

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2024

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



Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			882.317.072,82	32,60%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	94.964.039,32	3,51%	806	2,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDE...	D+0	Não há	628.843.593,98	23,23%	1.191	3,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	163.745,03	0,01%	370	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	80.061.271,54	2,96%	489	1,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	D+0	Não há	199.612.543,41	7,38%	425	2,76%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	D+3	Não há	58.864.838,70	2,17%	20.875	4,17%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	D+3	Não há	39.608.099,41	1,46%	21.760	5,41%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	D+3	Não há	38.762.070,14	1,43%	16.060	3,37%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	D+3	Não há	30.075.230,67	1,11%	47	12,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FICAÇÕES	D+25	Não há	36.987.467,79	1,37%	846	6,66%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FICAÇÕES	D+15	Não há	46.429.732,70	1,72%	198	5,64%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DYNAMIS FICAÇÕES	D+24	Não há	65.600.913,31	2,42%	12.040	4,62%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	D+5	Não há	50.379.098,22	1,86%	32	14,68%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FICAÇÕ...	D+24	Não há	9.138.580,76	0,34%	16	7,23%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FICAÇÕES	D+33	Não há	1.109.510,54	0,04%	2.759	0,43%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FICAÇÕES	D+3	Não há	1.902.043,97	0,07%	107	1,26%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	46.402.796,94	1,71%	109	2,78%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	37.729.479,19	1,39%	40	10,76%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	6.959.262,26	0,26%	55	10,15%	Artigo 9º, Inciso II



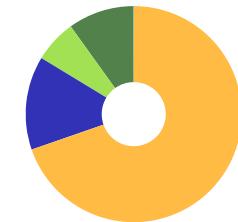
Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2024)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO... ...O DE RENDIMENTO FLEXÍVEL BDR NÍVEL I	D+8	Não há	40.214.226,04	1,49%	4.306	5,98%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	34.701.615,76	1,28%	442	1,30%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	7.370.790,91	0,27%	318	0,96%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICA NA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	131.473.468,85	4,86%	7.888	6,77%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	134.473.815,06	4,97%	597	9,74%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.390.100,00	0,09%		1,72%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.706.535.407,32				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			35.524,95				Artigo 6º
		PL Total	2.706.570.932,27				



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2024)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	882.317.072,82	32,60%	10,00%	60,00%	100,00%	1.824.218.334,50
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	94.964.039,32	3,51%	0,00%	3,00%	90,00%	2.340.917.827,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	90,00%	2.435.881.866,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	908.681.153,96	33,57%	2,00%	3,00%	65,00%	850.566.860,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	1.759.248.014,76
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.326.770,37
Total Renda Fixa	100,00%	1.885.962.266,10	69,68%	12,00%	66,00%	415,00%	



- █ RENDA FIXA 1.885.962.266,10
- █ RENDA VARIÁVEL 378.857.586,21
- █ EXTERIOR 173.378.171,10
- █ ESTRUTURADOS 265.947.283,91
- █ FUNDO IMOBILIÁRIO 2.390.100,00

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!





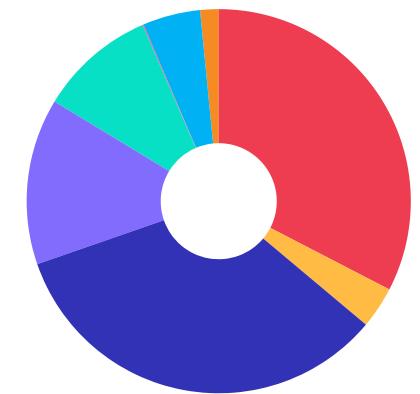
CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2024)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2024			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	378.857.586,21	14,00%	0,00%	18,20%	35,00%	568.429.806,35
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	947.287.392,56
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	265.947.283,91	9,83%	0,00%	9,50%	10,00%	4.706.256,82
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	135.326.770,37
Artigo 11º	5,00%	2.390.100,00	0,09%	0,00%	0,30%	5,00%	132.936.670,37
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	647.194.970,12	23,91%	0,00%	28,00%	90,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	131.305.764,43	4,85%	0,00%	4,30%	10,00%	139.347.776,30
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	42.072.406,67	1,55%	0,00%	1,70%	10,00%	228.581.134,06
Total Exterior	10,00%	173.378.171,10	6,41%	0,00%	6,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2024			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	270.653.540,73





Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2024		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	882.317.072,82	32,60	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	94.964.039,32	3,51	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	0,00	0,00	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	908.681.153,96	33,57	2,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	0,00	0,00	0,00	65,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	378.857.586,21	14,00	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	131.305.764,43	4,85	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	42.072.406,67	1,55	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	265.947.283,91	9,83	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	2.390.100,00	0,09	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00



Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	882.317.072,82	32,60	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	850.210.878,36	31,41	-
CAIXA DTVM	427.171.440,99	15,78	2,10
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	406.646.534,04	15,02	0,03
ITAÚ DTVM	59.517.678,98	2,20	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	40.214.226,04	1,49	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	30.075.230,67	1,11	0,43
SAFRA ASSET MANAGEMENT	7.370.790,91	0,27	0,00
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE INVESTIMENTOS	3.011.554,51	0,11	-

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)



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,60%	4,60%	1,53%	3,33%	7,94%	20,67%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,59%	4,32%	1,52%	3,11%	7,68%	20,09%	1,34%	1,88%

CDI (Benchmark)	0,87%	7,10%	2,58%	5,23%	11,21%	26,28%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,89%	7,21%	2,68%	5,34%	11,32%	26,39%	0,01%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	0,89%	7,44%	2,68%	5,45%	11,86%	27,48%	0,01%	0,09%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,87%	7,17%	2,64%	5,24%	11,44%	26,80%	0,04%	0,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,78%	6,37%	2,32%	4,69%	10,11%	23,11%	0,00%	0,05%



Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,55%	42,25%	13,74%	27,72%	48,00%	71,14%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,57%	41,02%	13,95%	26,91%	46,38%	68,28%	9,23%	15,18%

Ibovespa (Benchmark)	6,54%	1,36%	11,39%	5,41%	17,51%	24,18%	-	-
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FICAÇÕES	6,90%	1,01%	11,26%	3,30%	13,74%	14,85%	6,20%	14,38%
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	4,68%	-4,65%	9,30%	1,40%	9,11%	10,30%	5,93%	12,93%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FICAÇÕES	4,51%	-2,60%	8,56%	0,89%	7,56%	8,51%	6,53%	14,00%
SAFRA AÇÕES LIVRE FICAÇÕES	6,79%	-0,51%	10,76%	1,70%	10,94%	12,85%	7,56%	15,69%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FICAÇÕES	6,62%	1,31%	11,49%	5,43%	17,51%	24,32%	5,55%	13,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FICAÇÕES	5,14%	-1,52%	10,43%	1,98%	9,10%	8,82%	6,26%	14,44%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	4,80%	-2,79%	9,44%	1,31%	10,06%	14,96%	5,68%	13,21%
ITAÚ DUNAMIS FICAÇÕES	7,64%	12,25%	15,21%	11,73%	30,30%	27,56%	6,26%	12,82%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FICAÇÕES	9,54%	2,74%	10,19%	3,26%	17,40%	26,11%	7,33%	16,04%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	5,47%	-4,77%	10,69%	-0,06%	8,83%	1,51%	5,22%	13,58%

IFIX (Benchmark)	0,86%	2,48%	0,33%	1,00%	5,63%	14,02%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,13%	-0,54%	1,63%	-21,89%	-5,16%	15,62%	13,18%	39,83%

MSCI ACWI (Benchmark)	2,29%	33,98%	14,52%	24,30%	39,63%	48,51%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,48%	21,25%	7,95%	12,81%	30,89%	61,90%	9,25%	12,29%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	2,28%	18,42%	7,03%	10,83%	25,31%	42,82%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	1,74%	19,99%	7,29%	12,12%	28,27%	52,77%	9,37%	12,31%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2,49%	21,30%	8,02%	12,90%	30,96%	61,90%	9,24%	12,28%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

