



Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2023

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/11/2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			1.016.767.638,66	40,32%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	3.454.882,83	0,14%	140	1,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	10.906.692,79	0,43%	92	5,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	89.623.292,90	3,55%	860	1,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	5.713,56	0,00%	14.402	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	456.626.296,40	18,11%	1.131	2,97%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	118.375.033,85	4,69%	392	2,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	46.689.570,88	1,85%	19.344	4,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	39.384.770,62	1,56%	26.392	4,63%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	38.635.993,29	1,53%	18.635	2,70%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	D+3	Não há	28.150.593,11	1,12%	45	9,77%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	65.427.106,52	2,59%	131	15,24%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	36.026.870,36	1,43%	958	5,60%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	42.370.241,90	1,68%	207	5,38%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	66.592.611,60	2,64%	88	16,14%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	54.438.214,21	2,16%	14.426	3,34%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	49.184.294,06	1,95%	35	11,11%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	8.795.686,70	0,35%	17	5,52%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.048.241,56	0,04%	3.898	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.770.182,54	0,07%	145	1,14%	Artigo 8º, Inciso I



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/11/2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 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	33.068.695,20	1,31%	118	2,63%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	27.850.824,62	1,10%	52	7,33%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	11.805.013,89	0,47%	601	18,01%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	5.347.925,75	0,21%	71	9,12%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	29.072.592,59	1,15%	3.988	5,02%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	23.987.014,55	0,95%	470	1,23%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	5.461.848,51	0,22%	350	0,84%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	103.085.233,09	4,09%	6.479	6,65%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	105.407.787,83	4,18%	602	9,01%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.346.300,00	0,09%		1,66%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.521.707.164,37				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			15.718,37				Artigo 6º
PL Total			2.521.722.882,74				



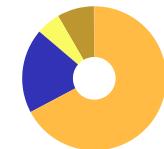
CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	1.016.767.638,66	40,32%	10,00%	60,00%	100,00%	1.504.939.525,71
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	103.990.582,08	4,12%	0,00%	3,00%	90,00%	2.165.545.865,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	90,00%	2.269.536.447,93
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	575.001.330,25	22,80%	2,00%	3,00%	65,00%	1.064.108.326,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	1.639.109.656,84
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	126.085.358,22
Total Renda Fixa	100,00%	1.695.759.550,99	67,25%	12,00%	66,00%	415,00%	



RENDA FIXA 1.695.759.550,99

RENDA VARIÁVEL 478.514.377,35

EXTERIOR 136.593.915,11

ESTRUTURADOS 208.493.020,92

FUNDO IMOBILIÁRIO 2.346.300,00



CRÉDITO
& MERCADO

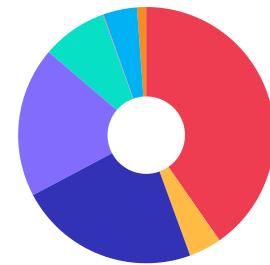
FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	478.514.377,35	18,98%	0,00%	18,20%	35,00%	404.083.130,18
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	882.597.507,53
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	208.493.020,92	8,27%	0,00%	9,50%	10,00%	43.677.695,52
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	126.085.358,22
Artigo 11º	5,00%	2.346.300,00	0,09%	0,00%	0,30%	5,00%	123.739.058,22
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	689.353.698,27	27,34%	0,00%	28,00%	90,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	107.145.052,05	4,25%	0,00%	4,30%	10,00%	145.025.664,39
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	29.448.863,06	1,17%	0,00%	1,70%	10,00%	222.721.853,38
Total Exterior	10,00%	136.593.915,11	5,42%	0,00%	6,00%	20,00%	



■ 7º I a ■ 7º I b ■ 7º III a ■ 8º I
■ 10º I ■ 11º ■ 9º II ■ 9º III



Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	1.016.767.638,66	40,32	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTV	656.617.726,63	26,04	-
CAIXA DTV	375.842.291,85	14,90	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	283.568.961,64	11,25	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	93.577.699,63	3,71	-
ITAÚ DTV	57.979.980,76	2,30	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	29.072.592,59	1,15	-
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE INVESTIMENTOS	8.280.272,61	0,33	-

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'	1.016.767.638,66	40,32	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	103.990.582,08	4,12	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	575.001.330,25	22,80	2,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	65,00
Artigo 8º, Inciso I	478.514.377,35	18,98	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	107.145.052,05	4,25	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	29.448.863,06	1,17	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	208.493.020,92	8,27	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	2.346.300,00	0,09	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: 30/11/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,83%	10,52%	1,71%	4,50%	11,89%	21,85%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,73%	10,35%	1,80%	4,60%	11,72%	21,20%	0,66%	0,02%

