

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2023

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



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

| Produto / Fundo | Resgate | Carença | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|---------|------------|------------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | | | 1.011.547.088,18 | 40,88% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI... | D+0 | 15/08/2024 | 3.409.070,51 | 0,14% | 140 | 1,81% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR... | D+0 | 15/08/2024 | 10.763.373,05 | 0,44% | 92 | 5,11% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 86.487.722,89 | 3,50% | 901 | 1,45% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | D+0 | Não há | 330,47 | 0,00% | 16.763 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0 | Não há | 463.261.145,17 | 18,72% | 1.126 | 3,09% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 112.015.345,07 | 4,53% | 379 | 2,34% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES | D+3 | Não há | 44.766.780,02 | 1,81% | 21.108 | 3,59% | Artigo 8º, Inciso I |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 36.497.520,09 | 1,48% | 29.477 | 4,33% | Artigo 8º, Inciso I |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 35.946.309,87 | 1,45% | 21.398 | 2,63% | Artigo 8º, Inciso I |
| BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES | D+3 | Não há | 26.113.163,31 | 1,06% | 47 | 8,05% | Artigo 8º, Inciso I |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 65.236.997,07 | 2,64% | 145 | 13,92% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | D+25 | Não há | 35.027.421,77 | 1,42% | 1.074 | 5,36% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | D+15 | Não há | 40.178.751,91 | 1,62% | 184 | 5,73% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | D+4 | Não há | 61.850.268,14 | 2,50% | 92 | 14,56% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 51.616.760,39 | 2,09% | 17.026 | 2,83% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | D+5 | Não há | 46.675.276,80 | 1,89% | 38 | 9,46% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ... | D+24 | Não há | 8.603.221,95 | 0,35% | 17 | 5,52% | Artigo 8º, Inciso I |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES | D+33 | Não há | 1.003.483,74 | 0,04% | 2.347 | 0,56% | Artigo 8º, Inciso I |
| SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 1.689.866,44 | 0,07% | 172 | 1,07% | Artigo 8º, Inciso I |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|------------|---------------|-----------------|-------------------------|----------|------------------|-----------------------|
| BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR... | D+5 du | Não há | 30.816.294,60 | 1,25% | 102 | 2,68% | Artigo 9º, Inciso II |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI... | D+5 du | Não há | 28.309.344,75 | 1,14% | 57 | 5,51% | Artigo 9º, Inciso II |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N... | D+12 | Não há | 11.356.074,61 | 0,46% | 656 | 15,15% | Artigo 9º, Inciso II |
| ITAU MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO... | D+5 du | Não há | 5.148.276,81 | 0,21% | 83 | 6,50% | Artigo 9º, Inciso II |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME... | D+8 | Não há | 27.936.387,32 | 1,13% | 4.967 | 4,40% | Artigo 9º, Inciso II |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+4 | Não há | 22.560.883,28 | 0,91% | 491 | 1,11% | Artigo 9º, Inciso III |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+5 | Não há | 5.124.679,38 | 0,21% | 405 | 0,71% | Artigo 9º, Inciso III |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | D+1 | Não há | 97.816.549,69 | 3,95% | 6.968 | 6,13% | Artigo 10º, Inciso I |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 100.027.480,90 | 4,04% | 653 | 8,82% | Artigo 10º, Inciso I |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | Não se ... | Não se aplica | 2.360.400,00 | 0,10% | | 1,90% | Artigo 11º |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | | 2.474.146.268,18 | | | |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | | 22.750,24 | | | |
| | | | PL Total | 2.474.169.018,42 | | | |

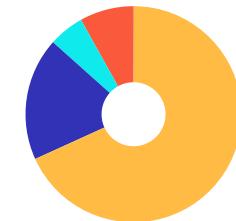


**CRÉDITO
& MERCADO**

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 2023)

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

| Artigos - Renda Fixa | Resolução Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2023 | | | GAP Superior |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|-------------------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a' | 100,00% | 1.011.547.088,18 | 40,88% | 10,00% | 60,00% | 100,00% | 1.462.599.180,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' | 100,00% | 100.660.496,92 | 4,07% | 0,00% | 3,00% | 90,00% | 2.126.071.144,44 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 90,00% | 2.226.731.641,36 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 65,00% | 575.276.490,24 | 23,25% | 2,00% | 3,00% | 65,00% | 1.032.918.584,08 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b' | 65,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 65,00% | 1.608.195.074,32 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 123.707.313,41 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 1.687.484.075,34 | 68,20% | 12,00% | 66,00% | 415,00% | |



- █ RENDA FIXA 1.687.484.075,34
- █ RENDA VARIÁVEL 455.205.821,50
- █ EXTERIOR 131.251.940,75
- █ ESTRUTURADOS 197.844.030,59
- █ FUNDO IMOBILIÁRIO 2.360.400,00

ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!