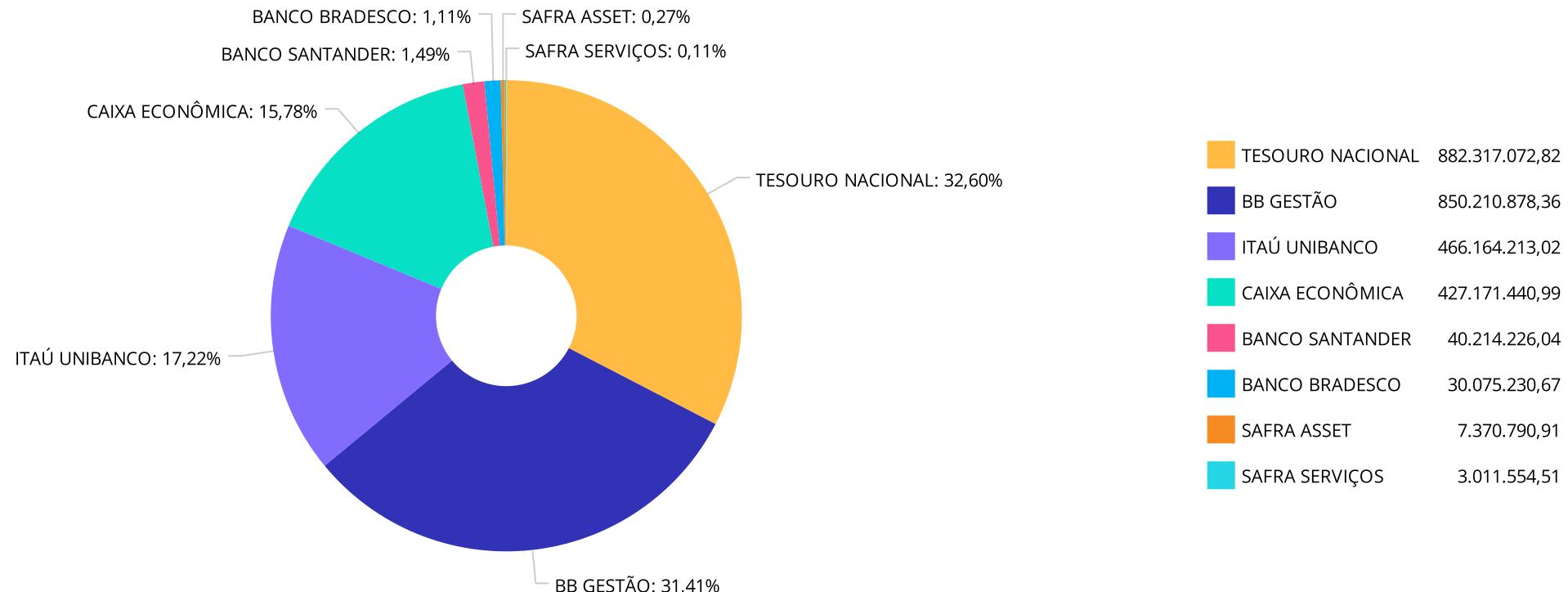
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2024 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,55%	42,25%	13,74%	27,72%	48,00%	71,14%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	0,57%	41,02%	13,95%	26,91%	46,38%	68,28%	9,23%	15,184%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2,16%	31,65%	13,54%	22,58%	36,50%	49,59%	9,09%	13,346%
MSCI WORLD (Benchmark)	2,40%	34,97%	14,68%	24,52%	40,91%	52,19%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	3,15%	28,88%	11,81%	22,30%	31,99%	31,27%	12,58%	15,204%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,98%	35,37%	13,84%	23,58%	43,79%	60,63%	12,12%	14,535%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2,53%	32,97%	13,81%	23,40%	38,53%	49,25%	8,94%	11,715%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FICAÇÕES	0,93%	27,17%	13,56%	24,77%	31,40%	28,99%	8,96%	13,135%



