

# Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2024

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



**Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2024)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			896.793.664,94	33,79%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	96.313.150,52	3,63%	771	2,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
TREND PÓS-FIXADO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	90.396.519,97	3,41%	95.736	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.028.908,59	0,04%	1.045	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDE...	D+0	Não há	289.377.838,69	10,90%	1.249	1,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	255.942.726,11	9,64%	529	4,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	D+0	Não há	204.824.169,37	7,72%	454	2,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FICAÇÕES	D+3	Não há	63.700.978,66	2,40%	22.055	3,90%	Artigo 8º, Inciso I
BB IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	D+4	Não há	38.309.282,87	1,44%	25.004	4,85%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	D+3	Não há	36.248.994,31	1,37%	15.540	3,62%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FICAÇÕES	D+3	Não há	27.775.322,69	1,05%	46	13,21%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FICAÇÕES	D+25	Não há	33.145.890,01	1,25%	818	6,75%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FICAÇÕES	D+15	Não há	44.919.616,84	1,69%	193	5,80%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU DUNAMIS FICAÇÕES	D+24	Não há	144.668.760,27	5,45%	14.607	9,98%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	D+5	Não há	45.974.077,54	1,73%	30	15,23%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FICAÇÕ...	D+24	Não há	8.318.462,79	0,31%	14	7,37%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FICAÇÕES	D+33	Não há	988.734,56	0,04%	2.435	0,47%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FICAÇÕES	D+3	Não há	1.723.949,18	0,06%	96	1,49%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	50.514.128,48	1,90%	113	2,80%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVE...	D+5 du	Não há	40.577.365,32	1,53%	38	11,75%	Artigo 9º, Inciso II



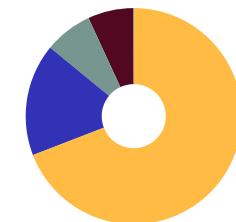
**Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2024)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	7.350.132,55	0,28%	51	7,06%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	44.453.969,29	1,68%	5.135	5,96%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	39.663.630,92	1,49%	445	1,29%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	8.342.204,96	0,31%	316	0,95%	Artigo 9º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCA DO	D+2 du	Não há	55.000.000,00	2,07%	6.130	5,65%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICA NA FI MULTIMERCA DO LP	D+1	Não há	54.812.746,74	2,07%	8.539	2,62%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCA DO	D+1	Não há	70.604.998,72	2,66%	603	5,03%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.108.100,00	0,08%		0,00%	Artigo 11º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>				<b>2.653.878.324,89</b>			
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				<b>46.396,13</b>			Artigo 6º
				<b>PL Total</b>	<b>2.653.924.721,02</b>		



## Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Novembro / 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%	896.793.664,94	33,79%	10,00%	60,00%	100,00%	1.757.084.659,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	186.709.670,49	7,04%	0,00%	3,00%	90,00%	2.201.780.821,91
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	90,00%	2.388.490.492,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	65,00%	751.173.642,76	28,30%	2,00%	3,00%	65,00%	973.847.268,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea b	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	1.725.020.911,18
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.693.916,24
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>1.834.676.978,19</b>	<b>69,13%</b>	<b>12,00%</b>	<b>66,00%</b>	<b>415,00%</b>	



- █ RENDA FIXA 1.834.676.978,19
- █ RENDA VARIÁVEL 445.774.069,72
- █ EXTERIOR 190.901.431,52
- █ ESTRUTURADOS 180.417.745,46
- █ FUNDO IMOBILIÁRIO 2.108.100,00

**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!

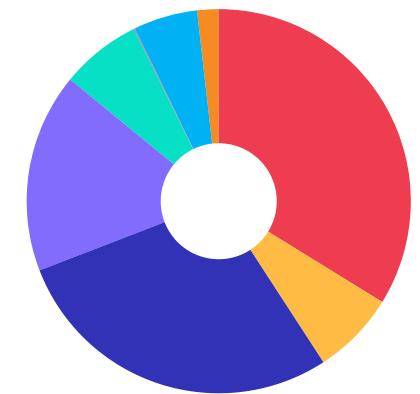




CRÉDITO  
& MERCADO

**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Novembro / 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%	445.774.069,72	16,80%	0,00%	18,20%	35,00%	483.083.343,99
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	928.857.413,71
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	180.417.745,46	6,80%	0,00%	9,50%	10,00%	84.970.087,03
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	132.693.916,24
Artigo 11º	5,00%	2.108.100,00	0,08%	0,00%	0,30%	5,00%	130.585.816,24
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	628.299.915,18	23,67%	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%	142.895.595,64	5,38%	0,00%	4,30%	10,00%	122.492.236,85
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	48.005.835,88	1,81%	0,00%	1,70%	10,00%	217.381.996,61
Total Exterior	10,00%	190.901.431,52	7,19%	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%	265.387.832,49