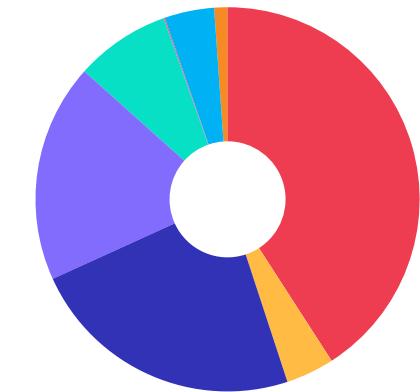
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2023)

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2023 | | | GAP Superior |
|--|--------------------------------|----------------|----------|-------------------------------|--------|--------|----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I | 35,00% | 455.205.821,50 | 18,40% | 0,00% | 18,20% | 35,00% | 410.745.372,36 |
| Artigo 8º, Inciso II | 35,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 35,00% | 865.951.193,86 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 197.844.030,59 | 8,00% | 0,00% | 9,50% | 10,00% | 49.570.596,23 |
| Artigo 10º, Inciso II | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 123.707.313,41 |
| Artigo 11º | 5,00% | 2.360.400,00 | 0,10% | 0,00% | 0,30% | 5,00% | 121.346.913,41 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 35,00% | 655.410.252,09 | 26,49% | 0,00% | 28,00% | 90,00% | |



| Artigos - Exterior | Resolução Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2023 | | | GAP Superior |
|-----------------------|--------------------------------|----------------|----------|--|-------|----------|----------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º, Inciso II | 10,00% | 103.566.378,09 | 4,19% | 0,00% | 4,30% | 10,00% | 143.848.248,73 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 27.685.562,66 | 1,12% | 0,00% | 1,70% | 10,00% | 219.729.064,16 |
| Total Exterior | 10,00% | 131.251.940,75 | 5,30% | 0,00% | 6,00% | 20,00% | |





| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-------------------------------------|------------------|---------------|----------------|
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS) | 1.011.547.088,18 | 40,88 | - |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 653.769.838,06 | 26,42 | - |
| CAIXA DTVM | 357.638.402,76 | 14,46 | - |
| ITAÚ UNIBANCO | 212.042.825,97 | 8,57 | 0,05 |
| ITAÚ DTVM | 106.895.259,14 | 4,32 | 0,02 |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT | 91.350.160,38 | 3,69 | 0,01 |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM... | 27.936.387,32 | 1,13 | 0,01 |
| BANCO J. SAFRA S/A | 7.818.029,56 | 0,32 | 0,00 |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT | 5.148.276,81 | 0,21 | 0,00 |

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos | Estratégia de Alocação - 2023 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-----------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira \$ | Carteira % | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a' | 1.011.547.088,18 | 40,88 | 10,00 | 100,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' | 100.660.496,92 | 4,07 | 0,00 | 90,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 90,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 575.276.490,24 | 23,25 | 2,00 | 65,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 65,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 455.205.821,50 | 18,40 | 0,00 | 35,00 |
| Artigo 8º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 35,00 |
| Artigo 9º, Inciso II | 103.566.378,09 | 4,19 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 27.685.562,66 | 1,12 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 197.844.030,59 | 8,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 11º | 2.360.400,00 | 0,10 | 0,00 | 1,00 |
| Artigo 12º | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|---------------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 0,97% | 6,79% | 1,99% | 6,79% | 9,28% | 20,32% | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,04% | 6,60% | 2,14% | 6,60% | 9,23% | 19,78% | 0,83% | 0,03% |
| CDI (Benchmark) | 1,07% | 6,50% | 3,15% | 6,50% | 13,54% | 23,37% | - | - |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 1,09% | 6,44% | 3,16% | 6,44% | 13,54% | 23,74% | 0,01% | 0,00% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,85% | 5,11% | 2,48% | 5,11% | 10,63% | 17,47% | 0,00% | 0,00% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,17% | 6,46% | 3,25% | 6,46% | 13,73% | 24,70% | 0,03% | 0,00% |
| IPCA (Benchmark) | -0,08% | 2,87% | 0,76% | 2,87% | 3,16% | 15,42% | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,93% | 5,54% | 1,43% | 5,54% | 9,01% | 20,53% | 0,47% | 0,03% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,93% | 5,54% | 1,44% | 5,54% | 9,24% | 21,24% | 0,47% | 0,03% |



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| Global BDRX (Benchmark) | 0,48% | 15,14% | 5,90% | 15,14% | 14,44% | 0,60% | - | - |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 0,47% | 14,53% | 5,60% | 14,53% | 13,40% | -1,43% | 6,60% | 0,17% |
| Ibovespa (Benchmark) | 9,00% | 7,61% | 15,91% | 7,61% | 19,83% | -6,87% | - | - |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | 7,40% | 2,75% | 10,27% | 2,75% | 6,15% | -28,95% | 7,62% | 0,21% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 8,96% | 5,17% | 14,28% | 5,17% | 12,53% | -7,54% | 7,42% | 0,17% |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES | 7,80% | 9,45% | 15,99% | 9,45% | 17,61% | -30,88% | 8,11% | 0,21% |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | 8,90% | 7,32% | 15,55% | 7,32% | 19,57% | -6,91% | 7,35% | 0,16% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES | 7,74% | 7,45% | 16,13% | 7,45% | 15,89% | -22,46% | 6,90% | 0,20% |
| BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES | 9,05% | 7,69% | 15,96% | 7,69% | 19,95% | -6,93% | 7,50% | 0,17% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 9,77% | 13,72% | 19,95% | 13,72% | 20,91% | 2,63% | 8,04% | 0,18% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 8,07% | 7,26% | 15,64% | 7,26% | 19,04% | -11,73% | 7,03% | 0,17% |
| SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES | 8,13% | 8,00% | 15,51% | 8,00% | 14,08% | -28,45% | 7,94% | 0,18% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 8,89% | 8,06% | 17,13% | 8,06% | 15,45% | -16,81% | 7,53% | 0,21% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 5,27% | -1,57% | 7,34% | -1,57% | 13,35% | -15,61% | 7,12% | 0,19% |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES | 8,01% | 5,57% | 14,39% | 5,57% | 19,10% | -11,84% | 6,95% | 0,19% |