CRÉDITO
& MERCADO

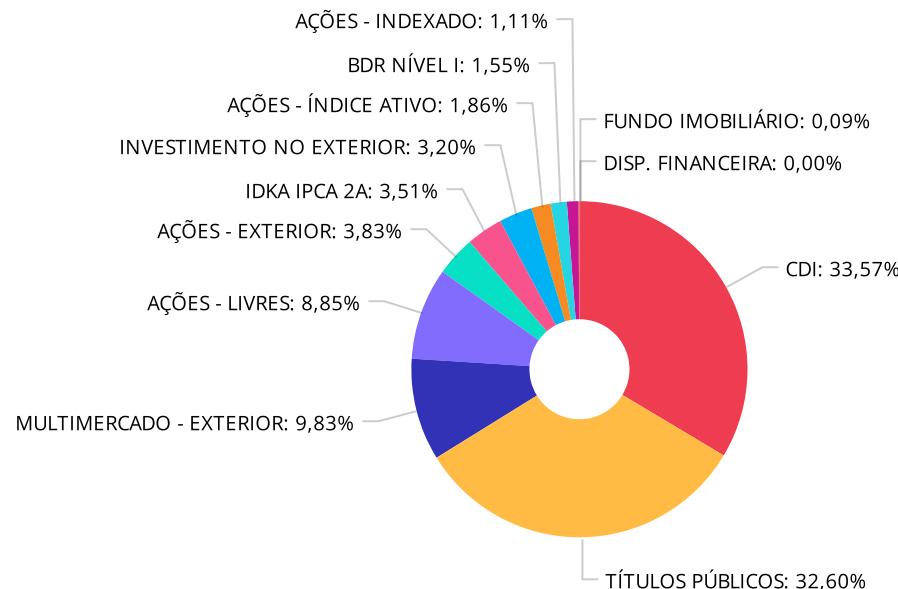
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2024)





CRÉDITO
& MERCADO

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2024)



■ CDI	908.681.153,96	■ TÍTULOS PÚBLICOS	882.317.072,82	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	265.947.283,91	■ AÇÕES - LIVRES	239.538.418,62
■ AÇÕES - EXTERIOR	103.553.580,15	■ IDKA IPCA 2A	94.964.039,32	■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR	86.617.022,98	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	50.379.098,22
■ BDR NÍVEL I	42.072.406,67	■ AÇÕES - INDEXADO	30.075.230,67	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.390.100,00	■ DISP. FINANCEIRA	35.524,95



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2024)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/03/2022	10.335	3.855,205568	4.346,001833	39.843.549,55	44.915.928,94	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/07/2022	9.782	4.089,215327	4.335,639804	40.000.704,33	42.411.228,56	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	11/07/2022	7.384	4.062,955171	4.309,516786	30.000.860,98	31.821.471,94	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	9.987	4.004,964372	4.356,683226	39.997.579,18	43.510.195,37	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/02/2022	10.047	3.981,059981	4.483,081862	39.997.709,63	45.041.523,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/03/2022	15.090	3.904,253962	4.469,664307	58.915.192,29	67.447.234,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	29/06/2022	296	4.047,135758	4.429,731004	1.197.952,18	1.311.200,37	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/07/2022	498	3.985,691744	4.390,268113	1.984.874,49	2.186.353,52	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/03/2022	10.178	3.916,536627	4.419,515708	39.862.509,79	44.981.830,87	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2022	10.225	3.911,428571	4.397,62209	39.994.357,14	44.965.685,87	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/03/2022	3.890	3.876,160059	4.362,90217	15.078.262,63	16.971.689,44	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/02/2022	15.015	3.926,828179	4.509,865184	58.961.325,11	67.715.625,73	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/05/2022	2.400	4.016,527746	4.479,206351	9.639.666,59	10.750.095,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/05/2022	4.840	4.131,678715	4.484,294578	19.997.324,98	21.703.985,75	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	11/05/2022	2.310	4.113,158402	4.458,935441	9.501.395,91	10.300.140,86	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	223	4.039,820802	4.433,783459	900.880,04	988.733,71	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	520	4.013,452065	4.433,783459	2.086.995,07	2.305.567,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/05/2022	4.940	3.993,115642	4.391,446303	19.725.991,27	21.693.744,73	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	15/06/2022	9.790	4.007,081511	4.374,636597	39.229.327,99	42.827.692,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	06/02/2023	10.000	3.785,199052	4.083,114422	37.851.990,52	40.831.144,22	Curva