CDI (Benchmark)	0,92%	12,04%	2,92%	6,33%	13,30%	26,87%	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,71%	9,38%	2,27%	4,95%	10,35%	20,55%	0,01%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,99%	12,50%	3,14%	6,91%	13,77%	28,30%	0,03%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,91%	11,97%	2,90%	6,35%	13,23%	27,07%	0,01%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,28%	4,04%	0,78%	1,05%	4,68%	10,86%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	10,11%	2,33%	5,30%	11,56%	22,23%	0,29%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	10,12%	2,33%	5,31%	11,57%	22,63%	0,29%	0,02%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,46%	22,84%	1,17%	7,21%	17,66%	-10,11%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,42%	21,77%	1,18%	6,82%	15,93%	-11,50%	4,68%	0,16%

Ibovespa (Benchmark)	12,54%	16,04%	10,01%	17,53%	13,20%	24,94%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	10,62%	11,14%	4,77%	11,99%	7,08%	11,54%	7,68%	0,17%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	13,20%	3,81%	8,13%	11,02%	5,68%	10,23%	8,27%	0,16%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	10,94%	5,88%	4,31%	8,33%	3,15%	15,74%	6,60%	0,17%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10,99%	10,88%	8,22%	15,89%	7,70%	1,13%	6,84%	0,18%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	11,48%	13,04%	8,75%	17,12%	10,14%	16,18%	6,34%	0,17%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	11,79%	14,33%	4,81%	12,61%	11,89%	9,14%	8,89%	0,19%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	12,33%	15,55%	9,80%	17,25%	12,91%	24,72%	6,63%	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	11,60%	9,85%	5,01%	10,15%	6,89%	7,03%	8,08%	0,18%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	12,55%	16,10%	9,99%	17,56%	13,33%	24,99%	6,76%	0,18%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	13,79%	19,92%	7,14%	15,76%	16,95%	29,99%	7,67%	0,18%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	11,48%	13,02%	7,45%	13,87%	10,62%	20,57%	6,96%	0,17%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	11,53%	13,14%	5,86%	13,27%	10,98%	8,47%	8,25%	0,18%

IFIX (Benchmark)	0,66%	10,79%	-1,13%	5,41%	10,79%	23,20%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,14%	24,14%	-6,89%	14,80%	13,38%	15,02%	7,88%	0,23%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI ACWI (Benchmark)	6,44%	8,50%	1,48%	4,05%	2,60%	-16,06%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9,35%	26,64%	2,63%	12,77%	20,44%	17,68%	6,26%	0,14%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	8,92%	18,97%	1,33%	9,28%	11,95%	0,02%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	8,63%	21,37%	1,74%	9,71%	15,80%	10,74%	5,31%	0,14%
ITÁU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	9,33%	26,53%	2,65%	12,74%	20,44%	17,62%	6,25%	0,14%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,46%	22,84%	1,17%	7,21%	17,66%	-10,11%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,24%	14,53%	1,15%	6,52%	9,18%	-17,53%	4,31%	14,987%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,42%	21,77%	1,18%	6,82%	15,93%	-11,50%	4,68%	16,408%

MSCI WORLD (Benchmark)	6,58%	9,89%	1,54%	4,57%	3,60%	-14,39%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	6,19%	11,92%	2,47%	5,81%	10,96%	-6,02%	4,42%	16,269%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	6,53%	5,13%	0,15%	3,26%	2,88%	-21,04%	4,52%	12,872%
ITÁU MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	6,33%	-0,24%	0,97%	3,31%	0,12%	-22,67%	6,26%	15,049%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	6,60%	7,29%	0,25%	3,17%	5,73%	-27,16%	4,87%	15,102%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	5,88%	-3,44%	-2,57%	-2,21%	-4,19%	-25,83%	6,58%	16,257%