| | | | | | | | | |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|
| IFIX (Benchmark) | 4,71% | 10,05% | 14,28% | 10,05% | 12,87% | 14,54% | - | - |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 15,49% | 24,89% | 25,87% | 24,89% | 24,34% | -6,08% | 11,74% | 0,22% |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|---------------|---------------|--------------|---------------|---------------|---------------|---------|------------------|
| MSCI ACWI (Benchmark) | -0,09% | 4,18% | 0,15% | 4,18% | 5,27% | -8,63% | - | - |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 7,00% | 20,17% | 10,43% | 20,17% | 28,33% | 20,97% | 5,04% | 0,20% |
| S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark) | 6,47% | 15,91% | 8,30% | 15,91% | 17,57% | 3,56% | - | - |
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES | 5,19% | 16,37% | 7,85% | 16,37% | 22,73% | 13,96% | 6,14% | 0,18% |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 6,99% | 20,07% | 10,36% | 20,07% | 28,33% | 20,88% | 5,06% | 0,20% |



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

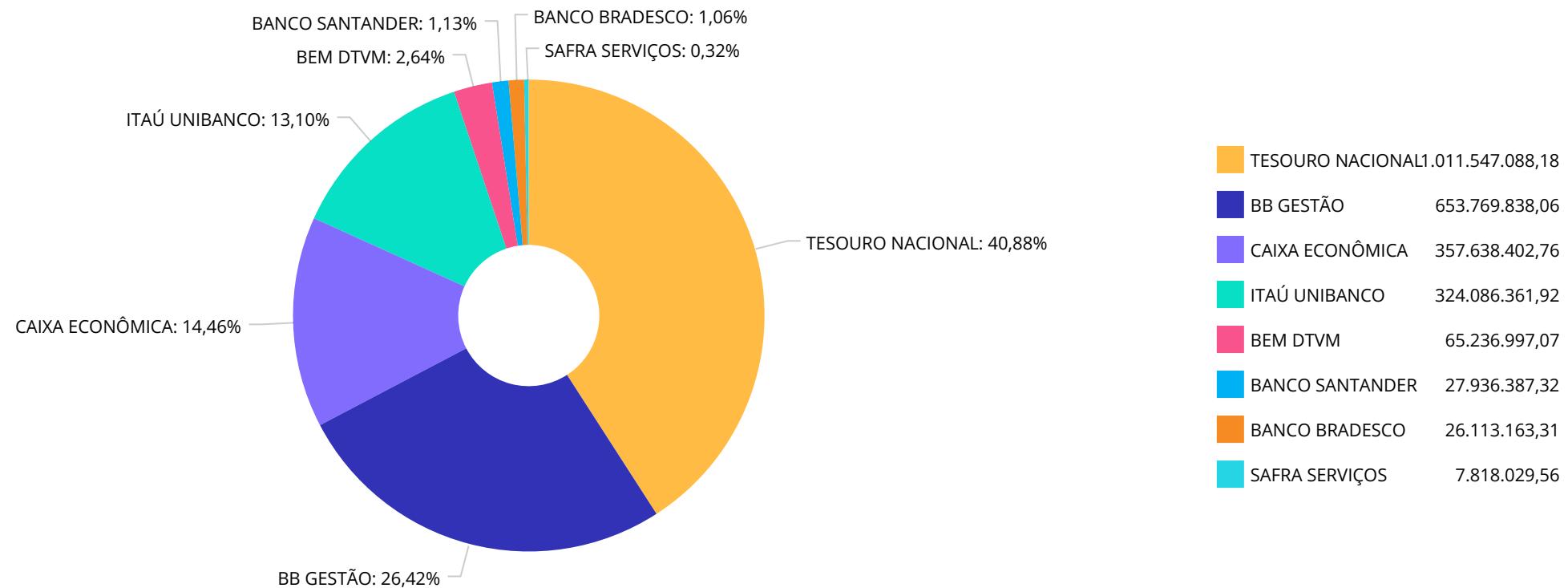
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|---------------|--------|-------|--------|--------|---------------|---------|------------------|
| Global BDRX (Benchmark) | 0,48% | 15,14% | 5,90% | 15,14% | 14,44% | 0,60% | - | - |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | -0,06% | 7,46% | 2,43% | 7,46% | 6,61% | -9,35% | 5,79% | 14,722% |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 0,47% | 14,53% | 5,60% | 14,53% | 13,40% | -1,43% | 6,60% | 16,781% |

| | | | | | | | | |
|--|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|-------|---------|
| MSCI WORLD (Benchmark) | 0,18% | 5,28% | 0,82% | 5,28% | 7,20% | -5,27% | - | - |
| BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO | -1,39% | 4,29% | -0,52% | 4,29% | 13,08% | 2,11% | 5,66% | 13,208% |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | -0,78% | 1,02% | 0,12% | 1,02% | 7,24% | -13,40% | 5,16% | 13,100% |
| ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES | -0,55% | -3,97% | -3,91% | -3,97% | -4,40% | -24,53% | 5,78% | 20,293% |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU... | -0,75% | 3,21% | -0,44% | 3,21% | 6,07% | -22,95% | 5,17% | 12,664% |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR... | -0,60% | -1,85% | -3,91% | -1,85% | 4,38% | -7,96% | 7,04% | 14,159% |



