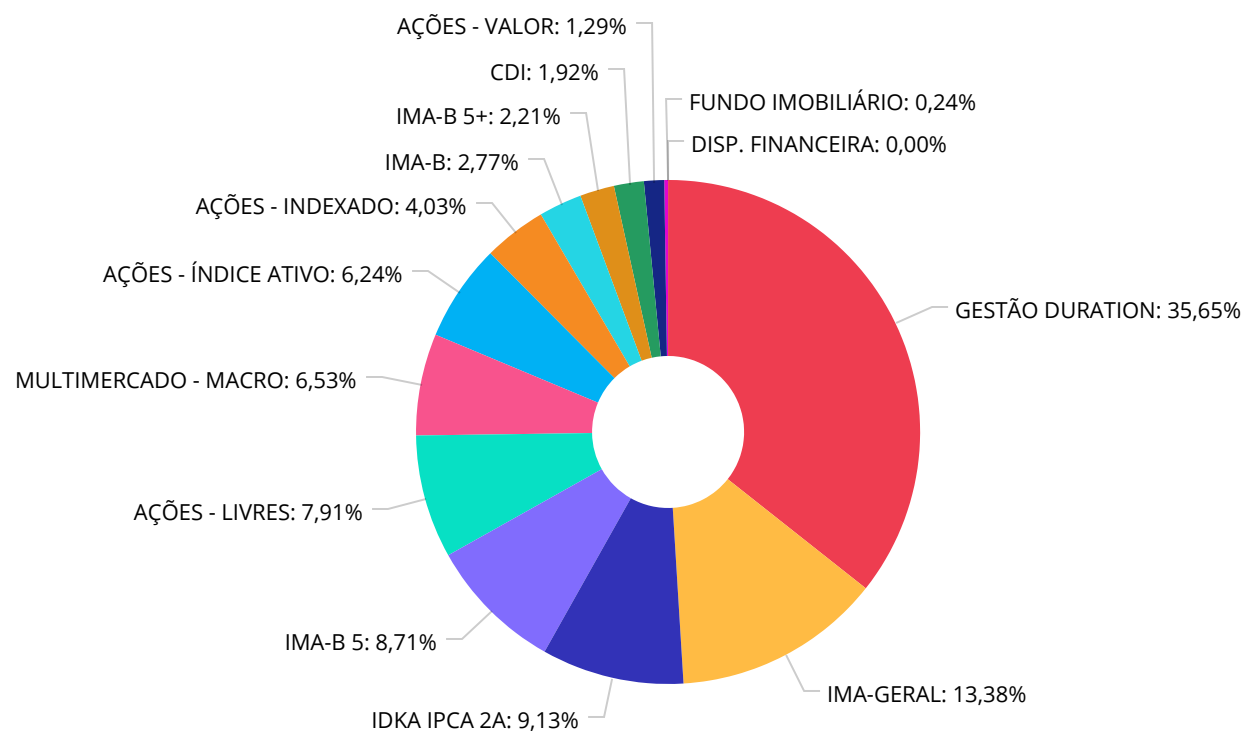
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| Ibovespa (Benchmark) | 15,90% | -5,84% | 9,58% | 24,59% | 0,61% | 21,66% | - | - |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 13,75% | -5,74% | 7,45% | 22,78% | 2,06% | 27,36% | 0,10% | 0,43% |
| BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES | 15,87% | -6,14% | 9,50% | 24,36% | 0,35% | 21,10% | 0,11% | 0,42% |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES | 15,76% | -5,95% | 9,50% | 24,20% | 0,49% | 21,06% | 0,11% | 0,42% |
| SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES | 12,66% | -12,72% | 5,74% | 23,61% | -5,90% | 16,49% | 0,10% | 0,44% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 13,92% | -27,04% | 0,40% | 14,40% | -19,60% | 5,77% | 0,11% | 0,53% |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | 8,20% | -10,73% | 8,74% | 28,88% | -4,31% | 14,22% | 0,12% | 0,41% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 12,28% | -10,51% | 7,24% | 25,78% | -3,23% | 29,97% | 0,10% | 0,43% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 12,53% | -6,01% | 4,45% | 21,02% | 2,73% | - | 0,09% | 0,44% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES | 11,76% | -0,16% | 6,37% | 24,95% | 8,10% | - | 0,09% | 0,42% |
| CDI (Benchmark) | 0,15% | 2,59% | 0,46% | 1,03% | 2,97% | 9,24% | - | - |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 2,84% | 1,79% | 1,56% | 4,14% | 3,91% | 21,35% | 0,02% | 0,08% |
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | -3,36% | -90,34% | -90,71% | -88,92% | -89,37% | -85,83% | 0,24% | 0,54% |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | 11,70% | -10,60% | 5,45% | 17,09% | -1,92% | 30,56% | 0,09% | 0,40% |

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Novembro / 2020)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Novembro / 2020)

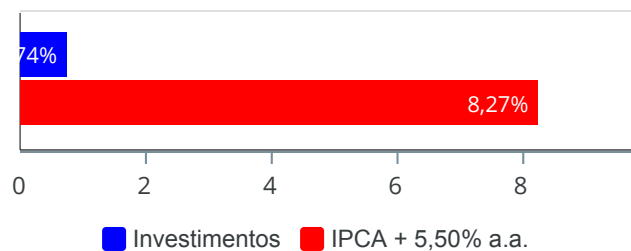


| | | |
|--|----------------------|----------------|
| ■ | GESTÃO DURATION | 633.865.983,73 |
| ■ | IMA-GERAL | 237.840.711,74 |
| ■ | IDKA IPCA 2A | 162.274.934,54 |
| ■ | IMA-B 5 | 154.958.488,26 |
| ■ | AÇÕES - LIVRES | 140.685.571,13 |
| ■ | MULTIMERCADO - MACRO | 116.064.682,83 |
| ■ | AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 110.868.431,42 |
| ■ | AÇÕES - INDEXADO | 71.733.472,27 |
| ■ | IMA-B | 49.201.541,94 |
| ■ | IMA-B 5+ | 39.219.488,86 |
| ■ | CDI | 34.079.706,00 |
| ■ | AÇÕES - VALOR | 22.981.972,28 |
| ■ | FUNDO IMOBILIÁRIO | 4.320.000,00 |
| ■ | DISP. FINANCEIRA | 10.470,66 |

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

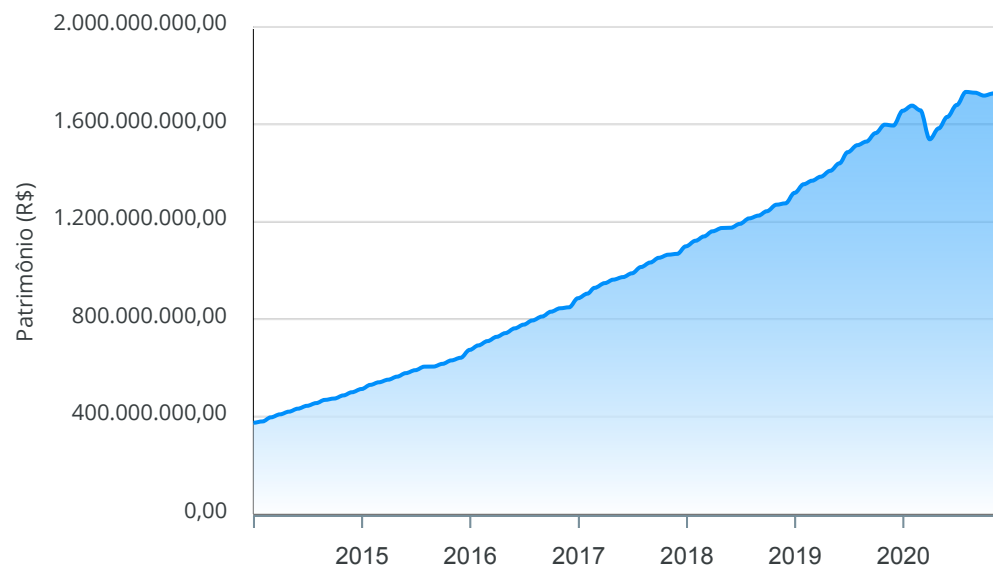
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|------------------|----------------|----------------|------------------|-----------------|-----------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|--------|
| Janeiro | 1.655.970.751,91 | 76.397.834,19 | 62.235.689,14 | 1.677.009.447,11 | 6.876.550,15 | 6.876.550,15 | 0,41% | 0,41% | 0,68% | 0,68% | 60,59% | 2,23% |
| Fevereiro | 1.677.009.447,11 | 128.675.471,57 | 120.291.280,36 | 1.657.734.658,46 | -27.658.979,86 | -20.782.429,71 | -1,64% | -1,24% | 0,63% | 1,32% | -93,79% | 4,19% |
| Março | 1.657.734.658,46 | 35.804.014,65 | 24.197.800,52 | 1.538.967.401,37 | -130.373.471,22 | -151.155.900,93 | -7,81% | -8,95% | 0,54% | 1,86% | -480,15% | 13,97% |
| Abril | 1.538.967.401,37 | 36.330.256,43 | 25.391.518,98 | 1.583.496.847,29 | 33.590.708,47 | -117.565.192,46 | 2,17% | -6,98% | 0,11% | 1,98% | -352,24% | 7,19% |
| Mai | 1.583.496.847,29 | 35.334.374,63 | 24.492.500,00 | 1.630.611.986,65 | 36.273.264,73 | -81.291.927,73 | 2,28% | -4,86% | 0,04% | 2,03% | -239,91% | 3,70% |
| Junho | 1.630.611.986,65 | 40.340.352,08 | 29.585.698,85 | 1.679.514.666,35 | 38.148.026,47 | -43.143.901,26 | 2,32% | -2,65% | 0,71% | 2,75% | -96,37% | 3,12% |
| Julho | 1.679.514.666,35 | 49.226.479,64 | 38.768.420,00 | 1.733.315.132,21 | 43.342.406,22 | 198.504,96 | 2,56% | 0,01% | 0,85% | 3,62% | -4,19% | 2,57% |
| Agosto | 1.733.315.132,21 | 451.867.466,77 | 441.118.818,81 | 1.730.016.068,62 | -14.047.711,55 | -13.849.206,59 | -0,81% | -0,96% | 0,69% | 4,34% | -22,05% | 2,69% |
| Setembro | 1.730.016.068,62 | 48.916.739,23 | 38.797.794,39 | 1.717.597.036,09 | -22.537.977,37 | -36.387.183,96 | -1,30% | -2,24% | 1,09% | 5,47% | -40,90% | 3,54% |
| Outubro | 1.717.597.036,09 | 37.004.709,96 | 26.452.738,39 | 1.726.054.922,24 | -2.094.085,42 | -38.481.269,38 | -0,12% | -2,36% | 1,31% | 6,86% | -34,38% | 3,23% |
| Novembro | 1.726.054.922,24 | 35.388.161,31 | 38.029.596,09 | 1.778.094.985,00 | 54.681.497,54 | 16.200.228,16 | 3,17% | 0,74% | 1,32% | 8,27% | 8,90% | 3,00% |

