

Relatório Analítico dos Investimentos em abril 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 - 30/04/2018

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	25.675.262,04	2,19%	94	4,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	15.884.028,00	1,35%	163	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	123.199.453,87	10,49%	337	9,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	23.371.362,00	1,99%	19	18,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	14.136.110,00	1,20%	20	21,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	9.248.286,63	0,79%	192	2,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	91.004.518,29	7,75%	1.222	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	88.837.348,30	7,56%	208	9,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	10.387.522,97	0,88%	11	11,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	90.026.198,57	7,67%	99	8,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	61.817.075,58	5,26%	654	1,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	43.950.325,31	3,74%	17	1,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	24.130.460,00	2,05%	21	16,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	15.991.633,32	1,36%	143	1,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	72.539.767,93	6,18%	223	2,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	237.303.954,26	20,21%	244	8,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	146.007,88	0,01%	711	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.621.718,24	0,31%	231	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	21.049.612,46	1,79%	719	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	20.097.467,22	1,71%	699	0,40%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	108.095.633,19	9,20%	61	7,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	22.994.151,41	1,96%	119	1,68%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	6.186.972,28	0,53%	27	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	7.091.896,90	0,60%	90	3,39%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	D+24	Não há	15.856.528,44	1,35%	85	2,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	18.656.299,78	1,59%	7.077	2,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	3.150.000,00	0,27%		1,90%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			1.174.449.594,87				

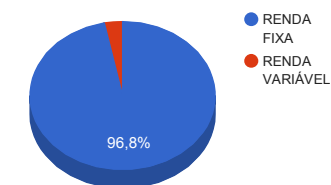


FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

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

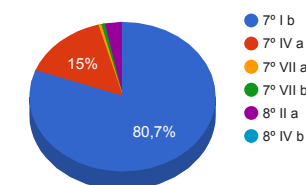
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	947.503.307,07	80,68%	50,00%	60,00%	80,00%	-7.943.631,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	2,00%	7,00%	10,00%	117.444.959,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	176.004.590,40	14,99%	15,00%	20,00%	40,00%	293.775.247,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.186.972,28	0,53%	0,50%	1,00%	3,00%	29.046.515,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.091.896,90	0,60%	0,50%	2,00%	4,00%	39.886.086,89
Total Renda Fixa	100,00%	1.136.786.766,65	96,79%	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%	58.722.479,74
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	34.512.828,22	2,94%	0,00%	4,00%	5,00%	24.209.651,52
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	35.233.487,85
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	11.744.495,95
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.150.000,00	0,27%	0,00%	0,50%	1,00%	8.594.495,95
Total Renda Variável	30,00%	37.662.828,22	3,21%	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 - 30/04/2018

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	947.503.307,07	80,68%	50,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	176.004.590,40	14,99%	15,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.186.972,28	0,53%	0,50%	3,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.091.896,90	0,60%	0,50%	4,00%
Total Renda Fixa	1.136.786.766,65	96,79%	68,00	137,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 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 "	34.512.828,22	2,94%	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 "	3.150.000,00	0,27%	0,00%	1,00%
Total Renda Variável	37.662.828,22	3,21%	0,00	15,00



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

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

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)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	493.921.183,81	42,06%	0,04%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	228.453.680,57	19,45%	0,06%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	205.903.546,18	17,53%	0,05%
ITAÚ UNIBANCO	157.333.836,01	13,40%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	88.837.348,30	7,56%	0,01%



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 9,00% ao ano	0,94%	3,79%	2,72%	5,98%	11,93%	26,95%	-	-	-
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	-1,74%	-5,45%	-4,38%	-7,76%	-12,10%	-12,25%	0,45%	4,635%	-
IDKA IPCA 2 Anos	0,82%	3,86%	3,07%	5,34%	12,30%	27,17%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	3,87%	2,89%	5,02%	11,52%	25,80%	0,20%	0,320%	2,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	2,29%	1,24%	2,87%	8,23%	-	0,20%	0,097%	1,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	2,29%	1,24%	2,86%	8,22%	22,02%	0,20%	0,096%	1,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	2,53%	1,73%	0,95%	4,06%	10,93%	0,20%	0,137%	4,71%
IPCA + 6,00% ao ano	0,71%	2,85%	2,04%	4,56%	8,88%	20,09%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	3,20%	2,09%	4,78%	9,25%	21,36%	0,20%	0,067%	0,34%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,67%	0,35%	-0,71%	1,88%	3,11%	7,89%	0,20%	0,069%	3,89%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,67%	0,34%	-0,71%	1,88%	3,10%	7,81%	0,20%	0,069%	3,90%
CDI	0,52%	2,11%	1,52%	3,25%	8,10%	22,64%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	2,11%	1,53%	3,28%	8,19%	22,87%	0,20%	0,018%	0,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,51%	2,05%	1,47%	3,15%	8,01%	22,56%	0,20%	0,010%	0,10%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,51%	2,09%	1,50%	3,21%	8,20%	23,08%	0,20%	0,003%	0,11%
IRF-M 1	0,51%	2,32%	1,71%	3,53%	8,94%	24,04%	-	-	-
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,26%	1,67%	3,45%	8,77%	23,56%	0,20%	0,069%	0,65%