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2024)

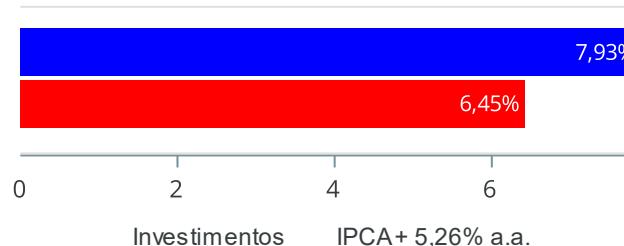
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	03/03/2023	10.479	3.816,987204	4.083,114422	39.998.208,91	42.786.956,02	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/07/2022	5.050	3.929,948645	4.336,662628	19.846.240,66	21.900.146,27	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	10.386	3.851,268116	4.118,753589	39.999.270,65	42.777.374,77	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	29/06/2022	4.935	3.965,241251	4.318,247476	19.568.465,57	21.310.551,29	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	07/07/2022	5.024	3.888,609735	4.227,466429	19.536.375,31	21.238.791,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	23/11/2022	10.213	3.916,628783	4.209,690002	40.000.529,76	42.993.563,99	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	06/02/2023	10.327	3.760,654822	4.055,187435	38.836.282,35	41.877.920,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	03/03/2023	10.549	3.792,196447	4.055,187435	40.003.880,32	42.778.172,25	Curva



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2024

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	2.567.523.344,80	45.095.927,70	48.822.037,76	2.569.922.536,57	6.125.301,83	6.125.301,83	0,23%	0,23%	0,87%	0,87%	26,94%	3,19%
Fevereiro	2.569.922.536,57	58.312.581,69	62.621.601,41	2.610.448.028,88	44.834.512,03	50.959.813,86	1,71%	1,94%	1,22%	2,10%	92,52%	3,53%
Março	2.610.448.028,88	33.594.187,36	44.184.187,36	2.629.918.510,18	30.060.481,30	81.020.295,16	1,14%	3,10%	0,57%	2,68%	115,72%	2,91%
Abril	2.629.918.510,18	40.962.954,53	48.037.406,87	2.608.903.681,39	-13.940.376,45	67.079.918,71	-0,52%	2,57%	0,83%	3,53%	72,58%	3,59%
Maio	2.608.903.681,39	36.565.347,44	51.724.247,54	2.617.357.295,49	23.612.514,20	90.692.432,91	0,89%	3,48%	0,89%	4,46%	78,11%	2,76%
Junho	2.617.357.295,49	155.426.054,88	169.999.186,01	2.646.377.469,80	43.593.305,44	134.285.738,35	1,57%	5,11%	0,62%	5,10%	100,11%	2,52%
Julho	2.646.377.469,80	108.635.700,00	119.435.955,52	2.667.369.140,94	31.791.926,66	166.077.665,01	1,15%	6,32%	0,85%	6,00%	105,41%	3,15%
Agosto	2.667.369.140,94	325.294.955,59	339.427.829,40	2.698.566.075,99	45.329.808,86	211.407.473,87	1,51%	7,93%	0,43%	6,45%	122,96%	3,83%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

