

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2018



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



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	15.997.260,00	1,43%	163	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	14.047.140,00	1,25%	20	21,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	91.507.450,20	8,15%	100	7,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	55.463.620,84	4,94%	1.418	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	25.643.119,58	2,29%	94	4,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	24.489.420,00	2,18%	21	16,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	23.489.122,06	2,09%	16	1,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	43.785.473,64	3,90%	346	3,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	26.635.228,86	2,37%	63	8,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	73.615.790,76	6,56%	223	2,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	166.928.109,42	14,88%	158	7,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	58.870.211,74	5,25%	25	12,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	79.071.899,64	7,05%	199	10,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	16.118.375,63	1,44%	143	1,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	10.210.422,47	0,91%	11	11,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	89.529.649,08	7,98%	1.220	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	9.397.890,22	0,84%	193	2,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	23.539.050,00	2,10%	19	18,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	105.869.835,80	9,43%	63	7,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	8.317.630,30	0,74%	506	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	298.126,50	0,03%	736	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	5.911.219,20	0,53%	90	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

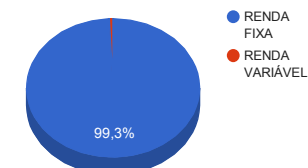
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	60.923.005,96	5,43%	756	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.575.281,84	0,32%	236	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	597.567,75	0,05%	139	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	66.967.467,32	5,97%	689	1,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	6.470.053,01	0,58%	27	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	6.989.919,76	0,62%	100	3,04%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	D+24	Não há	4.400.224,44	0,39%	67	1,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	3.495.000,00	0,31%		1,90%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			1.122.154.566,02				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2018)

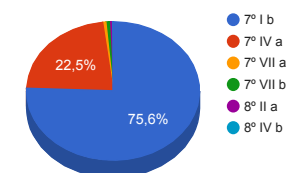
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	848.339.234,14	75,60%	50,00%	60,00%	80,00%	49.384.418,68
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	2,00%	7,00%	10,00%	112.215.456,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	252.460.134,67	22,50%	15,00%	20,00%	40,00%	196.401.691,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.470.053,01	0,58%	0,50%	1,00%	3,00%	27.194.583,97
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	6.989.919,76	0,62%	0,50%	2,00%	4,00%	37.896.262,88
Total Renda Fixa	100,00%	1.114.259.341,58	99,30%	68,00	90,00	137,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	56.107.728,30
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	4.400.224,44	0,39%	0,00%	4,00%	5,00%	51.707.503,86
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	33.664.636,98
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	11.221.545,66
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.495.000,00	0,31%	0,00%	0,50%	1,00%	7.726.545,66
Total Renda Variável	30,00%	7.895.224,44	0,70%	0,00	10,00	15,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução





FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	848.339.234,14	75,60%	50,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	252.460.134,67	22,50%	15,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.470.053,01	0,58%	0,50%	3,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	6.989.919,76	0,62%	0,50%	4,00%
Total Renda Fixa	1.114.259.341,58	99,30%	68,00	137,00

Artigos - Renda Variável	Base: janeiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	4.400.224,44	0,39%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.495.000,00	0,31%	0,00%	1,00%
Total Renda Variável	7.895.224,44	0,70%	0,00	15,00

Enquadramentos na Resolução 4. 04 por Gestores - base (janeiro / 2018)

Artigo 14° - 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)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	463.622.881,93	41,32%	0,04%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	224.405.380,87	20,00%	0,06%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	193.112.274,76	17,21%	0,05%
ITAU UNIBANCO	153.624.498,52	13,69%	0,01%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	87.389.529,94	7,79%	0,01%



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benc mar s - base (janeiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,40%	3,40%	3,46%	6,35%	14,49%	42,84%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,35%	3,35%	3,42%	6,27%	14,41%	42,42%	0,30%	1,793%	9,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,00%	2,00%	2,56%	5,56%	14,27%	36,80%	0,20%	1,025%	5,53%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	1,05%	1,61%	1,04%	4,30%	10,82%	0,20%	0,350%	4,31%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	1,01%	2,01%	2,12%	7,31%	17,36%	0,20%	0,569%	5,43%
IMA Geral ex-C	1,68%	1,68%	2,58%	5,18%	12,79%	36,23%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,72%	1,72%	2,51%	4,99%	12,17%	-	0,30%	0,938%	4,85%
IMA-B 5	1,33%	1,33%	2,33%	5,17%	12,77%	27,94%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,31%	1,31%	2,31%	5,09%	12,57%	27,47%	0,10%	0,609%	3,44%
IRF-M	1,30%	1,30%	2,65%	5,38%	14,09%	40,05%	-	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,30%	1,30%	2,60%	5,15%	14,13%	46,79%	0,10%	0,884%	4,53%
IPCA + 9,00% ao ano	1,05%	1,05%	3,18%	6,27%	12,00%	28,66%	-	-	-
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	-1,13%	-1,13%	-3,54%	-6,84%	-8,23%	-8,59%	0,45%	3,930%	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,80%	0,80%	2,47%	4,80%	8,95%	21,70%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	1,09%	2,64%	5,10%	9,46%	23,44%	0,20%	0,241%	0,35%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	1,06%	2,61%	2,08%	3,16%	9,62%	0,20%	0,238%	3,96%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	1,06%	2,61%	2,08%	3,17%	9,53%	0,20%	0,238%	3,96%