Investimentos x Meta Atuarial



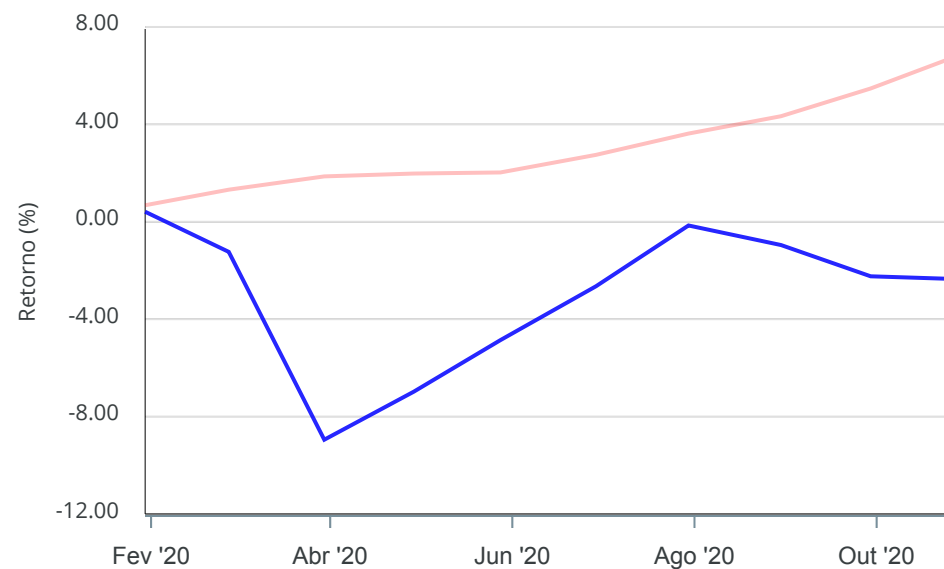
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- ☒ Investimentos ☒ Meta Atuarial ☐ 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 Novembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|-------------------------|----------------------|----------------------|-------------------------|----------------------|--------------|------------|--------------|
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 38.265.108,87 | 0,00 | 0,00 | 39.219.488,86 | 954.379,99 | 2,49% | 2,49% | 3,64% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 16.494.913,14 | 0,00 | 0,00 | 16.826.481,94 | 331.568,80 | 2,01% | 2,01% | 2,37% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 21.597.493,32 | 0,00 | 0,00 | 21.888.769,54 | 291.276,22 | 1,35% | 1,35% | 0,95% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 150.472.710,98 | 9.873.661,31 | 200.000,00 | 162.274.934,54 | 2.128.562,25 | 1,33% | 1,34% | 0,73% |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 152.971.873,96 | 0,00 | 0,00 | 154.958.488,26 | 1.986.614,30 | 1,30% | 1,30% | 0,88% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE... | 10.352.908,60 | 0,00 | 0,00 | 10.486.290,46 | 133.381,86 | 1,29% | 1,29% | 0,80% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 147.358.156,05 | 0,00 | 0,00 | 148.843.196,54 | 1.485.040,49 | 1,01% | 1,01% | 1,46% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 235.840.897,19 | 0,00 | 0,00 | 237.840.711,74 | 1.999.814,55 | 0,85% | 0,85% | 1,30% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 329.194.364,69 | 0,00 | 0,00 | 331.893.698,42 | 2.699.333,73 | 0,82% | 0,82% | 0,87% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 127.719.447,60 | 0,00 | 0,00 | 128.719.765,28 | 1.000.317,68 | 0,78% | 0,78% | 1,46% |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 24.245.615,13 | 0,00 | 0,00 | 24.409.323,49 | 163.708,36 | 0,68% | 0,68% | 0,43% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 46.310.962,06 | 25.514.500,00 | 37.808.596,09 | 34.079.706,00 | 62.840,03 | 0,09% | 0,16% | 0,03% |
| Total Renda Fixa | 1.300.824.451,59 | 35.388.161,31 | 38.008.596,09 | 1.311.440.855,07 | 13.236.838,26 | 0,99% | | 1,13% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Novembro/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|--|-----------------------|-------------|------------------|-----------------------|----------------------|--------------|------------|--------------|
| BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES | 20.831.739,90 | 0,00 | 0,00 | 24.137.504,25 | 3.305.764,35 | 15,87% | 15,87% | 10,72% |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES | 41.116.132,90 | 0,00 | 0,00 | 47.595.968,02 | 6.479.835,12 | 15,76% | 15,76% | 10,65% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 15.593.896,78 | 0,00 | 0,00 | 17.764.632,49 | 2.170.735,71 | 13,92% | 13,92% | 11,36% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 40.446.111,59 | 0,00 | 0,00 | 46.007.980,74 | 5.561.869,15 | 13,75% | 13,75% | 9,55% |
| SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES | 20.399.935,22 | 0,00 | 0,00 | 22.981.972,28 | 2.582.037,06 | 12,66% | 12,66% | 9,57% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 32.234.980,78 | 0,00 | 0,00 | 36.274.593,19 | 4.039.612,41 | 12,53% | 12,53% | 9,22% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 45.666.273,54 | 0,00 | 0,00 | 51.273.142,11 | 5.606.868,57 | 12,28% | 12,28% | 9,79% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES | 8.738.469,51 | 0,00 | 0,00 | 9.765.764,24 | 1.027.294,73 | 11,76% | 11,76% | 9,45% |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | 22.925.150,05 | 0,00 | 0,00 | 25.607.439,10 | 2.682.289,05 | 11,70% | 11,70% | 9,10% |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES | 59.947.957,43 | 0,00 | 0,00 | 64.860.450,68 | 4.912.493,25 | 8,19% | 8,19% | 11,60% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 112.859.822,95 | 0,00 | 0,00 | 116.064.682,83 | 3.204.859,88 | 2,84% | 2,84% | 1,74% |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 4.470.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 4.320.000,00 | -129.000,00 | -2,89% | -3,36% | 24,33% |
| Total Renda Variável | 425.230.470,65 | 0,00 | 21.000,00 | 466.654.129,93 | 41.444.659,28 | 9,75% | | 8,25% |