CRÉDITO
& MERCADO

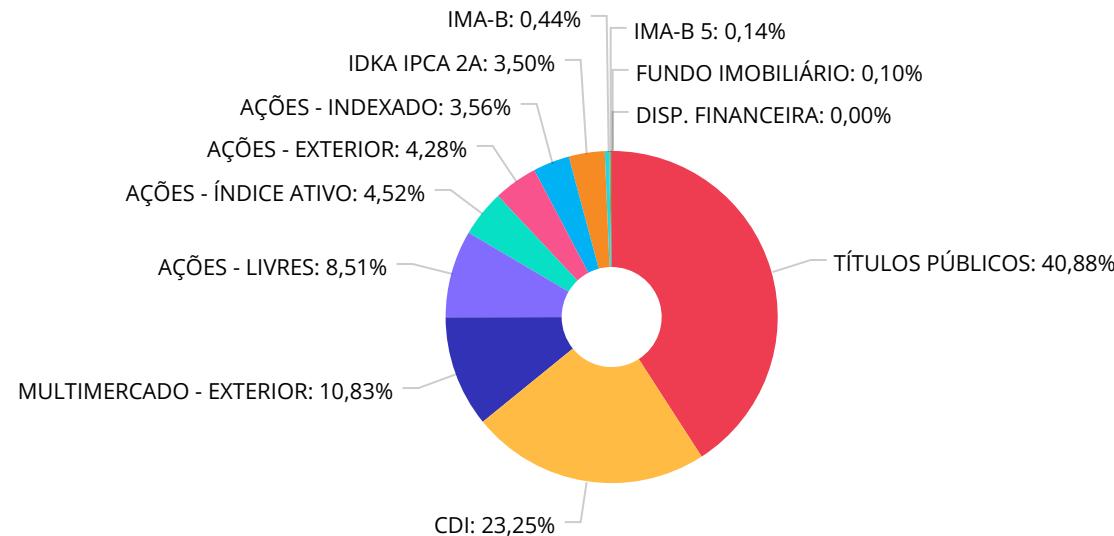
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Junho / 2023)





CRÉDITO
& MERCADO

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2023)



| | | | | | | | |
|------------------------|------------------|--------------------|----------------|---------------------------|----------------|--------------------|----------------|
| ■ TÍTULOS PÚBLICOS | 1.011.547.088,18 | ■ CDI | 575.276.820,71 | ■ MULTIMERCADO - EXTERIOR | 267.952.787,12 | ■ AÇÕES - LIVRES | 210.563.336,16 |
| ■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 111.912.273,87 | ■ AÇÕES - EXTERIOR | 105.909.964,24 | ■ AÇÕES - INDEXADO | 87.963.431,45 | ■ IDKA IPCA 2A | 86.487.722,89 |
| ■ IMA-B | 10.763.373,05 | ■ IMA-B 5 | 3.409.070,51 | ■ FUNDO IMOBILIÁRIO | 2.360.400,00 | ■ Disp. FINANCEIRA | 22.750,24 |



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2023)

| Títulos Públicos | Vencimento | Compra | Qtde | P.U. Compra | P.U. Atual | \$ Pago | \$ Atual | Marcação |
|--|------------|------------|--------|--------------|--------------|---------------|---------------|----------|
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 14/06/2022 | 9.875 | 4049,567430 | 4.217,860871 | 39.989.478,37 | 41.651.376,10 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 29/08/2022 | 7.642 | 3925,476529 | 4.186,703772 | 29.998.491,63 | 31.994.790,22 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 23/11/2022 | 3.761 | 3988,237004 | 4.183,741145 | 14.999.759,37 | 15.735.050,44 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 23/11/2022 | 1.254 | 3988,237004 | 4.183,741145 | 5.001.249,20 | 5.246.411,39 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 28/11/2022 | 2.515 | 3977,260022 | 4.171,086023 | 10.002.808,96 | 10.490.281,34 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 28/11/2022 | 3.771 | 3977,260022 | 4.171,086023 | 14.998.247,54 | 15.729.165,39 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 22/05/2023 | 9.712 | 4.118,503984 | 4.154,742059 | 39.998.910,69 | 40.350.854,87 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2030 | 09/03/2022 | 10.335 | 3870,303778 | 4.233,44561 | 39.999.589,55 | 43.752.660,37 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 07/07/2022 | 9.782 | 4089,215327 | 4.220,699712 | 40.000.704,33 | 41.286.884,58 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 11/07/2022 | 7.384 | 4062,955171 | 4.192,888978 | 30.000.860,98 | 30.960.292,21 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 16/09/2022 | 9.987 | 4004,964372 | 4.243,125726 | 39.997.579,18 | 42.376.096,62 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 25/02/2022 | 10.047 | 3.981,059981 | 4.245,320876 | 39.997.709,63 | 42.652.738,84 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 04/03/2022 | 15.090 | 3976,077337 | 4.231,465024 | 59.999.007,02 | 63.852.807,21 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 29/06/2022 | 296 | 4047,135758 | 4.190,264701 | 1.197.952,18 | 1.240.318,35 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 07/07/2022 | 498 | 4019,563107 | 4.149,596661 | 2.001.742,43 | 2.066.499,13 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 07/03/2022 | 10.178 | 3929,750612 | 4.302,019287 | 39.997.001,73 | 43.785.952,30 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 08/03/2022 | 10.225 | 3.911,428571 | 4.280,14206 | 39.994.357,14 | 43.764.452,56 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 15/03/2022 | 3.890 | 3895,024106 | 4.245,465294 | 15.151.643,77 | 16.514.859,99 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 25/02/2022 | 15.015 | 3.995,877115 | 4.264,776011 | 59.998.094,88 | 64.035.611,80 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 10/05/2022 | 2.400 | 4129,737582 | 4.234,5927 | 9.911.370,20 | 10.163.022,48 | Curva |