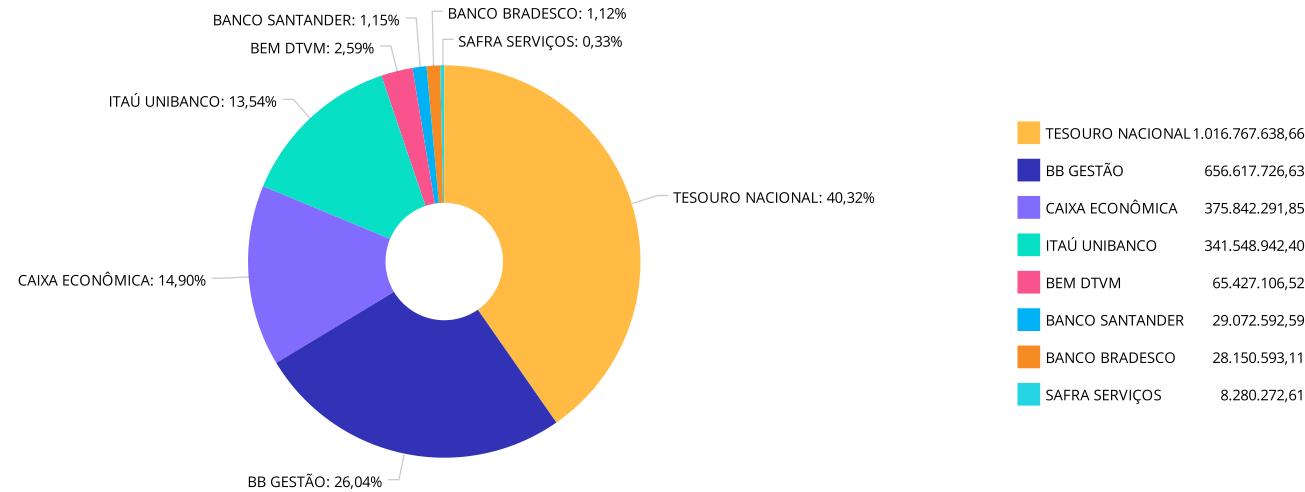


CRÉDITO
& MERCADO

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

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023



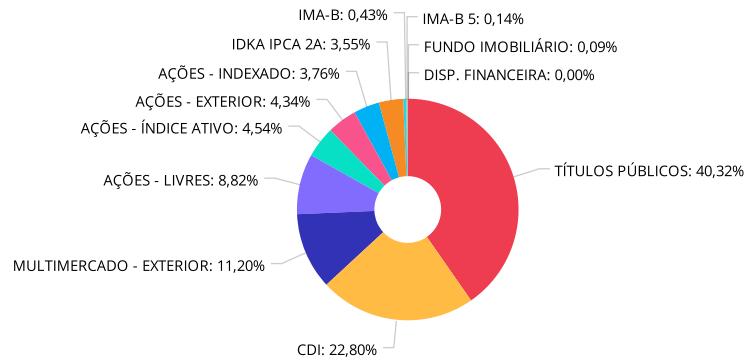


CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	1.016.767.638,66	■ CDI	575.007.043,81	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	282.439.322,60	■ AÇÕES - LIVRES	222.470.201,18
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	114.611.400,58	■ AÇÕES - EXTERIOR	109.337.184,31	■ AÇÕES - INDEXADO	94.743.204,71	■ IDKA IPCA 2A	89.623.292,90
■ IMA-B	10.906.692,79	■ IMA-B 5	3.454.882,83	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.346.300,00	■ DISP. FINANCEIRA	15.718,37



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Novembro / 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	23/11/2022	3.761	3988,237004	4.215,821418	14.999.759,37	15.855.704,35	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23/11/2022	1.254	3.988,237004	4.215,821418	5.001.249,20	5.286.640,05	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	2.515	3977,260022	4.207,647944	10.002.808,96	10.582.234,57	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	3.771	3.977,260022	4.207,647944	14.998.247,54	15.867.040,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/05/2023	9.712	4.118,503984	4.197,083249	39.998.910,69	40.762.072,51	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/06/2022	9.875	3.971,848591	4.237,80898	39.222.004,84	41.848.363,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	29/08/2022	7.642	3925,476529	4.217,733561	29.998.491,63	32.231.919,87	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/03/2022	10.335	3.855,205568	4.257,117876	39.843.549,55	43.997.313,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/07/2022	9.782	4089,215327	4.246,065773	40.000.704,33	41.535.015,39	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	11/07/2022	7.384	4062,955171	4.219,012489	30.000.860,98	31.153.188,21	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	9.987	4004,964372	4.267,870036	39.997.579,18	42.623.218,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/02/2022	10.047	3.981,059981	4.269,553055	39.997.709,63	42.896.199,54	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/03/2022	15.090	3.904,253962	4.255,93893	58.915.192,29	64.222.118,45	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	29/06/2022	296	4047,135758	4.215,442322	1.197.952,18	1.247.770,92	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/07/2022	498	3.985,691744	4.175,453953	1.984.874,49	2.079.376,06	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/03/2022	10.178	3.916,536627	4.328,962799	39.862.509,79	44.060.183,36	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2022	10.225	3.911,428571	4.307,212692	39.994.357,14	44.041.249,77	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/03/2022	3.890	3.876,160059	4.272,735794	15.078.262,63	16.620.942,23	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/02/2022	15.015	3.926,828179	4.293,140319	58.961.325,11	64.461.501,88	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/05/2022	2.400	4.016,527746	4.262,975116	9.639.666,59	10.231.140,27	Curva