| CN-SIPPM | MUNICIPIO DE SOROCABA RELATORIO RESUMIDO DA EXECUCAO ORCAMENTARIA BALANCO ORCAMENTARIO ORCAMENTOS FISCAL E DA SEGURIDADE SOCIAL FUNDACAO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS S.P.M.SOROCABA Periodo de Referencia: NOVEMBRO 2020 | | | | | | | | CONAM |
|--|--|-------------------------------|---------------------|------------|------------------|------------|----------------|--|----------|
| RREO - ANEXO 1 (LRF, Art. 52, inciso I, alíneas "a" e "b" do inciso II e paragrafo 1o) | | | | | | | | | Em Reais |
| RECEITAS | PREVISAO INICIAL | PREVISAO ATUALIZADA (a) | RECEITAS REALIZADAS | | | | SALDO (a-c) | | |
| | | | No Mes (b) | % (b/a) | Ate o Mes (c) | % (c/a) | | | |
| RECEITAS (EXCETO INTRA-ORCAMENTARIAS) (I) | 184.238.500,00 | 132.780.653,08 | 7.880.754,50 | 5,93 | 121.761.522,14 | 91,70 | 11.019.130,94 | | |
| RECEITAS CORRENTES | 184.238.500,00 | 132.780.653,08 | 7.880.754,50 | 5,93 | 121.761.522,14 | 91,70 | 11.019.130,94 | | |
| contribuicoes | 86.445.500,00 | 74.684.861,96 | 6.041.089,88 | 8,08 | 66.459.660,84 | 88,98 | 8.225.201,12 | | |
| contribuicoes sociais | 86.445.500,00 | 74.684.861,96 | 6.041.089,88 | 8,08 | 66.459.660,84 | 88,98 | 8.225.201,12 | | |
| receita patrimonial | 74.745.000,00 | 37.899.170,06 | 51.102,28 | 0,13 | 38.403.379,44 | 101,33 | -504.209,38 | | |
| exploracao do patrimonio imobiliario do estado | 35.000,00 | 25.362,42 | 1.206,00 | 4,75 | 20.491,42 | 80,79 | 4.871,00 | | |
| valores mobiliarios | 74.710.000,00 | 37.873.807,64 | 49.896,28 | 0,13 | 38.382.888,02 | 101,34 | -509.080,38 | | |
| outras receitas correntes | 23.048.000,00 | 20.196.621,06 | 1.788.562,34 | 8,85 | 16.898.481,86 | 83,66 | 3.298.139,20 | | |
| indenizacoes, restituicoes e ressarcimentos | 45.000,00 | 492.641,71 | 40.984,10 | 8,31 | 494.752,51 | 100,42 | -2.110,80 | | |
| demais receitas correntes | 23.003.000,00 | 19.703.979,35 | 1.747.578,24 | 8,86 | 16.403.729,35 | 83,25 | 3.300.250,00 | | |
| RECEITAS (INTRA-ORCAMENTARIAS) (II) | 152.604.000,00 | 131.904.905,64 | 10.277.235,23 | 7,79 | 113.627.646,73 | 86,14 | 18.277.258,91 | | |
| SUBTOTAL DAS RECEITAS (III)=(I+II) | 336.842.500,00 | 264.685.558,72 | 18.157.989,73 | 6,86 | 235.389.168,87 | 88,93 | 29.296.389,85 | | |
| OPERACOES DE CREDITO/ REFINANCIAMENTO (IV) | | | | | | | | | |
| Operacoes de Credito - Mercado Interno | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| Mobiliaria | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| Contratual | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| Operacoes de Credito - Mercado Externo | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| Mobiliaria | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| Contratual | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | |
| TOTAL DAS RECEITAS (V) = (III + IV) | 336.842.500,00 | 264.685.558,72 | 18.157.989,73 | 6,86 | 235.389.168,87 | 88,93 | 29.296.389,85 | | |
| DEFICIT (VI)1 | | | | | 66.499.201,21 | | | | |
| TOTAL COM DEFICIT (VII) = (V + VI) | 336.842.500,00 | 264.685.558,72 | 18.157.989,73 | 6,86 | 301.888.370,08 | 114,05 | -37.202.811,36 | | |
| SALDOS DE EXERCICIOS ANTERIORES | | 0,00 | | | 0,00 | | | | |
| recursos arrecadados em exercicios anteriores - RPPS | | 0,00 | | | 0,00 | | | | |
| superavit financeiro utilizado para creditos adicionais | | 0,00 | | | 0,00 | | | | |

| CN-SIFPM | MUNICIPIO DE SOROCABA RELATORIO RESUMIDO DA EXECUCAO ORCAMENTARIA BALANCO ORCAMENTARIO ORCAMENTOS FISCAL E DA SEGURIDADE SOCIAL FUNDACAO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS S.P.M.SOROCABA Periodo de Referencia: NOVEMBRO 2020 | | | | | | | | | | CONAM |
|--|--|-----------------------|---------------------|------------------|------------------------|---------------------|------------------|------------------------|--|--|----------|
| RREO - ANEXO 1 (LRF, Art. 52, inciso I, alíneas "a" e "b" do inciso II e paragrafo 1o) | | | | | | | | | | | Em Reais |
| DESPESAS | DOTACAO INICIAL | DOTACAO ATUALIZADA | DESPESAS EMPENHADAS | | SALDO (g)=(e-f) | DESPESAS LIQUIDADAS | | SALDO (i)=(e-h) | DESPESAS PAGAS Ate o Mes (j) | INSCRITAS EM RESTOS A PAGAR NAO PROCESSADOS (k) | |
| | | | No Mes | Ate o Mes (f) | | No Mes | Ate o Mes (h) | | | | |
| | (d) | (e) | | (f) | (g)=(e-f) | | (h) | (i)=(e-h) | (j) | (k) | |
| DESPESAS (EXCETO INTRA-ORCAMENTARIAS) (VIII) | 360.253.000,00 | 360.103.000,00 | 8.327.239,96 | 306.278.923,77 | 53.824.076,23 | 39.929.440,85 | 301.444.381,86 | 58.658.618,14 | 301.347.038,76 | 0,00 | |
| DESPESAS CORRENTES | | | | | | | | | | | |
| pessoal e encargos sociais | 357.732.000,00 | 357.702.000,00 | 8.306.756,20 | 304.802.109,63 | 52.899.890,37 | 39.818.012,51 | 300.191.175,54 | 57.510.824,46 | 300.126.339,76 | 0,00 | |
| outras despesas correntes | 2.271.000,00 | 2.151.000,00 | 20.483,76 | 1.476.814,14 | 674.185,86 | 111.428,34 | 1.253.206,32 | 897.793,68 | 1.220.699,00 | 0,00 | |
| DESPESAS DE CAPITAL | | | | | | | | | | | |
| investimentos | 250.000,00 | 250.000,00 | 0,00 | 0,00 | 250.000,00 | 0,00 | 0,00 | 250.000,00 | 0,00 | 0,00 | |
| RESERVA DE CONTINGENCIA | | | | | | | | | | | |
| reserva de contingencia | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| DESPESAS (INTRA-ORCAMENTARIAS) (IX) | 470.000,00 | 620.000,00 | 11.230,70 | 477.788,67 | 142.211,33 | 40.854,04 | 443.988,22 | 176.011,78 | 399.895,03 | 0,00 | |
| SUBTOTAL DAS DESPESAS (X)=(VIII + IX) | 360.723.000,00 | 360.723.000,00 | 8.338.470,66 | 306.756.712,44 | 53.966.287,56 | 39.970.294,89 | 301.888.370,08 | 58.834.629,92 | 301.746.933,79 | 0,00 | |
| AMORTIZACAO DA DIVIDA/ REFINANCIAMENTO(XI) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Amortizacao da Divida Interna | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Divida Mobiliaria | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Divida Contratual | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Amortizacao da Divida Externa | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Divida Mobiliaria | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| Divida Contratual | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | |
| TOTAL DAS DESPESAS (XII) = (X + XI) | 360.723.000,00 | 360.723.000,00 | 8.338.470,66 | 306.756.712,44 | 53.966.287,56 | 39.970.294,89 | 301.888.370,08 | 58.834.629,92 | 301.746.933,79 | 0,00 | |
| SUPERAVIT (XIII) | | | | | | | 0,00 | | | | |
| TOTAL (XIV) = (XII + XIII) | 360.723.000,00 | 360.723.000,00 | 8.338.470,66 | 306.756.712,44 | 53.966.287,56 | 39.970.294,89 | 301.888.370,08 | 58.834.629,92 | 301.746.933,79 | 0,00 | |
| RESERVA DO RPPS | 210.011.500,00 | 210.011.500,00 | | | 210.011.500,00 | | | 210.011.500,00 | | | |