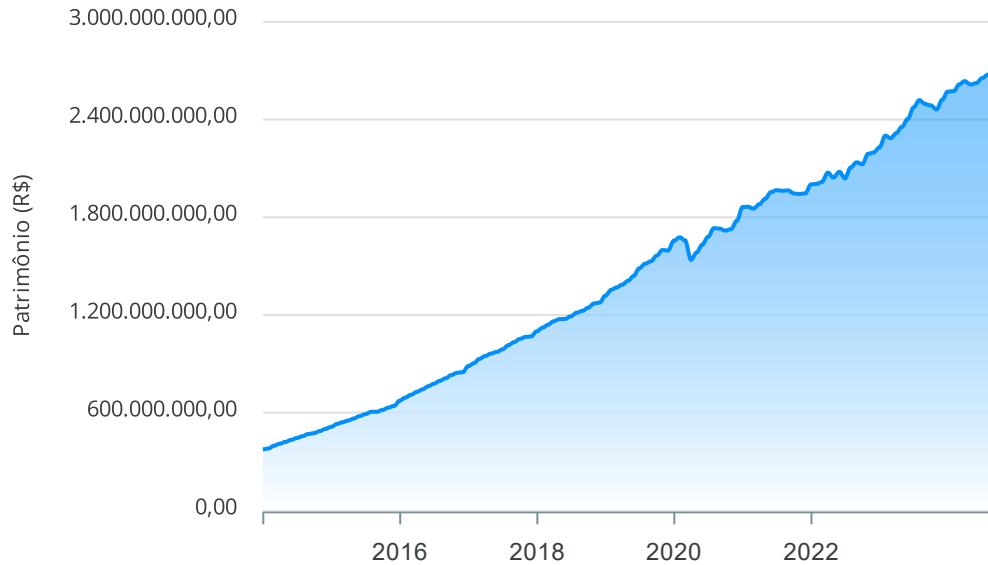




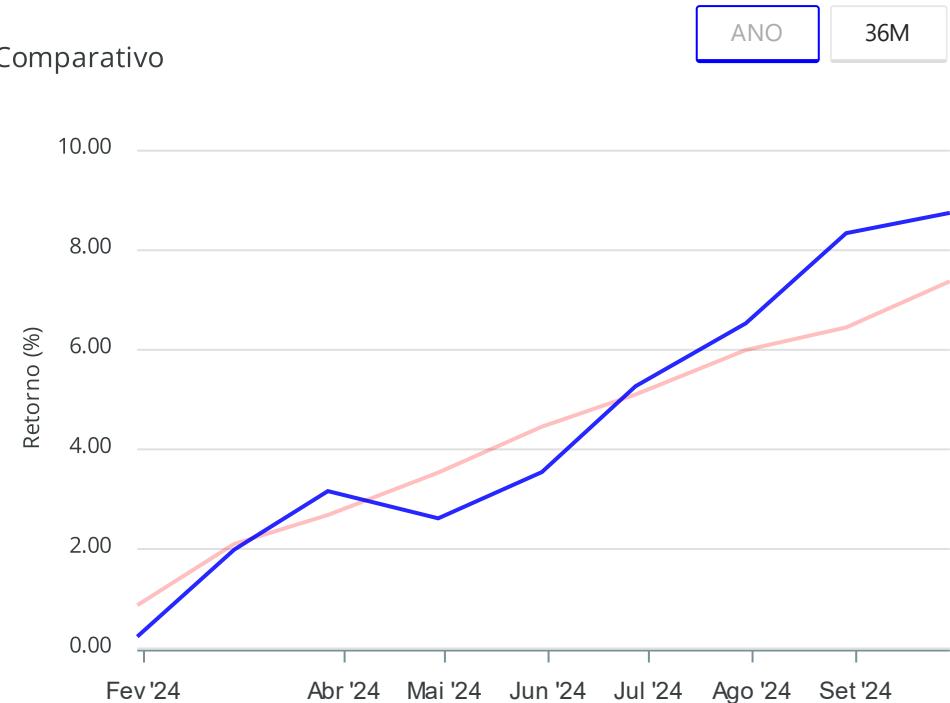
CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos

- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMML
- IDIV



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2024

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	197.856.402,84	0,00	0,00	199.612.543,41	1.756.140,57	0,89%	0,89%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	513.574.521,79	233.633.510,56	123.742.716,95	628.843.593,98	5.378.278,58	0,72%	0,89%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.063.859.575,51	0,00	188.802.542,88	882.317.072,82	7.260.040,19	0,68%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	94.388.179,68	17.700,00	0,00	94.964.039,32	558.159,64	0,59%	0,59%	1,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.416.201,22	0,00	11.477.316,09	0,00	61.114,87	0,54%	0,90%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.614.245,07	0,00	3.632.225,53	0,00	17.980,46	0,50%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	80.000.000,00	0,00	80.061.271,54	61.271,54	0,08%	0,86%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	12.360.000,00	12.364.327,95	0,00	4.327,95	0,04%	0,79%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	0,00	163.745,03	0,00	163.745,03	0,00	0,00%	0,78%	0,00%
Total Renda Fixa	1.884.709.126,11	326.174.955,59	340.019.129,40	1.885.962.266,10	15.097.313,80	0,80%		0,14%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/2024

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FICAÇÕES	42.385.150,37	0,00	0,00	46.429.732,70	4.044.582,33	9,54%	9,54%	7,33%
ITAÚ DUNAMIS FICAÇÕES	60.943.038,51	0,00	0,00	65.600.913,31	4.657.874,80	7,64%	7,64%	6,26%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FICAÇÕES	1.779.242,45	0,00	0,00	1.902.043,97	122.801,52	6,90%	6,90%	6,20%
SAFRA AÇÕES LIVRE FICAÇÕES	1.038.982,31	0,00	0,00	1.109.510,54	70.528,23	6,79%	6,79%	7,56%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	28.209.117,31	0,00	0,00	30.075.230,67	1.866.113,36	6,62%	6,62%	5,55%
BB RETORNO TOTAL FICAÇÕES	37.553.034,47	0,00	0,00	39.608.099,41	2.055.064,94	5,47%	5,47%	5,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FICAÇÕES	8.691.466,82	0,00	0,00	9.138.580,76	447.113,94	5,14%	5,14%	6,26%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	48.070.165,48	0,00	0,00	50.379.098,22	2.308.932,74	4,80%	4,80%	5,68%
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	37.029.536,89	0,00	0,00	38.762.070,14	1.732.533,25	4,68%	4,68%	5,93%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FICAÇÕES	35.390.261,38	0,00	0,00	36.987.467,79	1.597.206,41	4,51%	4,51%	6,53%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	131.213.196,11	0,00	0,00	134.473.815,06	3.260.618,95	2,48%	2,48%	9,24%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	128.287.541,85	0,00	0,00	131.473.468,85	3.185.927,00	2,48%	2,48%	9,25%
CAXIA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.363.400,00	0,00	17.700,00	2.390.100,00	44.400,00	1,88%	1,90%	13,18%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	57.857.537,43	0,00	0,00	58.864.838,70	1.007.301,27	1,74%	1,74%	9,37%
Total Renda Variável	620.811.671,38	0,00	17.700,00	647.194.970,12	26.400.998,74	4,25%		7,73%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/08/2024

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Agosto / 2024)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	36.576.839,30	0,00	0,00	37.729.479,19	1.152.639,89	3,15%	3,15%	12,58%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	45.060.410,02	0,00	0,00	46.402.796,94	1.342.386,92	2,98%	2,98%	12,12%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	39.221.694,48	0,00	0,00	40.214.226,04	992.531,56	2,53%	2,53%	8,94%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	7.214.596,86	0,00	0,00	7.370.790,91	156.194,05	2,16%	2,16%	9,09%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6.895.190,33	0,00	0,00	6.959.262,26	64.071,93	0,93%	0,93%	8,96%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	34.506.490,89	0,00	0,00	34.701.615,76	195.124,87	0,57%	0,57%	9,23%
Total Exterior	169.475.221,88	0,00	0,00	173.378.171,10	3.902.949,22	2,30%		10,65%

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 E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. 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.