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2023)

| Títulos Públicos | Vencimento | Compra | Qtde | P.U. Compra | P.U. Atual | \$ Pago | \$ Atual | Marcação |
|--|------------|------------|--------|--------------|--------------|---------------|---------------|----------|
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 09/05/2022 | 4.840 | 4131,678715 | 4.239,601933 | 19.997.324,98 | 20.519.673,35 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 11/05/2022 | 2.310 | 4113,158402 | 4.214,646545 | 9.501.395,91 | 9.735.833,51 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 27/06/2022 | 223 | 4039,820802 | 4.189,901594 | 900.880,04 | 934.348,05 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 27/06/2022 | 520 | 4039,820802 | 4.189,901594 | 2.100.706,82 | 2.178.748,82 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2050 | 11/05/2022 | 4.940 | 4048,514642 | 4.270,020439 | 19.999.662,33 | 21.093.900,96 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2050 | 15/06/2022 | 9.790 | 4085,727657 | 4.253,647591 | 39.999.273,76 | 41.643.209,91 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2050 | 06/02/2023 | 10.000 | 3.785,199052 | 3.970,17204 | 37.851.990,52 | 39.701.720,40 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2050 | 03/03/2023 | 10.479 | 3816,987204 | 3.970,17204 | 39.998.208,91 | 41.603.432,80 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 06/07/2022 | 5.050 | 3962,882939 | 4.093,612086 | 20.012.558,84 | 20.672.741,03 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 06/03/2023 | 10.386 | 3851,268116 | 3.883,034492 | 39.999.270,65 | 40.329.196,23 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2060 | 03/03/2023 | 10.549 | 3792,196447 | 3.944,391408 | 40.003.880,32 | 41.609.384,96 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2060 | 29/06/2022 | 4.935 | 4052,223528 | 4.197,646512 | 19.997.723,11 | 20.715.385,53 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2060 | 07/07/2022 | 5.024 | 3981,139802 | 4.110,191245 | 20.001.246,37 | 20.649.600,81 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2060 | 23/11/2022 | 10.213 | 3916,628783 | 4.093,071551 | 40.000.529,76 | 41.802.539,75 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2060 | 06/02/2023 | 10.327 | 3.760,654822 | 3.944,391408 | 38.836.282,35 | 40.733.730,07 | Curva |

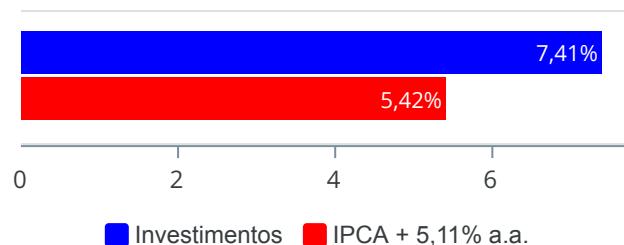


**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|------------------|----------------|----------------|------------------|----------------|----------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 2.228.676.184,81 | 156.376.748,48 | 133.604.967,93 | 2.300.984.841,17 | 49.536.875,81 | 49.536.875,81 | 2,20% | 2,20% | 0,97% | 0,97% | 227,21% | 5,89% |
| Fevereiro | 2.300.984.841,17 | 228.773.683,89 | 228.216.386,55 | 2.285.153.296,15 | -16.388.842,36 | 33.148.033,45 | -0,71% | 1,47% | 1,20% | 2,18% | 67,56% | 5,13% |
| Março | 2.285.153.296,15 | 169.763.712,54 | 159.464.712,55 | 2.313.038.391,41 | 17.586.095,27 | 50.734.128,72 | 0,77% | 2,25% | 1,17% | 3,37% | 66,68% | 5,96% |
| Abril | 2.313.038.391,41 | 55.915.092,17 | 39.403.674,98 | 2.352.917.925,44 | 23.368.116,84 | 74.102.245,56 | 1,00% | 3,28% | 0,97% | 4,38% | 74,86% | 5,37% |
| Maio | 2.352.917.925,44 | 438.719.161,85 | 427.333.355,28 | 2.401.513.041,85 | 37.209.309,84 | 111.311.555,40 | 1,57% | 4,90% | 0,67% | 5,07% | 96,63% | 3,98% |
| Junho | 2.401.513.041,85 | 50.802.600,00 | 38.447.144,74 | 2.471.521.037,72 | 57.652.540,61 | 168.964.096,01 | 2,39% | 7,41% | 0,34% | 5,42% | 136,53% | 3,54% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade





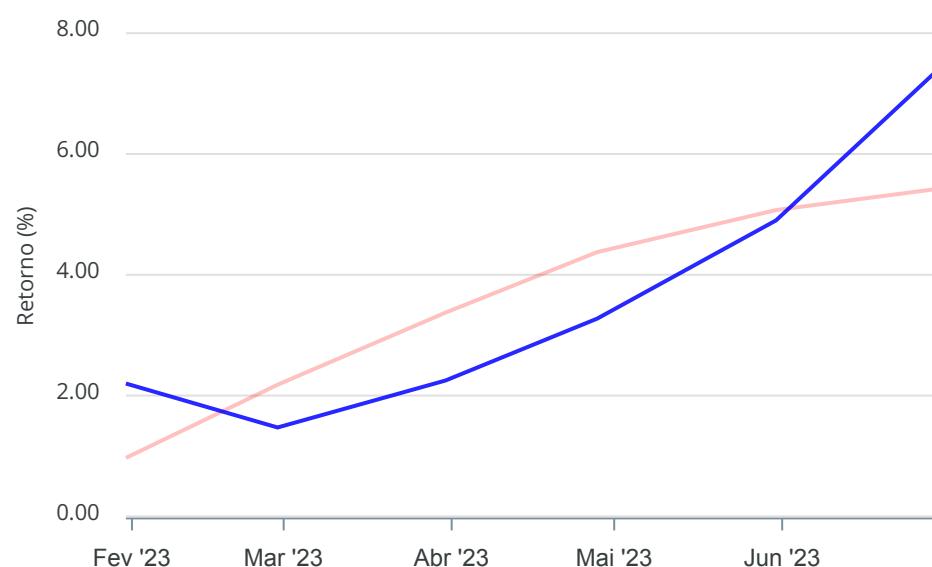
CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMILL IDIV