| | | | | | | | | | |
|--|--|-------------------------|---------------------|---------|----------------|---------|---------------|--|----------|
| CN-SIPPM | MUNICIPIO DE SOROCABA RELATORIO RESUMIDO DA EXECUCAO ORCAMENTARIA BALANCO ORCAMENTARIO ORCAMENTOS FISCAL E DA SEGURIDADE SOCIAL FUNDAÇAO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS S.P.M.SOROCABA Periodo de Referencia: NOVEMBRO 2020 | | | | | | | | CONAM |
| RREO - ANEXO 1 (LRF, Art. 52, inciso I, alíneas "a" e "b" do inciso II e paragrafo 1o) | | | | | | | | | Em Reais |
| RECEITAS INTRA-ORCAMENTARIAS | PREVISAO INICIAL | PREVISAO ATUALIZADA (a) | RECEITAS REALIZADAS | | | | SALDO (a-c) | | |
| | | | No Mes (b) | % (b/a) | Ate o Mes (c) | % (c/a) | | | |
| RECEITAS CORRENTES - INTRA OFSS | 152.604.000,00 | 131.904.905,64 | 10.277.235,23 | 7,79 | 113.627.646,73 | 86,14 | 18.277.258,91 | | |
| contribuicoes - intra ofss | 152.600.000,00 | 131.904.896,64 | 10.277.235,23 | 7,79 | 113.627.646,73 | 86,14 | 18.277.249,91 | | |
| contribuicoes sociais(i) | 152.600.000,00 | 131.904.896,64 | 10.277.235,23 | 7,79 | 113.627.646,73 | 86,14 | 18.277.249,91 | | |
| outras receitas correntes - intra ofss | 4.000,00 | 9,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9,00 | | |
| demais receitas correntes(i) | 4.000,00 | 9,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 9,00 | | |
| TOTAL DAS RECEITAS INTRA-ORCAMENTARIAS | 152.604.000,00 | 131.904.905,64 | 10.277.235,23 | 7,79 | 113.627.646,73 | 86,14 | 18.277.258,91 | | |

| DESPESAS INTRA-ORCAMENTARIAS | DOTACAO INICIAL (d) | DOTACAO ATUALIZADA (e) | DESPESAS EMPENHADAS | | SALDO (g)=(e-f) | DESPESAS LIQUIDADAS | | SALDO (i)=(e-h) | DESPESAS PAGAS (j) | INSCRITAS EM RESTOS A PAGAR NAO PROCESSADOS (k) |
|--|---------------------|------------------------|---------------------|---------------|-----------------|---------------------|---------------|-----------------|--------------------|---|
| | | | No Mes | Ate o Mes (f) | | No Mes | Ate o Mes (h) | | | |
| DESPESAS CORRENTES | | | | | | | | | | |
| pessoal e encargos sociais | 470.000,00 | 620.000,00 | 11.230,70 | 477.788,67 | 142.211,33 | 40.854,04 | 443.988,22 | 176.011,78 | 399.895,03 | 0,00 |
| TOTAL DAS DESPESAS INTRA-ORCAMENTARIAS | 470.000,00 | 620.000,00 | 11.230,70 | 477.788,67 | 142.211,33 | 40.854,04 | 443.988,22 | 176.011,78 | 399.895,03 | 0,00 |




CONAM-RRE01-2020-1.0





NOTAS:
1. O deficit sera apurado pela diferenca entre a receita realizada e a despesa liquidada nos cinco primeiros bimestres e a despesa empenhada no ultimo bimestre.

SILVANA MARIA SINISCALCO D CHINELATTO
PRESIDENTE
CPF-122.616.658-06

JOSE ANTONIO DE OLIVEIRA JUNIOR
DIRETOR ADMINISTRATIVO E FINANCEIRO
CPF-122.596.828-39

Quadro Resumo






XLS | CSV | TXT | XML





Download

| IMA - Índice de Mercado ANBIMA | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------------------|--------------------|---------------|---------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|----------|-----------------|------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------------|-------|-------------|--------|------------------|
| Índice | Data de Referência | Número Índice | Variação Diária (%) | Variação no Mês (%) | Variação no Ano (%) | Variação 12 Meses (%) | Variação 24 Meses (%) | Peso (%) | Duration (d.u.) | Carteira a Mercado (R\$ mil) | Número de Operações * | Quant. Negociada (1.000 títulos) * | Valor Negociado (R\$ mil) * | PMR | Convexidade | Yield | Redemption Yield |
| IRF-M 1 | 02/12/2020 | 11.619,492091 | 0,0301 | 0,0865 | 3,6102 | 4,0329 | 11,2300 | 14,06 | 112 | 657.122.475 | 88 | 5.385,17 | 5.335.027,62 | 164 | 0,6769 | 2,2607 | 2,4238 |
| IRF-M 1+ | 02/12/2020 | 16.148,329366 | 0,3942 | 0,9331 | 6,2255 | 7,1209 | 23,6856 | 21,12 | 704 | 986.844.887 | 366 | 13.708,75 | 12.116.367,55 | 1.054 | 12,0112 | 5,4118 | 5,9572 |
| IRF-M | 02/12/2020 | 14.247,260705 | 0,2484 | 0,5978 | 5,2749 | 6,0146 | 19,7487 | 35,18 | 468 | 1.643.967.362 | 454 | 19.093,92 | 17.451.395,17 | 698 | 7,4807 | 4,1523 | 5,6180 |
| IMA-B 5 | 02/12/2020 | 6.876,237293 | 0,1176 | 0,3989 | 6,5209 | 7,9398 | 22,1758 | 11,87 | 572 | 554.526.212 | 1.431 | 12.806,79 | 48.652.717,42 | 836 | 8,7477 | 0,2874 | 1,1264 |
| IMA-B 5+ | 02/12/2020 | 9.527,307726 | 0,4639 | 1,6244 | -0,2776 | 2,6341 | 32,4492 | 13,87 | 3.204 | 648.187.646 | 493 | 565,06 | 2.357.773,07 | 5.584 | 236,2787 | 3,7910 | 3,9259 |
| IMA-B | 02/12/2020 | 7.833,810253 | 0,3039 | 1,0557 | 2,5518 | 4,8336 | 28,1675 | 25,74 | 1.990 | 1.202.713.858 | 1.924 | 13.371,85 | 51.010.490,49 | 3.395 | 131,3727 | 2,1757 | 3,5549 |
| IMA-C | 02/12/2020 | 9.508,051273 | 0,1645 | 0,5051 | 24,0666 | 24,6397 | 49,2915 | 3,04 | 1.237 | 142.052.565 | -- | -- | -- | 1.895 | 43,7864 | 1,2420 | 3,1225 |
| IMA-S | 02/12/2020 | 4.766,944463 | 0,0103 | 0,0192 | 2,0702 | 2,4351 | 8,7159 | 36,05 | 1 | 1.684.464.640 | 241 | 305,07 | 3.262.566,32 | 1 | 0,0000 | -- | -- |
| IMA-GERAL ex-C | 02/12/2020 | 6.067,238713 | 0,1744 | 0,5034 | 3,1849 | 4,2054 | 17,5848 | 96,96 | 698 | 4.531.145.860 | 2.619 | 32.770,84 | 71.724.451,98 | 1.155 | 37,5847 | -- | -- |
| IMA-GERAL | 02/12/2020 | 6.161,629311 | 0,1741 | 0,5035 | 3,7664 | 4,7771 | 18,4376 | 100,00 | 715 | 4.673.198.426 | 2.619 | 32.770,84 | 71.724.451,98 | 1.177 | 37,7732 | -- | -- |