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benc mar s - base (janeiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ID A IPCA 2 Anos	0,77%	0,77%	2,20%	4,96%	13,25%	27,12%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	1,04%	1,61%	3,85%	10,25%	-	0,20%	0,348%	1,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	1,04%	1,61%	3,84%	10,22%	23,85%	0,20%	0,345%	1,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,78%	0,78%	-0,77%	1,74%	6,22%	13,96%	0,20%	0,293%	4,76%
IRF-M 1	0,59%	0,59%	1,79%	4,11%	10,35%	26,16%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	0,59%	1,74%	4,00%	10,12%	25,62%	0,10%	0,109%	0,65%
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,75%	4,00%	10,17%	25,69%	0,20%	0,112%	0,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,74%	4,02%	10,18%	25,79%	0,20%	0,097%	0,65%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,73%	4,01%	10,29%	25,95%	0,00%	0,098%	0,65%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,74%	3,99%	10,13%	25,51%	0,20%	0,102%	0,64%
Selic	0,58%	0,58%	1,70%	3,84%	9,39%	24,77%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,57%	0,57%	1,67%	4,03%	9,79%	25,49%	0,20%	0,001%	0,14%
CDI	0,58%	0,58%	1,70%	3,83%	9,38%	24,73%	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,58%	0,58%	1,68%	3,89%	9,59%	25,18%	0,20%	0,007%	0,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,57%	0,57%	1,67%	3,78%	9,33%	24,75%	0,18%	0,003%	0,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	0,57%	1,73%	3,90%	9,51%	24,76%	0,20%	0,021%	0,13%



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benc mar s - base (janeiro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,57%	0,57%	1,66%	3,78%	9,39%	24,73%	0,20%	0,005%	0,13%
IPCA	0,29%	0,29%	1,01%	1,79%	2,86%	8,36%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,49%	1,49%	2,43%	5,24%	12,18%	37,23%	0,40%	0,827%	5,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1,49%	1,49%	2,43%	5,24%	12,16%	-	0,40%	0,827%	5,65%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,99%	0,99%	1,75%	3,68%	9,48%	24,35%	0,20%	0,233%	1,28%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,04%	1,04%	1,61%	1,05%	4,30%	11,16%	0,20%	0,349%	4,30%



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benc - mar s - base (janeiro / 2018)

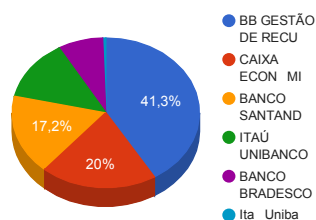
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	11,14%	11,14%	14,27%	28,81%	31,30%	110,15%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	7,74%	7,74%	9,57%	23,44%	30,34%	-	2,50%	7,621%	17,44%
IFIX	2,64%	2,64%	2,65%	10,60%	18,12%	72,74%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	8,88%	8,88%	7,87%	6,01%	13,11%	61,81%	1,20%	9,784%	22,89%



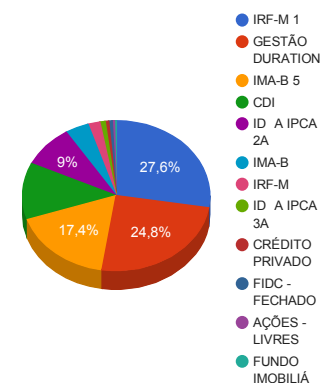
FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (janeiro / 2018)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	463.622.881,93	41,32%
CAIXA ECON MICA FEDERAL	224.405.380,87	20,00%
BANCO SANTANDER	193.112.274,76	17,21%
ITAÚ UNIBANCO	147.713.279,32	13,16%
BANCO BRADESCO	87.389.529,94	7,79%
Ita Unibanco S.A.	5.911.219,20	0,53%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	309.570.610,16	27,59%
GESTÃO DURATION	278.709.164,42	24,84%
IMA-B 5	195.474.134,40	17,42%
CDI	137.103.797,83	12,22%
ID A IPCA 2A	100.905.340,42	8,99%
IMA-B	45.336.777,05	4,04%
IRF-M	23.489.122,06	2,09%
ID A IPCA 3A	10.210.422,47	0,91%
CRÉDITO PRIVADO	6.989.919,76	0,62%
FIDC - FECHADO	6.470.053,01	0,58%
AÇÕES - LIVRES	4.400.224,44	0,39%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.495.000,00	0,31%