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Novembro / 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	4.267,982515	19.997.324,98	20.657.035,37	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	11/05/2022	2.310	4113,158402	4.243,037171	9.501.395,91	9.801.415,86	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	223	4039,820802	4.218,304288	900.880,04	940.681,85	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	520	4.013,452065	4.218,304288	2.086.995,07	2.193.518,22	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/05/2022	4.940	3.993,115642	4.300,014036	19.725.991,27	21.242.069,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	15/06/2022	9.790	4.007,081511	4.283,58377	39.229.327,99	41.936.285,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	06/02/2023	10.000	3.785,199052	3.998,928569	37.851.990,52	39.989.285,69	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	03/03/2023	10.479	3816,987204	3.998,928569	39.998.208,91	41.904.772,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/07/2022	5.050	3.929,948645	4.123,336861	19.846.240,66	20.822.860,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	10.386	3851,268116	3.911,399074	39.999.270,65	40.623.790,78	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	29/06/2022	4.935	3.965,241251	4.228,535711	19.568.465,57	20.867.823,73	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	07/07/2022	5.024	3.888,609735	4.140,389664	19.536.375,31	20.801.317,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	23/11/2022	10.213	3.916,628783	4.123,134552	40.000.529,76	42.109.573,17	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	06/02/2023	10.327	3.760,654822	3.973,216702	38.836.282,35	41.031.408,88	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	03/03/2023	10.549	3792,196447	3.973,216702	40.003.880,32	41.913.462,98	Curva



CRÉDITO
& MERCADO

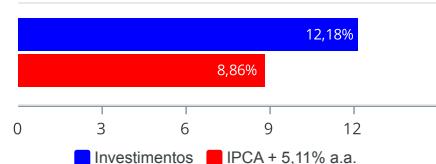
FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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%
Abri	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%
Julho	2.471.521.037,72	48.416.570,48	42.713.570,48	2.513.079.886,22	35.855.848,50	204.819.944,51	1,45%	8,96%	0,54%	5,99%	149,59%	3,29%
Agosto	2.513.079.886,22	46.803.376,65	62.288.049,02	2.492.695.308,12	-4.899.905,73	199.920.038,78	-0,19%	8,75%	0,69%	6,72%	130,27%	3,34%
Setembro	2.492.695.308,12	39.635.307,60	47.101.023,91	2.484.306.350,49	-923.241,32	198.996.797,46	-0,04%	8,71%	0,66%	7,42%	117,42%	3,31%
Outubro	2.484.306.350,49	222.613.242,63	237.276.172,17	2.458.572.691,29	-11.070.729,66	187.926.067,80	-0,41%	8,27%	0,66%	8,13%	101,75%	3,86%
Novembro	2.458.572.691,29	35.795.404,87	66.604.404,91	2.517.854.307,58	90.090.616,33	278.016.684,13	3,61%	12,18%	0,68%	8,86%	137,48%	3,59%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

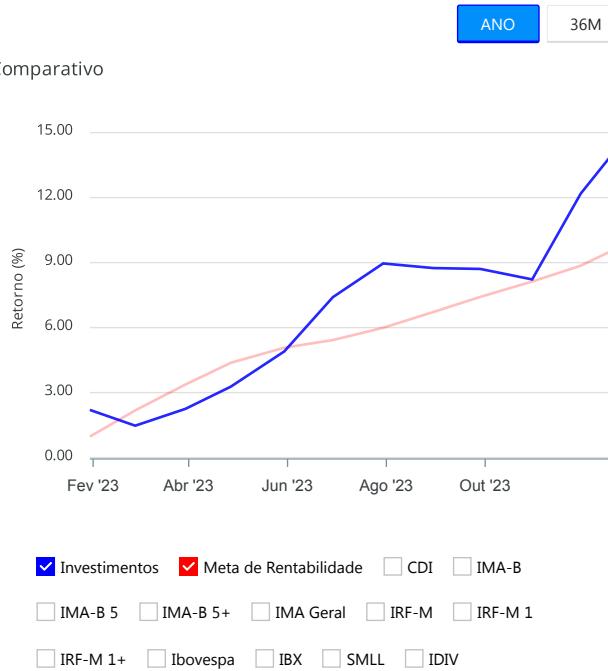
FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