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios
Fonte: ANBIMA

Quadro Resumo



XLS | CSV | TXT | XML

Download

Quadro Resumo



XLS

CSV

TXT

XML

Download

IMA - Índice de Mercado ANBIMA

| Índice | Data de Referência | Número Índice | Variação Diária (%) | Variação no Mês (%) | Variação no Ano (%) | Variação 12 Meses (%) | Variação 24 Meses (%) | Peso (%) | Duration (d.u.) | Carteira a Mercado (R\$ mil) | Número de Operações * | Quant. Negociada (1.000 títulos) * | Valor Negociado (R\$ mil) * | PMR | Convexidade | Yield | Redemption Yield |
|----------------|--------------------|---------------|---------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|----------|-----------------|------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------------|-------|-------------|--------|------------------|
| IRF-M 1 | 03/12/2020 | 11.621,739221 | 0,0193 | 0,1058 | 3,6302 | 4,0224 | 11,2167 | 14,01 | 111 | 657.249.558 | -- | -- | -- | 163 | 0,6701 | 2,2412 | 2,4010 |
| IRF-M 1+ | 03/12/2020 | 16.256,868901 | 0,6721 | 1,6115 | 6,9395 | 7,6209 | 24,4929 | 21,18 | 706 | 993.477.875 | -- | -- | -- | 1.056 | 12,1327 | 5,2076 | 5,7186 |
| IRF-M | 03/12/2020 | 14.305,846115 | 0,4112 | 1,0115 | 5,7078 | 6,2932 | 20,2138 | 35,19 | 469 | 1.650.727.433 | -- | -- | -- | 700 | 7,5688 | 4,0265 | 5,4052 |
| IMA-B 5 | 03/12/2020 | 6.896,449204 | 0,2939 | 0,6940 | 6,8340 | 8,0541 | 22,4326 | 11,86 | 572 | 556.156.178 | -- | -- | -- | 836 | 8,7641 | 0,2257 | 1,0153 |
| IMA-B 5+ | 03/12/2020 | 9.659,925848 | 1,3920 | 3,0390 | 1,1105 | 3,6362 | 34,3735 | 14,01 | 3.221 | 657.210.282 | -- | -- | -- | 5.587 | 238,7546 | 3,6771 | 3,8187 |
| IMA-B | 03/12/2020 | 7.903,195388 | 0,8857 | 1,9507 | 3,4601 | 5,4314 | 29,2978 | 25,87 | 2.007 | 1.213.366.460 | -- | -- | -- | 3.409 | 133,3366 | 2,0951 | 3,4525 |
| IMA-C | 03/12/2020 | 9.524,018277 | 0,1679 | 0,6739 | 24,2749 | 24,6685 | 49,3477 | 3,03 | 1.237 | 142.291.116 | -- | -- | -- | 1.895 | 43,7831 | 1,1908 | 3,1071 |
| IMA-S | 03/12/2020 | 4.767,363272 | 0,0088 | 0,0280 | 2,0791 | 2,4246 | 8,6987 | 35,91 | 1 | 1.684.612.632 | -- | -- | -- | 1 | 0,0000 | -- | -- |
| IMA-GERAL ex-C | 03/12/2020 | 6.090,752578 | 0,3876 | 0,8929 | 3,5848 | 4,4598 | 18,0190 | 96,97 | 706 | 4.548.706.526 | -- | -- | -- | 1.164 | 38,3142 | -- | -- |
| IMA-GERAL | 03/12/2020 | 6.185,097643 | 0,3809 | 0,8863 | 4,1616 | 5,0259 | 18,8632 | 100,00 | 722 | 4.690.997.642 | -- | -- | -- | 1.186 | 38,4801 | -- | -- |

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios
Fonte: ANBIMA

Quadro Resumo



XLS

CSV





TXT





XML

Download

IMA - Índice de Mercado ANBIMA

Quadro Resumo

  |  





XLS  | CSV  | TXT  | XML 





Download

| IMA - Índice de Mercado ANBIMA | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--------------------------------|--------------------|---------------|---------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|----------|-----------------|------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------------|-------|-------------|--------|-----|
| Índice | Data de Referência | Número Índice | Variação Diária (%) | Variação no Mês (%) | Variação no Ano (%) | Variação 12 Meses (%) | Variação 24 Meses (%) | Peso (%) | Duration (d.u.) | Carteira a Mercado (R\$ mil) | Número de Operações * | Quant. Negociada (1.000 títulos) * | Valor Negociado (R\$ mil) * | PMR | Convexidade | Yield | Rec |
| IRF-M 1 | 04/12/2020 | 11.621,530127 | -0,0018 | 0,1040 | 3,6283 | 3,9872 | 11,1916 | 14,01 | 110 | 657.237.733 | -- | -- | -- | 162 | 0,6626 | 2,2581 | : |
| IRF-M 1+ | 04/12/2020 | 16.252,540933 | -0,0266 | 1,5844 | 6,9111 | 7,3764 | 24,8059 | 21,17 | 705 | 993.213.388 | -- | -- | -- | 1.055 | 12,1037 | 5,2318 | : |
| IRF-M | 04/12/2020 | 14.303,451482 | -0,0167 | 0,9946 | 5,6901 | 6,1198 | 20,4250 | 35,18 | 468 | 1.650.451.121 | -- | -- | -- | 699 | 7,5477 | 4,0477 | : |
| IMA-B 5 | 04/12/2020 | 6.899,701104 | 0,0472 | 0,7415 | 6,8844 | 7,8506 | 22,5875 | 11,86 | 571 | 556.418.424 | -- | -- | -- | 835 | 8,7452 | 0,2258 | : |
| IMA-B 5+ | 04/12/2020 | 9.664,664134 | 0,0491 | 3,0896 | 1,1601 | 3,1965 | 35,0339 | 14,02 | 3.219 | 657.532.650 | -- | -- | -- | 5.585 | 238,4942 | 3,6745 | : |
| IMA-B | 04/12/2020 | 7.907,003237 | 0,0482 | 1,9999 | 3,5099 | 5,0926 | 29,7229 | 25,87 | 2.005 | 1.213.951.074 | -- | -- | -- | 3.408 | 133,1880 | 2,0938 | : |
| IMA-C | 04/12/2020 | 9.531,044599 | 0,0738 | 0,7482 | 24,3666 | 24,6050 | 49,6007 | 3,04 | 1.236 | 142.396.091 | -- | -- | -- | 1.894 | 43,7371 | 1,1866 | : |
| IMA-S | 04/12/2020 | 4.767,901635 | 0,0113 | 0,0393 | 2,0907 | 2,4167 | 8,6841 | 35,91 | 1 | 1.684.802.870 | -- | -- | -- | 1 | 0,0000 | -- | : |
| IMA-GERAL ex-C | 04/12/2020 | 6.091,420125 | 0,0110 | 0,9040 | 3,5962 | 4,3058 | 18,1919 | 96,96 | 705 | 4.549.205.064 | -- | -- | -- | 1.163 | 38,2794 | -- | : |
| IMA-GERAL | 04/12/2020 | 6.185,893379 | 0,0129 | 0,8993 | 4,1750 | 4,8741 | 19,0382 | 100,00 | 721 | 4.691.601.156 | -- | -- | -- | 1.186 | 38,4450 | -- | : |

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios
Fonte: ANBIMA

Quadro Resumo

  |  

XLS  | CSV  | TXT  | XML 

Download

CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11

17.098.794/0001-70

Resumo

Gestão: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Início: 17/10/2013

Administrador: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Disponibilidade resgate: Não se aplica

Custodiante: Oliveira Trust

Taxa de Resgate:

Público Alvo: Investidores em geral

Taxa de Administração: 1,20%

PI (mil): R\$ 156.187,77

Benchmark: Não Informado

Aplicação Inicial:

Investidor Qualificado: Não

Mov mínima:

Data informações Carteira: 30/09/2020

Índice de Performance: Não Possui

Resolução: Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '

Comparativo (Fundo x Benchmark x Meta Atuarial)

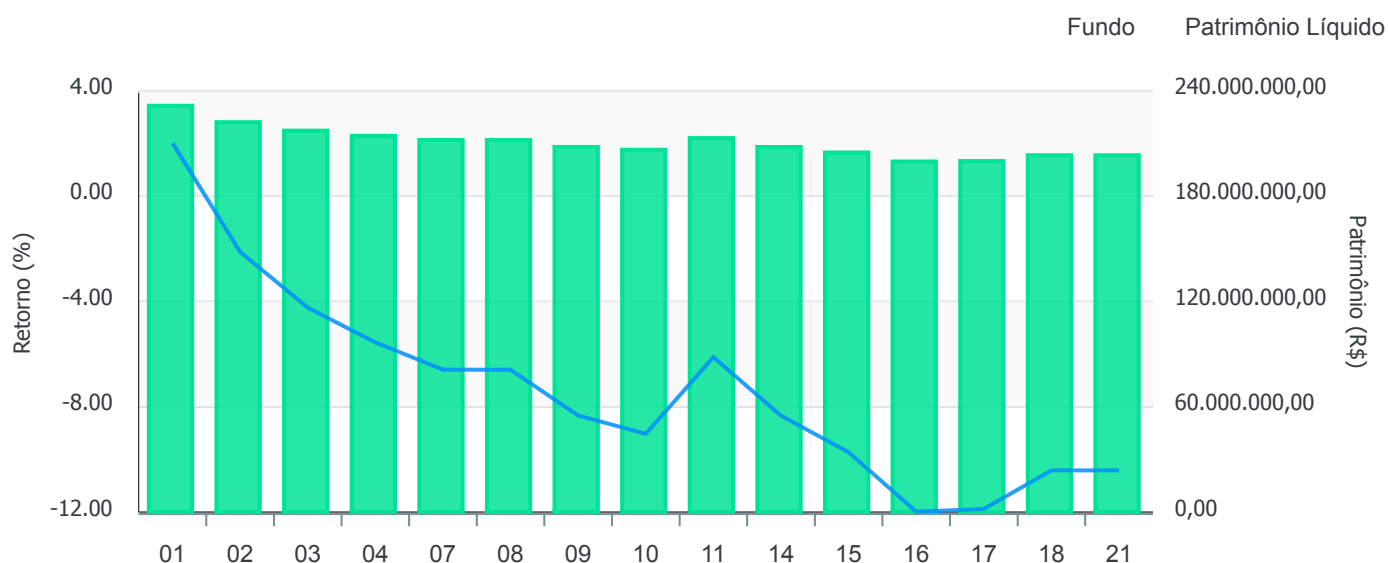
Data referência: 30/11/2020

| | Mês (%) | Ano (%) | 3 Meses (%) | 6 Meses (%) | 12 Meses (%) | 24 Meses (%) | VaR 24 Meses (%) |
|-----------------------------------|---------|---------|-------------|-------------|--------------|--------------|------------------|
| Ativo | -2,89 | 5,70 | -5,86 | 15,11 | 18,02 | 71,23 | 84,35 |
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - |
| IPCA + 5,50% a.a. (Meta Atuarial) | 1,32 | 8,27 | 3,77 | 6,12 | 10,00 | 19,85 | - |

CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11

17.098.794/0001-70

Evolução (Rentabilidade e Patrimônio Líquido): **DEZEMBRO/2020**



| Dia | Cota | Var Dia (%) | Acum. Mes (%) | P.L. (R\$) | Cotistas |
|-----|--------|-------------|---------------|----------------|----------|
| 01 | 146,90 | 2,014 | 2,014 | 231.479.144,00 | |
| 02 | 140,95 | -4,050 | -2,118 | 222.103.372,00 | |
| 03 | 137,90 | -2,164 | -4,236 | 217.297.304,00 | |
| 04 | 136,00 | -1,378 | -5,556 | 214.303.360,00 | |
| 07 | 134,51 | -1,096 | -6,590 | 211.955.477,60 | |
| 08 | 134,50 | -0,007 | -6,597 | 211.939.720,00 | |
| 09 | 132,00 | -1,859 | -8,333 | 208.000.320,00 | |
| 10 | 131,00 | -0,758 | -9,028 | 206.424.560,00 | |
| 11 | 135,19 | 3,198 | -6,118 | 213.026.994,40 | |
| 14 | 131,99 | -2,367 | -8,340 | 207.984.562,40 | |
| 15 | 129,99 | -1,515 | -9,729 | 204.833.042,40 | |
| 16 | 126,74 | -2,500 | -11,986 | 199.711.822,40 | |
| 17 | 126,89 | 0,118 | -11,882 | 199.948.186,40 | |
| 18 | 129,00 | 1,663 | -10,417 | 203.273.040,00 | |
| 21 | 129,00 | 0,000 | -10,417 | 203.273.040,00 | |

CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11

17.098.794/0001-70

Carteira do Fundo

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip (%) | Tipo Ativo | Qtde. Total | Data da Divulgação |
|---|--------------------|-----------------|------------------------|----------------|-----------------------|
| Cotas de MAXI RENDA FII - MXRF11 | R\$ 18.095,44 | 11,59% | Fundos de Investimento | 1.658.610 | 01/09/2020 |
| Cotas de RIO BRAVO RENDA CORPORATIVA FII - RCRB11 | R\$ 15.446,87 | 9,89% | Fundos de Investimento | 87.937 | 01/09/2020 |
| Cotas de RIO BRAVO RENDA EDUCACIONAL FII - RBED11 | R\$ 12.988,85 | 8,32% | Fundos de Investimento | 78.926 | 01/09/2020 |
| Cotas de RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11 | R\$ 9.071,75 | 5,81% | Fundos de Investimento | 75.661 | 01/09/2020 |
| Cotas de BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11 | R\$ 8.675,58 | 5,55% | Fundos de Investimento | 95.336 | 01/09/2020 |
| Cotas de FATOR VERITA FII - VRTA11 | R\$ 7.506,00 | 4,81% | Fundos de Investimento | 72.000 | 01/09/2020 |
| Cotas de VINCI LOGÍSTICA FII - VILG11 | R\$ 7.490,75 | 4,80% | Fundos de Investimento | 56.886 | 01/09/2020 |
| Cotas de BB RENDA DE PAPÉIS IMOBILIÁRIOS FII - RNDP11 | R\$ 6.092,21 | 3,90% | Fundos de Investimento | 7.425 | 01/09/2020 |
| Cotas de CSHG REAL ESTATE FII - HGRE11 | R\$ 5.790,30 | 3,71% | Fundos de Investimento | 38.602 | 01/09/2020 |
| Cotas de HSI MALLS FII - HSML11 | R\$ 5.559,57 | 3,56% | Fundos de Investimento | 60.188 | 01/09/2020 |
| Cotas de BLUECAP RENDA LOGÍSTICA FII - BLCP11 | R\$ 5.232,09 | 3,35% | Fundos de Investimento | 50.801 | 01/09/2020 |

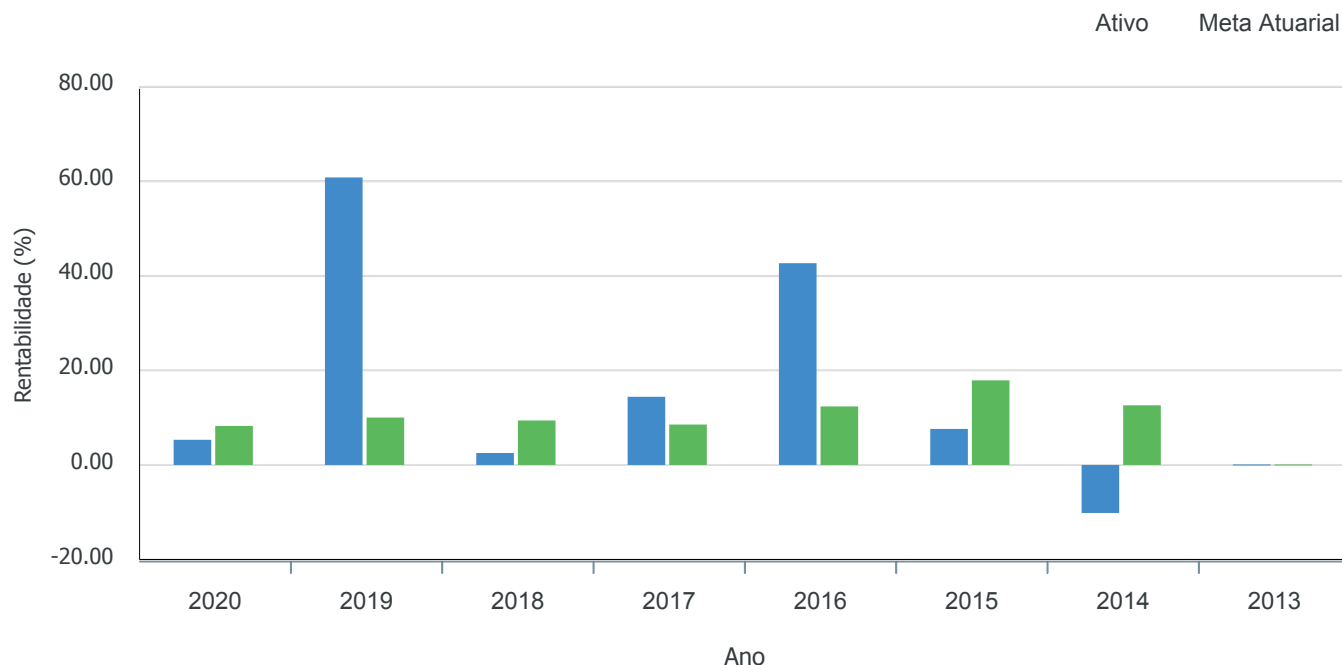
| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip (%) | Tipo Ativo | Qtde. Total | Data da Divulgação |
|--|--------------------|-----------------|-------------------------|----------------|-----------------------|
| Cotas de LEGATUS SHOPPINGS FII - LASC11 | R\$ 5.224,33 | 3,34% | Fundos de Investimento | 52.771 | 01/09/2020 |
| Cotas de VINCI SHOPPING CENTERS FII - VISC11 | R\$ 5.018,90 | 3,21% | Fundos de Investimento | 45.772 | 01/09/2020 |
| Cotas de VINCI OFFICES FII - VINO11 | R\$ 4.923,06 | 3,15% | Fundos de Investimento | 82.950 | 01/09/2020 |
| Cotas de JS REAL ESTATE MULTIGESTÃO FII - JSRE11 | R\$ 4.522,79 | 2,90% | Fundos de Investimento | 45.405 | 01/09/2020 |
| Cotas de XP MALLS FII - XPML11 | R\$ 4.452,41 | 2,85% | Fundos de Investimento | 42.412 | 01/09/2020 |
| Cotas de HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11 | R\$ 4.212,11 | 2,70% | Fundos de Investimento | 19.939 | 01/09/2020 |
| Cotas de AUTONOMY EDIFÍCIOS CORPORATIVOS FII - AIEC11 | R\$ 4.162,30 | 2,66% | Fundos de Investimento | 41.623 | 01/09/2020 |
| Cotas de VBI PRIME PROPERTIES FII - PVBI11 | R\$ 4.162,16 | 2,66% | Fundos de Investimento | 41.793 | 01/09/2020 |
| Disponibilidades - Títulos Públicos | R\$ 3.598,00 | 2,30% | Valores a pagar/receber | | 01/09/2020 |
| Cotas de KINEA RENDA IMOBILIÁRIA FII - KNRI11 | R\$ 3.240,20 | 2,07% | Fundos de Investimento | 19.634 | 01/09/2020 |
| Cotas de GUARDIAN LOGÍSTICA FII - GALG11 | R\$ 3.099,95 | 1,98% | Fundos de Investimento | 36.470 | 01/09/2020 |
| Cotas de LOFT II FII - LFTT11 | R\$ 2.430,05 | 1,56% | Fundos de Investimento | 23.824 | 01/09/2020 |
| Cotas de XP LOG FII - XPLG11 | R\$ 1.790,78 | 1,15% | Fundos de Investimento | 13.265 | 01/09/2020 |
| Cotas de KINEA RENDIMENTOS IMOBILIÁRIOS FII - KNCR11 | R\$ 1.536,96 | 0,98% | Fundos de Investimento | 17.030 | 01/09/2020 |
| Cotas de CSHG LOGÍSTICA FII - HGLG11 | R\$ 1.361,11 | 0,87% | Fundos de Investimento | 8.007 | 01/09/2020 |
| Cotas de VBI FL 4440 FII - FVBI11 | R\$ 1.328,00 | 0,85% | Fundos de Investimento | 19.064 | 01/09/2020 |
| Cotas de CSHG RENDA URBANA FII - HGRU11 | R\$ 1.160,46 | 0,74% | Fundos de Investimento | 12.595 | 01/09/2020 |
| Cotas de XP INDUSTRIAL FII - XPIN11 | R\$ 1.104,19 | 0,71% | Fundos de Investimento | 9.580 | 01/09/2020 |
| Cotas de RIO BRAVO CRÉDITO IMOBILIÁRIO II FII - RBVO11 | R\$ 1.101,00 | 0,70% | Fundos de Investimento | 50.972 | 01/09/2020 |
| Cotas de BTG PACTUAL LOGÍSTICA FII - BTLG11 | R\$ 730,70 | 0,47% | Fundos de Investimento | 11.992 | 01/09/2020 |
| Cotas de BRESKO LOGÍSTICA FII - BRCO11 | R\$ 578,32 | 0,37% | Fundos de Investimento | 4.562 | 01/09/2020 |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip (%) | Tipo Ativo | Qtde. Total | Data da Divulgação |
|---|--------------------|-----------------|-------------------------|----------------|-----------------------|
| Cotas de CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP | R\$ 344,08 | 0,22% | Fundos de Investimento | 88.853 | 01/09/2020 |
| Cotas de SDI RIO BRAVO RENDA LOGÍSTICA FII - SDIL11 | R\$ 44,26 | 0,03% | Fundos de Investimento | 438 | 01/09/2020 |
| Outras Disponibilidades | R\$ 11,15 | 0,01% | Valores a pagar/receber | | 01/09/2020 |
| Cotas de HEDGE TOP FOFII 3 FII - HFOF11 | R\$ 1,07 | 0,00% | Fundos de Investimento | 10 | 01/09/2020 |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -R\$ 155,46 | -0,10% | Valores a pagar/receber | | 01/09/2020 |
| Valores a pagar / Rendimentos a distribuir | -R\$ 1.103,00 | -0,71% | Valores a pagar/receber | | 01/09/2020 |
| Outros Valores a pagar | -R\$ 6.439,46 | -4,12% | Valores a pagar/receber | | 01/09/2020 |

CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11

17.098.794/0001-70

Histórico do Ativo na Carteira do RPPS



| 2020 | | | | | | | |
|------------------|----------------|------------|------------|--------------|---------------|-------------|----------|
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) |
| Jan | 4.469.970,00 | 0,00 | 121.500,00 | 5.250.000,00 | 901.530,00 | 20,17% | 0,68% |
| Fev | 5.250.000,00 | 0,00 | 25.500,00 | 4.422.000,00 | -802.500,00 | -15,29% | 0,63% |
| Mar | 4.422.000,00 | 0,00 | 25.500,00 | 3.509.970,00 | -886.530,00 | -20,05% | 0,54% |
| Abr | 3.509.970,00 | 0,00 | 25.500,00 | 3.754.680,00 | 270.210,00 | 7,70% | 0,11% |
| Mai | 3.754.680,00 | 0,00 | 25.500,00 | 3.900.000,00 | 170.820,00 | 4,55% | 0,04% |
| Jun | 3.900.000,00 | 0,00 | 30.000,00 | 4.680.000,00 | 810.000,00 | 20,77% | 0,71% |
| Jul | 4.680.000,00 | 0,00 | 66.420,00 | 5.190.000,00 | 576.420,00 | 12,32% | 0,85% |
| Ago | 5.190.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 4.650.000,00 | -519.000,00 | -10,00% | 0,69% |
| Set | 4.650.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 5.549.700,00 | 920.700,00 | 19,80% | 1,09% |
| Out | 5.549.700,00 | 0,00 | 21.000,00 | 4.470.000,00 | -1.058.700,00 | -19,08% | 1,31% |
| Nov | 4.470.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 4.320.000,00 | -129.000,00 | -2,89% | 1,32% |
| Acumulado no Ano | | | | | 253.950,00 | 5,32% | 8,26% |

| 2019 | | | | | | | |
|------------------|----------------|------------|-----------|--------------|--------------|-------------|----------|
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) |
| Jan | 3.028.080,00 | 0,00 | 30.000,00 | 3.135.000,00 | 136.920,00 | 4,52% | 0,79% |
| Fev | 3.135.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.099.600,00 | -14.400,00 | -0,46% | 0,86% |
| Mar | 3.099.600,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.066.000,00 | -12.600,00 | -0,41% | 1,16% |
| Abr | 3.066.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.044.970,00 | -30,00 | 0,00% | 0,98% |
| Mai | 3.044.970,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.059.910,00 | 35.940,00 | 1,18% | 0,60% |
| Jun | 3.059.910,00 | 0,00 | 10.500,00 | 3.096.030,00 | 46.620,00 | 1,52% | 0,41% |
| Jul | 3.096.030,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.231.180,00 | 156.150,00 | 5,04% | 0,68% |
| Ago | 3.231.180,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.291.000,00 | 80.820,00 | 2,50% | 0,58% |
| Set | 3.291.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.330.060,00 | 60.060,00 | 1,82% | 0,41% |
| Out | 3.330.060,00 | 0,00 | 24.000,00 | 3.582.000,00 | 275.940,00 | 8,29% | 0,59% |
| Nov | 3.582.000,00 | 0,00 | 24.000,00 | 4.065.000,00 | 507.000,00 | 14,15% | 0,94% |
| Dez | 4.065.000,00 | 0,00 | 63.000,00 | 4.469.970,00 | 467.970,00 | 11,51% | 1,60% |
| Acumulado no Ano | | | | | 1.740.390,00 | 60,82% | 10,03% |

| 2018 | | | | | | | |
|------------------|----------------|------------|-----------|--------------|--------------|-------------|----------|
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) |
| Jan | 3.210.000,00 | 0,00 | 24.600,00 | 3.495.000,00 | 309.600,00 | 9,64% | 0,76% |
| Fev | 3.495.000,00 | 0,00 | 22.500,00 | 3.414.000,00 | -58.500,00 | -1,67% | 0,70% |
| Mar | 3.414.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.480.000,00 | 87.000,00 | 2,55% | 0,54% |
| Abr | 3.480.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.150.000,00 | -309.000,00 | -8,88% | 0,67% |
| Mai | 3.150.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.114.000,00 | -15.000,00 | -0,48% | 0,85% |
| Jun | 3.114.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 2.748.000,00 | -345.000,00 | -11,08% | 1,71% |
| Jul | 2.748.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 2.939.610,00 | 212.610,00 | 7,74% | 0,80% |
| Ago | 2.939.610,00 | 0,00 | 21.000,00 | 2.839.500,00 | -79.110,00 | -2,69% | 0,40% |
| Set | 2.839.500,00 | 0,00 | 21.000,00 | 2.865.000,00 | 46.500,00 | 1,64% | 0,89% |
| Out | 2.865.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 2.940.000,00 | 96.000,00 | 3,35% | 0,92% |
| Nov | 2.940.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.048.000,00 | 129.000,00 | 4,39% | 0,21% |
| Dez | 3.048.000,00 | 0,00 | 21.000,00 | 3.028.080,00 | 1.080,00 | 0,04% | 0,58% |
| Acumulado no Ano | | | | | 75.180,00 | 2,53% | 9,41% |