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	2,24%	1,65%	3,42%	8,71%	23,41%	0,10%	0,068%	0,64%
IRF-M	0,47%	4,25%	2,92%	5,64%	12,79%	32,67%	-	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,41%	4,18%	2,85%	5,52%	12,49%	34,34%	0,10%	0,841%	4,43%
IMA-B 5	0,42%	3,97%	2,60%	4,99%	11,65%	26,36%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,40%	3,89%	2,54%	4,91%	11,43%	25,89%	0,10%	0,481%	3,46%
IMA Geral ex-C	0,30%	3,70%	1,99%	4,62%	10,78%	28,55%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	3,75%	1,99%	4,55%	10,15%	-	0,30%	0,711%	4,77%
IPCA	0,22%	0,92%	0,63%	1,65%	2,76%	6,96%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,44%	2,46%	1,46%	3,24%	7,93%	21,14%	0,20%	0,161%	1,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,33%	3,62%	2,10%	4,58%	10,00%	28,41%	0,40%	0,511%	5,51%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,33%	3,64%	2,12%	4,60%	10,01%	-	0,40%	0,511%	5,50%
IMA-B	-0,14%	4,79%	1,34%	4,85%	10,93%	29,34%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	1,65%	0,63%	2,65%	6,43%	14,42%	0,20%	0,358%	5,09%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	-0,43%	-1,46%	0,13%	2,51%	8,43%	0,20%	0,097%	4,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,23%	4,85%	2,80%	5,43%	12,46%	28,51%	0,20%	0,767%	5,44%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,17%	4,69%	1,30%	4,77%	10,79%	29,20%	0,30%	1,338%	8,98%



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,41%	-0,44%	-1,47%	0,12%	2,50%	8,60%	0,20%	0,097%	4,14%



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

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

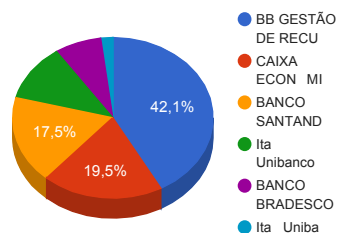
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,88%	12,71%	1,42%	15,89%	31,67%	59,74%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	2,66%	14,76%	6,51%	16,71%	33,67%	-	2,50%	6,798%	17,48%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	1,08%	8,26%	0,71%	12,38%	28,95%	67,57%	2,00%	7,704%	18,00%
IFIX	-0,86%	4,98%	2,28%	4,99%	14,80%	50,39%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-9,48%	-1,87%	-9,87%	-2,78%	3,45%	25,45%	1,20%	10,350%	22,38%



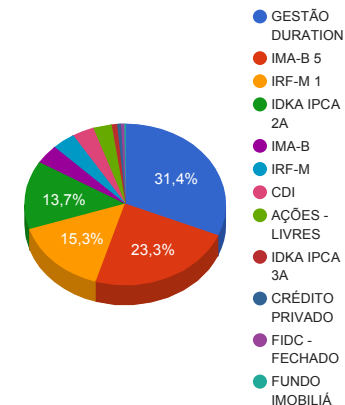
FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	493.921.183,81	42,06%
CAIXA ECON MICA FEDERAL	228.453.680,57	19,45%
BANCO SANTANDER	205.903.546,18	17,53%
Ita Unibanco	134.339.684,60	11,44%
BANCO BRADESCO	88.837.348,30	7,56%
Ita Unibanco S.A.	22.994.151,41	1,96%



Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	368.393.738,86	31,37%
IMA-B 5	273.261.181,80	23,27%
IRF-M 1	179.841.866,59	15,31%
IDKA IPCA 2A	161.091.560,78	13,72%
IMA-B	45.288.613,60	3,86%
IRF-M	43.950.325,31	3,74%
CDI	41.293.087,56	3,52%
AÇÕES - LIVRES	34.512.828,22	2,94%
IDKA IPCA 3A	10.387.522,97	0,88%
CRÉDITO PRIVADO	7.091.896,90	0,60%
FIDC - FECHADO	6.186.972,28	0,53%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.150.000,00	0,27%