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|-------------------------|----------------------|----------------------|-------------------------|----------------------|--------------|------------|--------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 110.722.723,78 | 0,00 | 0,00 | 112.015.345,07 | 1.292.621,29 | 1,17% | 1,17% | 0,03% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 85.578.068,73 | 16.800,00 | 0,00 | 86.487.722,89 | 892.854,16 | 1,04% | 1,04% | 0,83% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 445.425.661,06 | 51.266.000,00 | 38.367.200,00 | 463.261.145,17 | 4.936.684,11 | 0,99% | 1,09% | 0,01% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE... | 3.377.716,58 | 0,00 | 0,00 | 3.409.070,51 | 31.353,93 | 0,93% | 0,93% | 0,47% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 10.664.423,16 | 0,00 | 0,00 | 10.763.373,05 | 98.949,89 | 0,93% | 0,93% | 0,47% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 1.006.615.718,80 | 0,00 | 0,00 | 1.011.547.088,18 | 4.931.369,38 | 0,49% | - | - |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 0,00 | 494.000,00 | 496.344,74 | 0,00 | 2.344,74 | 0,47% | 1,00% | 0,01% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 273,61 | 16.800,00 | 16.800,00 | 330,47 | 56,86 | 0,33% | 0,85% | 0,00% |
| Total Renda Fixa | 1.662.384.585,72 | 51.793.600,00 | 38.880.344,74 | 1.687.484.075,34 | 12.186.234,36 | 0,73% | | 0,13% |



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|--|-----------------------|-------------|------------------|-----------------------|----------------------|--------------|------------|--------------|
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 2.040.600,00 | 0,00 | 16.800,00 | 2.360.400,00 | 336.600,00 | 16,50% | 15,49% | 11,74% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 36.601.265,17 | 0,00 | 0,00 | 40.178.751,91 | 3.577.486,74 | 9,77% | 9,77% | 8,04% |
| BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES | 23.945.518,30 | 0,00 | 0,00 | 26.113.163,31 | 2.167.645,01 | 9,05% | 9,05% | 7,50% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 32.989.828,84 | 0,00 | 0,00 | 35.946.309,87 | 2.956.481,03 | 8,96% | 8,96% | 7,42% |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | 56.796.620,04 | 0,00 | 0,00 | 61.850.268,14 | 5.053.648,10 | 8,90% | 8,90% | 7,35% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 32.168.771,46 | 0,00 | 0,00 | 35.027.421,77 | 2.858.650,31 | 8,89% | 8,89% | 7,53% |
| SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES | 1.562.852,53 | 0,00 | 0,00 | 1.689.866,44 | 127.013,91 | 8,13% | 8,13% | 7,94% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 43.191.928,14 | 0,00 | 0,00 | 46.675.276,80 | 3.483.348,66 | 8,06% | 8,06% | 7,03% |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES | 60.397.707,75 | 0,00 | 0,00 | 65.236.997,07 | 4.839.289,32 | 8,01% | 8,01% | 6,95% |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES | 930.876,84 | 0,00 | 0,00 | 1.003.483,74 | 72.606,90 | 7,80% | 7,80% | 8,11% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES | 7.985.259,05 | 0,00 | 0,00 | 8.603.221,95 | 617.962,90 | 7,74% | 7,74% | 6,90% |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | 33.983.884,70 | 0,00 | 0,00 | 36.497.520,09 | 2.513.635,39 | 7,40% | 7,40% | 7,62% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 91.413.603,53 | 0,00 | 0,00 | 97.816.549,69 | 6.402.946,16 | 7,00% | 7,00% | 5,04% |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 93.493.228,03 | 0,00 | 0,00 | 100.027.480,90 | 6.534.252,87 | 6,99% | 6,99% | 5,06% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 49.034.585,81 | 0,00 | 0,00 | 51.616.760,39 | 2.582.174,58 | 5,27% | 5,27% | 7,12% |
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES | 42.558.854,19 | 0,00 | 0,00 | 44.766.780,02 | 2.207.925,83 | 5,19% | 5,19% | 6,14% |
| Total Renda Variável | 609.095.384,38 | 0,00 | 16.800,00 | 655.410.252,09 | 46.331.667,71 | 7,61% | | 6,58% |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Junho / 2023)