Evolução do Patrimônio



Comparativo



ANO

36M

- 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 SMLL IDIV



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	88.081.315,64	17.400,00	0,00	89.623.292,90	1.524.577,26	1,73%	1,73%	0,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	117.216.041,25	0,00	0,00	118.375.033,85	1.158.992,60	0,99%	0,99%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	474.561.980,00	35.466.736,21	57.875.855,07	456.626.296,40	4.473.435,26	0,88%	0,91%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.428.012,81	0,00	0,00	3.454.882,83	26.870,02	0,78%	0,78%	0,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.821.950,95	0,00	0,00	10.906.692,79	84.741,84	0,78%	0,78%	0,29%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.017.672.527,68	0,00	8.199.736,25	1.016.767.638,66	7.294.847,23	0,72%	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.617,04	1.122.268,66	1.122.268,66	5.713,56	4.096,52	0,36%	0,71%	0,01%
Total Renda Fixa	1.711.783.445,37	36.606.404,87	67.197.859,98	1.695.759.550,99	14.567.560,73	0,85%		0,11%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	37.235.133,91	0,00	0,00	42.370.241,90	5.135.107,99	13,79%	13,79%	7,67%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	48.089.013,08	0,00	0,00	54.438.214,21	6.349.201,13	13,20%	13,20%	8,27%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	25.011.344,84	0,00	0,00	28.150.593,11	3.139.248,27	12,55%	12,55%	6,76%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	59.282.653,71	0,00	0,00	66.592.611,60	7.309.957,89	12,33%	12,33%	6,63%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	937.657,07	0,00	0,00	1.048.241,56	110.584,49	11,79%	11,79%	8,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	7.881.357,25	0,00	0,00	8.795.686,70	914.329,45	11,60%	11,60%	8,08%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	1.587.235,21	0,00	0,00	1.770.182,54	182.947,33	11,53%	11,53%	8,25%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	44.119.476,42	0,00	0,00	49.184.294,06	5.064.817,64	11,48%	11,48%	6,96%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	34.658.141,05	0,00	0,00	38.635.993,29	3.977.852,24	11,48%	11,48%	6,34%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	35.486.046,42	0,00	0,00	39.384.770,62	3.898.724,20	10,99%	10,99%	6,84%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	58.975.032,41	0,00	0,00	65.427.106,52	6.452.074,11	10,94%	10,94%	6,60%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	32.567.401,59	0,00	0,00	36.026.870,36	3.459.468,77	10,62%	10,62%	7,68%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	94.269.065,33	0,00	0,00	103.085.233,09	8.816.167,76	9,35%	9,35%	6,26%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	96.410.251,59	0,00	0,00	105.407.787,83	8.997.536,24	9,33%	9,33%	6,25%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	42.979.338,58	0,00	0,00	46.689.570,88	3.710.232,30	8,63%	8,63%	5,31%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.397.600,00	0,00	17.400,00	2.346.300,00	-33.900,00	-1,41%	-1,42%	7,88%
Total Renda Variável	621.886.748,46	0,00	17.400,00	689.353.698,27	67.484.349,81	10,85%		6,73%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	11.074.280,23	0,00	0,00	11.805.013,89	730.733,66	6,60%	6,60%	4,87%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	27.289.728,40	0,00	0,00	29.072.592,59	1.782.864,19	6,53%	6,53%	4,52%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	22.539.838,18	0,00	0,00	23.987.014,55	1.447.176,37	6,42%	6,42%	4,68%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5.029.419,41	0,00	0,00	5.347.925,75	318.506,34	6,33%	6,33%	6,26%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.141.145,30	0,00	0,00	5.461.848,51	320.703,21	6,24%	6,24%	4,31%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	31.140.669,30	0,00	0,00	33.068.695,20	1.928.025,90	6,19%	6,19%	4,42%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	26.303.582,00	0,00	0,00	27.850.824,62	1.547.242,62	5,88%	5,88%	6,58%
Total Exterior	128.518.662,82	0,00	0,00	136.593.915,11	8.075.252,29	6,28%		5,03%



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.