| 2017 | | | | | | | |
|------------------|----------------|------------|-----------|--------------|--------------|-------------|----------|
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) |
| Jan | 3.060.000,00 | 0,00 | 25.188,84 | 3.089.970,00 | 55.158,84 | 1,80% | 0,85% |
| Fev | 3.089.970,00 | 0,00 | 24.000,00 | 3.240.000,00 | 174.030,00 | 5,63% | 0,71% |
| Mar | 3.240.000,00 | 0,00 | 21.904,30 | 3.150.000,00 | -68.095,70 | -2,10% | 0,74% |
| Abr | 3.150.000,00 | 0,00 | 22.800,00 | 3.045.000,00 | -82.200,00 | -2,61% | 0,52% |
| Mai | 3.045.000,00 | 0,00 | 23.100,00 | 3.030.000,00 | 8.100,00 | 0,27% | 0,78% |
| Jun | 3.030.000,00 | 0,00 | 24.000,00 | 3.210.000,00 | 204.000,00 | 6,73% | 0,22% |
| Jul | 3.210.000,00 | 0,00 | 24.000,00 | 3.297.000,00 | 111.000,00 | 3,46% | 0,69% |
| Ago | 3.297.000,00 | 0,00 | 21.450,00 | 3.057.000,00 | -218.550,00 | -6,63% | 0,68% |
| Set | 3.057.000,00 | 0,00 | 22.500,00 | 3.299.910,00 | 265.410,00 | 8,68% | 0,59% |
| Out | 3.299.910,00 | 0,00 | 22.500,00 | 3.239.910,00 | -37.500,00 | -1,14% | 0,87% |
| Nov | 3.239.910,00 | 0,00 | 22.500,00 | 3.165.000,00 | -52.410,00 | -1,62% | 0,71% |
| Dez | 3.165.000,00 | 0,00 | 22.500,00 | 3.210.000,00 | 67.500,00 | 2,13% | 0,87% |
| Acumulado no Ano | | | | | 426.443,14 | 14,42% | 8,55% |

| 2016 | | | | | | | |
|------------------|----------------|------------|-----------|--------------|--------------|-------------|----------|
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) |
| Jan | 2.400.000,00 | 0,00 | 24.791,04 | 2.160.000,00 | -215.208,96 | -8,97% | 1,94% |
| Fev | 2.160.000,00 | 0,00 | 22.500,00 | 2.220.000,00 | 82.500,00 | 3,82% | 1,36% |
| Mar | 2.220.000,00 | 0,00 | 23.250,00 | 2.459.940,00 | 263.190,00 | 11,86% | 0,91% |
| Abr | 2.459.940,00 | 0,00 | 23.250,00 | 2.511.000,00 | 74.310,00 | 3,02% | 1,07% |
| Mai | 2.511.000,00 | 0,00 | 27.000,00 | 2.790.000,00 | 306.000,00 | 12,19% | 1,43% |
| Jun | 2.790.000,00 | 0,00 | 29.700,00 | 2.820.000,00 | 59.700,00 | 2,14% | 0,94% |
| Jul | 2.820.000,00 | 0,00 | 35.940,00 | 2.865.000,00 | 80.940,00 | 2,87% | 1,09% |
| Ago | 2.865.000,00 | 0,00 | 24.000,00 | 2.940.000,00 | 99.000,00 | 3,46% | 0,80% |
| Set | 2.940.000,00 | 0,00 | 24.000,00 | 2.967.000,00 | 51.000,00 | 1,73% | 0,53% |
| Out | 2.967.000,00 | 0,00 | 24.000,00 | 3.149.040,00 | 206.040,00 | 6,94% | 0,60% |
| Nov | 3.149.040,00 | 0,00 | 24.000,00 | 2.925.000,00 | -200.040,00 | -6,35% | 0,50% |
| Dez | 2.925.000,00 | 0,00 | 24.000,00 | 3.060.000,00 | 159.000,00 | 5,44% | 0,57% |
| Acumulado no Ano | | | | | 966.431,04 | 42,68% | 12,38% |

| 2015 | | | | | | | |
|------------------|----------------|------------|-----------|--------------|--------------|-------------|----------|
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) |
| Jan | 2.490.000,00 | 0,00 | 19.817,94 | 2.460.000,00 | -10.182,06 | -0,41% | 1,97% |
| Fev | 2.460.000,00 | 0,00 | 21.107,14 | 2.502.000,00 | 63.107,14 | 2,57% | 1,58% |
| Mar | 2.502.000,00 | 0,00 | 21.007,12 | 2.502.000,00 | 21.007,12 | 0,84% | 2,03% |
| Abr | 2.502.000,00 | 0,00 | 20.897,16 | 2.250.090,00 | -231.012,84 | -9,23% | 1,18% |
| Mai | 2.250.090,00 | 0,00 | 21.012,26 | 2.250.000,00 | 20.922,26 | 0,93% | 1,46% |
| Jun | 2.250.000,00 | 0,00 | 21.169,08 | 2.370.000,00 | 141.169,08 | 6,27% | 1,26% |
| Jul | 2.370.000,00 | 0,00 | 24.349,32 | 2.999.700,00 | 654.049,32 | 27,60% | 1,12% |
| Ago | 2.999.700,00 | 0,00 | 24.000,00 | 2.490.000,00 | -485.700,00 | -16,19% | 0,74% |
| Set | 2.490.000,00 | 0,00 | 22.500,00 | 2.370.000,00 | -97.500,00 | -3,92% | 1,00% |
| Out | 2.370.000,00 | 0,00 | 24.000,00 | 2.370.000,00 | 24.000,00 | 1,01% | 1,26% |
| Nov | 2.370.000,00 | 0,00 | 24.000,00 | 2.211.030,00 | -134.970,00 | -5,69% | 1,58% |
| Dez | 2.211.030,00 | 0,00 | 24.000,00 | 2.400.000,00 | 212.970,00 | 9,63% | 1,41% |
| Acumulado no Ano | | | | | 177.860,02 | 7,62% | 17,90% |

| 2014 | | | | | | | |
|------------------|----------------|------------|-----------|--------------|--------------|-------------|----------|
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) |
| Jan | 3.000.000,00 | 0,00 | 14.690,55 | 3.000.000,00 | 14.690,55 | 0,49% | 1,14% |
| Fev | 3.000.000,00 | 0,00 | 10.587,26 | 3.000.000,00 | 10.587,26 | 0,35% | 1,11% |
| Mar | 3.000.000,00 | 0,00 | 5.506,92 | 3.000.000,00 | 5.506,92 | 0,18% | 1,26% |
| Abr | 3.000.000,00 | 0,00 | 12.238,24 | 2.850.000,00 | -137.761,76 | -4,59% | 1,25% |
| Mai | 2.850.000,00 | 0,00 | 10.767,24 | 2.849.970,00 | 10.737,24 | 0,38% | 1,09% |
| Jun | 2.849.970,00 | 0,00 | 30.214,98 | 2.700.000,00 | -119.755,02 | -4,20% | 0,72% |
| Jul | 2.700.000,00 | 0,00 | 17.917,54 | 2.775.000,00 | 92.917,54 | 3,44% | 0,66% |
| Ago | 2.775.000,00 | 0,00 | 47.968,38 | 2.880.000,00 | 152.968,38 | 5,51% | 0,67% |
| Set | 2.880.000,00 | 0,00 | 18.380,78 | 2.880.000,00 | 18.380,78 | 0,64% | 1,00% |
| Out | 2.880.000,00 | 0,00 | 19.464,50 | 2.842.140,00 | -18.395,50 | -0,64% | 0,92% |
| Nov | 2.842.140,00 | 0,00 | 18.025,82 | 2.842.140,00 | 18.025,82 | 0,63% | 1,00% |
| Dez | 2.842.140,00 | 0,00 | 18.590,58 | 2.490.000,00 | -333.549,42 | -11,74% | 1,13% |
| Acumulado no Ano | | | | | -285.647,21 | -10,16% | 12,62% |

| 2013 | | | | | | | |
|------------------|----------------|--------------|----------|--------------|--------------|-------------|----------|
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) |
| Dez | 0,00 | 3.000.000,00 | 0,00 | 3.000.000,00 | 0,00 | 0,00% | 0,00% |
| Acumulado no Ano | | | | | 0,00 | 0,00% | 0,00% |

Disclaimer

O presente relatório foi elaborado para o RPPS de FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa ou instituição sem a expressa autorização. As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida por nós, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As opiniões constantes são fundamentadas em julgamento e estimativas e, portanto, sujeitas à alteração. Fundos de investimento não constam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura do prospecto e regulamento do fundo de investimento.

Fonte: Quantum Axis.