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|--|-----------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------------|---------------|------------|--------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 22.455.769,88 | 0,00 | 0,00 | 22.560.883,28 | 105.113,40 | 0,47% | 0,47% | 6,60% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 5.127.661,16 | 0,00 | 0,00 | 5.124.679,38 | -2.981,78 | -0,06% | -0,06% | 5,79% |
| ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ... | 5.176.609,74 | 0,00 | 0,00 | 5.148.276,81 | -28.332,93 | -0,55% | -0,55% | 5,78% |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 28.480.681,94 | 0,00 | 0,00 | 28.309.344,75 | -171.337,19 | -0,60% | -0,60% | 7,04% |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 11.441.958,99 | 0,00 | 0,00 | 11.356.074,61 | -85.884,38 | -0,75% | -0,75% | 5,17% |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR | 28.154.685,05 | 0,00 | 0,00 | 27.936.387,32 | -218.297,73 | -0,78% | -0,78% | 5,16% |
| BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FONTE DE RENDIMENTO | 31.251.989,00 | 0,00 | 0,00 | 30.816.294,60 | -435.694,40 | -1,39% | -1,39% | 5,66% |
| Total Exterior | 132.089.355,76 | 0,00 | 0,00 | 131.251.940,75 | -837.415,01 | -0,63% | | 5,98% |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|-------------------------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|--------------|------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | 1.292.103.013,61 | 39.998.910,69 | 350.455.915,11 | 1.011.547.088,18 | 29.901.078,99 | 2,24% | - |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 101.662.219,26 | 505.779.413,05 | 153.618.191,70 | 463.261.145,17 | 9.437.704,56 | 1,55% | 3,16% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 108.490.365,64 | 0,00 | 0,00 | 112.015.345,07 | 3.524.979,43 | 3,25% | 3,25% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 84.629.364,30 | 50.400,00 | 0,00 | 86.487.722,89 | 1.807.958,59 | 2,14% | 2,14% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 10.611.246,62 | 0,00 | 0,00 | 10.763.373,05 | 152.126,43 | 1,43% | 1,43% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE... | 3.360.684,38 | 0,00 | 0,00 | 3.409.070,51 | 48.386,13 | 1,44% | 1,44% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 0,00 | 2.028.355,90 | 2.031.641,10 | 0,00 | 3.285,20 | 0,16% | 2,90% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 91,04 | 96.774,38 | 96.774,38 | 330,47 | 239,43 | 0,25% | 2,48% |
| Total Renda Fixa | 1.600.856.984,85 | 547.953.854,02 | 506.202.522,29 | 1.687.484.075,34 | 44.875.758,76 | 2,73% | |