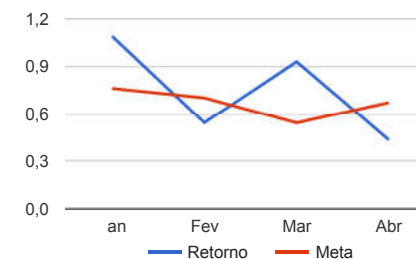
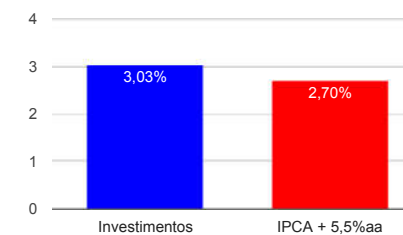
FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	1.099.169.661,50	27.236.531,08	16.362.674,29	1.122.154.566,01	12.111.047,72	1,09%	0,76%	143,58%	0,49%
Fevereiro	1.122.154.566,01	35.229.103,23	23.784.385,74	1.139.736.552,47	6.137.268,97	0,54%	0,70%	76,86%	1,06%
Março	1.139.736.552,47	230.657.871,91	220.226.269,47	1.160.857.771,62	10.689.616,71	0,93%	0,54%	172,89%	0,71%
Abril	1.160.857.771,62	125.834.550,55	117.297.638,60	1.174.449.594,87	5.054.911,30	0,43%	0,67%	64,70%	0,62%
Acumulado no ano					33.992.844,70	3,03%	2,70%	112,23%	

Acumulado no Ano





FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição (%)
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	6.296.767,30	0,00	178.586,01	6.186.972,28	68.790,99	1,09%	4,64%	-1,74%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.006.750,00	0,00	0,00	14.136.110,00	129.360,00	0,92%	0,36%	0,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	61.136.048,90	201.428,66	0,00	61.817.075,58	479.598,02	0,78%	0,32%	0,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.883.657,64	0,00	0,00	15.991.633,32	107.975,68	0,68%	0,07%	0,68%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.778.824,00	0,00	0,00	15.884.028,00	105.204,00	0,67%	0,07%	0,67%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.216.598,00	0,00	0,00	23.371.362,00	154.764,00	0,67%	0,07%	0,67%
BRASECO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	79.997.946,96	8.406.212,34	0,00	88.837.348,30	433.189,00	0,49%	0,07%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	90.569.817,00	0,00	0,00	91.004.518,29	434.701,29	0,48%	0,07%	0,48%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	157.333,84	0,00	12.077,52	146.007,88	751,56	0,48%	0,01%	0,51%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.060.984,77	0,00	0,00	7.091.896,90	30.912,13	0,44%	0,16%	0,44%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.058.990,26	19.700.830,21	0,00	43.950.325,31	190.504,84	0,44%	0,84%	0,41%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	72.239.931,15	0,00	0,00	72.539.767,93	299.836,78	0,42%	0,10%	0,42%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	104.766.457,05	17.923.786,90	0,00	123.199.453,87	509.209,92	0,42%	0,48%	0,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	89.654.585,23	0,00	0,00	90.026.198,57	371.613,34	0,41%	0,10%	0,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.210.118,55	0,00	0,00	9.248.286,63	38.168,08	0,41%	0,10%	0,41%
CAIXA BRASIL 2018 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.031.120,00	0,00	0,00	24.130.460,00	99.340,00	0,41%	0,10%	0,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.347.043,83	0,00	0,00	10.387.522,97	40.479,14	0,39%	0,14%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	107.744.684,77	0,00	0,00	108.095.633,19	350.948,42	0,33%	0,51%	0,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	22.919.506,23	0,00	0,00	22.994.151,41	74.645,18	0,33%	0,51%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.616.004,77	0,00	0,00	25.675.262,04	59.257,27	0,23%	0,77%	0,23%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	185.848.648,80	50.915.145,62	0,00	237.303.954,26	540.159,84	0,23%	0,71%	0,22%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	54.717.427,11	2.709.000,00	37.430.117,11	20.097.467,22	101.157,22	0,18%	0,00%	0,51%



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição (%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	66.184.548,83	25.978.146,82	71.249.645,62	21.049.612,46	136.562,43	0,15%	0,02%	0,52%
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.402.156,94	0,00	8.406.212,34	0,00	4.055,40	0,05%	0,00%	0,51%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.628.022,46	0,00	0,00	3.621.718,24	-6.304,22	-0,17%	1,34%	-0,17%
Total Renda Fixa					4.754.880,31	0,42%	0,39%	



FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/04/2018

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	15.446.343,03	0,00	0,00	15.856.528,44	410.185,41	2,66%	6,80%	2,66%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	18.457.454,20	0,00	0,00	18.656.299,78	198.845,58	1,08%	7,70%	1,08%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.480.000,00	0,00	21.000,00	3.150.000,00	-309.000,00	-8,88%	10,35%	-9,48%
Total Renda Variável					300.030,99	0,80%	7,54%	