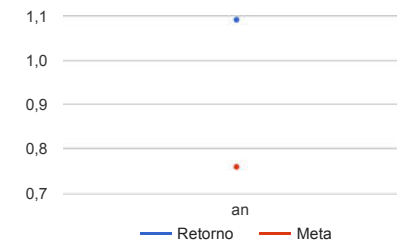
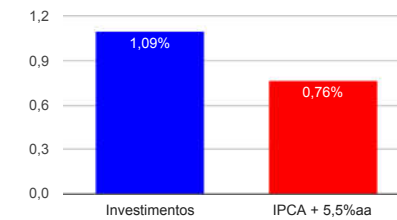


FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
aneiro	1.099.169.661,50	27.236.531,08	16.362.674,29	1.122.154.566,02	12.111.047,73	1,09%	0,76%	143,58%	0,49%
Acumulado no ano					12.111.047,73	1,09%	0,76%	143,58%	

Acumulado no Ano





FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.459.494,08	0,00	0,00	3.575.281,84	115.787,76	3,35%	1,79%	3,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.141.134,19	0,00	0,00	25.643.119,58	501.985,39	2,00%	1,03%	2,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	164.099.176,46	0,00	0,00	166.928.109,42	2.828.932,96	1,72%	0,94%	1,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	104.317.956,01	0,00	0,00	105.869.835,80	1.551.879,79	1,49%	0,83%	1,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.824.678,04	0,00	0,00	5.911.219,20	86.541,16	1,49%	0,83%	1,49%
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	6.543.940,52	0,00	160.443,33	6.470.053,01	86.555,82	1,32%	3,93%	-1,13%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	43.218.883,40	0,00	0,00	43.785.473,64	566.590,24	1,31%	0,61%	1,31%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.187.718,46	0,00	0,00	23.489.122,06	301.403,60	1,30%	0,88%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.945.356,90	0,00	0,00	16.118.375,63	173.018,73	1,09%	0,24%	1,09%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.828.744,00	0,00	0,00	15.997.260,00	168.516,00	1,06%	0,24%	1,06%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.291.172,00	0,00	0,00	23.539.050,00	247.878,00	1,06%	0,24%	1,06%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	72.854.208,92	0,00	0,00	73.615.790,76	761.581,84	1,05%	0,35%	1,05%
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.236.480,00	0,00	0,00	24.489.420,00	252.940,00	1,04%	0,35%	1,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	90.562.835,37	0,00	0,00	91.507.450,20	944.614,83	1,04%	0,35%	1,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.301.395,68	0,00	0,00	9.397.890,22	96.494,54	1,04%	0,34%	1,04%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.906.850,00	0,00	0,00	14.047.140,00	140.290,00	1,01%	0,57%	1,01%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.921.576,14	0,00	0,00	6.989.919,76	68.343,62	0,99%	0,23%	0,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.131.273,15	0,00	0,00	10.210.422,47	79.149,32	0,78%	0,29%	0,78%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	87.909.468,56	1.101.014,39	0,00	89.529.649,08	519.166,13	0,58%	0,11%	0,59%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.270.126,47	0,00	0,00	8.317.630,30	47.503,83	0,57%	0,00%	0,57%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	78.620.825,02	0,00	0,00	79.071.899,64	451.074,62	0,57%	0,11%	0,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	594.166,89	0,00	0,00	597.567,75	3.400,86	0,57%	0,00%	0,57%



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	55.149.347,22	0,00	0,00	55.463.620,84	314.273,62	0,57%	0,10%	0,57%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	58.537.399,45	0,00	0,00	58.870.211,74	332.812,29	0,57%	0,10%	0,57%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	64.348.592,38	2.241.473,36	0,00	66.967.467,32	377.401,58	0,57%	0,01%	0,58%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	26.485.128,23	0,00	0,00	26.635.228,86	150.100,63	0,57%	0,10%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.385.009,77	23.709.000,00	15.485.500,00	60.923.005,96	314.496,19	0,41%	0,02%	0,57%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	802.667,75	185.043,33	692.130,96	298.126,50	2.546,38	0,26%	0,00%	0,57%
Total Renda Fixa					11.485.279,73	1,04%	0,43%	



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/01/2018

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição (%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.210.000,00	0,00	24.600,00	3.495.000,00	309.600,00	9,64%	9,78%	8,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIÇÕES	4.084.056,44	0,00	0,00	4.400.224,44	316.168,00	7,74%	7,62%	7,74%
Total Renda Variável					625.768,00	8,58%	8,58%	