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|--|-----------------------|-------------|------------------|-----------------------|----------------------|---------------|------------|
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 90.639.706,82 | 0,00 | 0,00 | 100.027.480,90 | 9.387.774,08 | 10,36% | 10,36% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 88.578.991,77 | 0,00 | 0,00 | 97.816.549,69 | 9.237.557,92 | 10,43% | 10,43% |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | 53.524.838,76 | 0,00 | 0,00 | 61.850.268,14 | 8.325.429,38 | 15,55% | 15,55% |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES | 57.028.829,35 | 0,00 | 0,00 | 65.236.997,07 | 8.208.167,72 | 14,39% | 14,39% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 33.496.134,23 | 0,00 | 0,00 | 40.178.751,91 | 6.682.617,68 | 19,95% | 19,95% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 40.364.432,86 | 0,00 | 0,00 | 46.675.276,80 | 6.310.843,94 | 15,63% | 15,63% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 29.904.287,42 | 0,00 | 0,00 | 35.027.421,77 | 5.123.134,35 | 17,13% | 17,13% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 31.455.955,43 | 0,00 | 0,00 | 35.946.309,87 | 4.490.354,44 | 14,28% | 14,28% |
| BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES | 22.519.544,31 | 0,00 | 0,00 | 26.113.163,31 | 3.593.619,00 | 15,96% | 15,96% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 48.087.613,79 | 0,00 | 0,00 | 51.616.760,39 | 3.529.146,60 | 7,34% | 7,34% |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | 33.097.864,18 | 0,00 | 0,00 | 36.497.520,09 | 3.399.655,91 | 10,27% | 10,27% |
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES | 41.508.801,49 | 0,00 | 0,00 | 44.766.780,02 | 3.257.978,53 | 7,85% | 7,85% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES | 7.408.228,78 | 0,00 | 0,00 | 8.603.221,95 | 1.194.993,17 | 16,13% | 16,13% |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 1.875.300,00 | 0,00 | 50.400,00 | 2.360.400,00 | 535.500,00 | 28,56% | 25,87% |
| SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES | 1.463.029,99 | 0,00 | 0,00 | 1.689.866,44 | 226.836,45 | 15,50% | 15,50% |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES | 865.160,25 | 0,00 | 0,00 | 1.003.483,74 | 138.323,49 | 15,99% | 15,99% |
| Total Renda Variável | 581.818.719,43 | 0,00 | 50.400,00 | 655.410.252,09 | 73.641.932,66 | 12,66% | |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|-----------------------|-------------|-------------|-----------------------|--------------------|---------------|------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 21.363.860,79 | 0,00 | 0,00 | 22.560.883,28 | 1.197.022,49 | 5,60% | 5,60% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 5.003.298,82 | 0,00 | 0,00 | 5.124.679,38 | 121.380,56 | 2,43% | 2,43% |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT... | 27.903.674,71 | 0,00 | 0,00 | 27.936.387,32 | 32.712,61 | 0,12% | 0,12% |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ... | 11.406.172,05 | 0,00 | 0,00 | 11.356.074,61 | -50.097,44 | -0,44% | -0,44% |
| BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | 30.975.920,60 | 0,00 | 0,00 | 30.816.294,60 | -159.626,00 | -0,52% | -0,52% |
| ITAU MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ... | 5.357.656,35 | 0,00 | 0,00 | 5.148.276,81 | -209.379,54 | -3,91% | -3,91% |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME... | 29.461.101,90 | 0,00 | 0,00 | 28.309.344,75 | -1.151.757,15 | -3,91% | -3,91% |
| Total Exterior | 131.471.685,22 | 0,00 | 0,00 | 131.251.940,75 | -219.744,47 | -0,17% | |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------------------|-----------------------|--------------|------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | 1.067.976.064,80 | 238.978.103,63 | 367.833.662,39 | 1.011.547.088,18 | 72.426.582,14 | 5,54% | - |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 71.108.336,35 | 850.981.414,12 | 472.309.580,61 | 463.261.145,17 | 13.480.975,31 | 1,46% | 6,44% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 93.031.393,40 | 12.201.831,44 | 0,00 | 112.015.345,07 | 6.782.120,23 | 6,44% | 6,46% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 81.037.598,75 | 100.800,00 | 0,00 | 86.487.722,89 | 5.349.324,14 | 6,59% | 6,60% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 182.185.160,86 | 0,00 | 185.194.303,90 | 0,00 | 3.009.143,04 | 1,65% | 6,56% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 10.498.689,42 | 0,00 | 307.456,27 | 10.763.373,05 | 572.139,90 | 5,45% | 5,54% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE... | 3.324.825,44 | 0,00 | 97.117,06 | 3.409.070,51 | 181.362,13 | 5,45% | 5,54% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 0,00 | 2.428.355,90 | 2.431.831,72 | 0,00 | 3.475,82 | 0,14% | 5,98% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 4.758,56 | 230.493,84 | 235.323,26 | 330,47 | 401,33 | 0,17% | 5,11% |
| Total Renda Fixa | 1.509.166.827,58 | 1.104.920.998,93 | 1.028.409.275,21 | 1.687.484.075,34 | 101.805.524,04 | 6,42% | |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|--|-----------------------|-------------|-------------------|-----------------------|----------------------|---------------|------------|
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 83.308.679,75 | 0,00 | 0,00 | 100.027.480,90 | 16.718.801,15 | 20,07% | 20,07% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 81.397.330,81 | 0,00 | 0,00 | 97.816.549,69 | 16.419.218,88 | 20,17% | 20,17% |
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES | 38.470.176,55 | 0,00 | 0,00 | 44.766.780,02 | 6.296.603,47 | 16,37% | 16,37% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 35.331.619,87 | 0,00 | 0,00 | 40.178.751,91 | 4.847.132,04 | 13,72% | 13,72% |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | 57.632.150,40 | 0,00 | 0,00 | 61.850.268,14 | 4.218.117,74 | 7,32% | 7,32% |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES | 61.794.096,48 | 0,00 | 0,00 | 65.236.997,07 | 3.442.900,59 | 5,57% | 5,57% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 43.517.339,28 | 0,00 | 0,00 | 46.675.276,80 | 3.157.937,52 | 7,26% | 7,26% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 32.415.963,37 | 0,00 | 0,00 | 35.027.421,77 | 2.611.458,40 | 8,06% | 8,06% |
| BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES | 24.247.722,02 | 0,00 | 0,00 | 26.113.163,31 | 1.865.441,29 | 7,69% | 7,69% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 34.180.085,74 | 0,00 | 0,00 | 35.946.309,87 | 1.766.224,13 | 5,17% | 5,17% |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | 35.520.979,70 | 0,00 | 0,00 | 36.497.520,09 | 976.540,39 | 2,75% | 2,75% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES | 8.007.061,48 | 0,00 | 0,00 | 8.603.221,95 | 596.160,47 | 7,45% | 7,45% |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 1.890.000,00 | 0,00 | 100.800,00 | 2.360.400,00 | 571.200,00 | 30,22% | 24,89% |
| SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES | 1.564.648,36 | 0,00 | 0,00 | 1.689.866,44 | 125.218,08 | 8,00% | 8,00% |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES | 916.843,29 | 0,00 | 0,00 | 1.003.483,74 | 86.640,45 | 9,45% | 9,45% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 52.438.724,82 | 0,00 | 0,00 | 51.616.760,39 | -821.964,43 | -1,57% | -1,57% |
| Total Renda Variável | 592.633.421,92 | 0,00 | 100.800,00 | 655.410.252,09 | 62.877.630,17 | 10,61% | |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|-----------------------|-------------|-------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 19.698.670,78 | 0,00 | 0,00 | 22.560.883,28 | 2.862.212,50 | 14,53% | 14,53% |
| BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | 29.547.850,20 | 0,00 | 0,00 | 30.816.294,60 | 1.268.444,40 | 4,29% | 4,29% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 4.769.058,13 | 0,00 | 0,00 | 5.124.679,38 | 355.621,25 | 7,46% | 7,46% |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ... | 11.003.265,49 | 0,00 | 0,00 | 11.356.074,61 | 352.809,12 | 3,21% | 3,21% |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT... | 27.653.939,99 | 0,00 | 0,00 | 27.936.387,32 | 282.447,33 | 1,02% | 1,02% |
| ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ... | 5.360.955,67 | 0,00 | 0,00 | 5.148.276,81 | -212.678,86 | -3,97% | -3,97% |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME... | 28.842.195,05 | 0,00 | 0,00 | 28.309.344,75 | -532.850,30 | -1,85% | -1,85% |
| Total Exterior | 126.875.935,31 | 0,00 | 0,00 | 131.251.940,75 | 4.376.005,44 | 3,45% | |

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO & MERCADO GESTÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