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	896.793.664,94	33,79	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	186.709.670,49	7,04	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea c	0,00	0,00	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	751.173.642,76	28,30	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	445.774.069,72	16,80	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	142.895.595,64	5,38	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	48.005.835,88	1,81	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	180.417.745,46	6,80	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	2.108.100,00	0,08	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00



Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2024)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	896.793.664,94	33,79	-
CAIXA DTVM	526.905.861,14	19,85	2,68
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	519.757.496,92	19,58	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	427.448.060,91	16,11	0,03
XPASET MANAGEMENT	90.396.519,97	3,41	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S.A.	55.000.000,00	2,07	0,01
ITAÚ DTVM	54.292.540,33	2,05	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	44.453.969,29	1,68	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	27.775.322,69	1,05	1,10
SAFRA ASSET MANAGEMENT	8.342.204,96	0,31	0,00
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE INVESTIMENTOS	2.712.683,74	0,10	-

**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: 29/11/2024

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,22%	6,09%	1,42%	2,97%	7,63%	20,43%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	5,74%	1,36%	2,91%	7,22%	19,78%	1,12%	1,88%

CDI (Benchmark)	0,79%	9,85%	2,58%	5,23%	10,84%	25,58%	-	-
TREND PÓS-FIXADO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,82%	9,92%	2,64%	5,32%	10,91%	25,54%	0,01%	0,06%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,81%	9,96%	2,61%	5,32%	10,99%	26,08%	0,01%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,81%	10,00%	2,60%	5,35%	10,99%	25,67%	0,01%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,72%	8,88%	2,34%	4,73%	9,78%	23,13%	0,01%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	0,80%	10,24%	2,61%	5,37%	11,29%	26,61%	0,01%	0,06%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	8,32%	63,02%	14,60%	30,35%	67,66%	97,27%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	8,26%	61,18%	14,30%	30,24%	65,36%	91,70%	7,66%	15,88%

Ibovespa (Benchmark)	-3,12%	-6,35%	-7,60%	2,92%	-1,31%	11,72%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	-4,78%	-11,29%	-8,74%	-0,13%	-6,53%	3,40%	9,55%	12,62%
SAFRA AÇÕES LIVRE FICAÇÕES	-6,26%	-11,34%	-10,89%	-1,29%	-5,68%	5,53%	11,43%	15,36%
BB IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	-2,16%	-9,43%	-6,61%	2,94%	-3,98%	5,14%	7,93%	12,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FICAÇÕES	-4,88%	-10,36%	-8,97%	0,52%	-5,43%	1,09%	10,55%	13,49%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FICAÇÕES	-1,27%	-0,60%	-3,25%	6,61%	6,02%	23,99%	11,96%	15,62%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FICAÇÕES	-4,87%	-8,45%	-9,36%	0,84%	-2,61%	8,08%	9,36%	13,61%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FICAÇÕES	-5,16%	-12,71%	-10,39%	-2,72%	-8,00%	-1,48%	9,99%	13,30%
ITAÚ DUNAMIS FICAÇÕES	-1,01%	7,46%	-4,27%	10,29%	15,36%	21,92%	8,86%	12,69%
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	-2,46%	-10,83%	-6,48%	2,21%	-6,18%	3,33%	6,10%	11,83%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FIAÇÕES	-3,13%	-6,44%	-7,65%	2,96%	-1,33%	11,81%	8,14%	12,22%

IFIX (Benchmark)	-2,11%	-5,26%	-7,55%	-7,24%	-1,23%	9,42%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-6,31%	-12,27%	-11,80%	-10,36%	-10,15%	1,87%	-	-

MSCI ACWI (Benchmark)	8,57%	48,34%	10,72%	26,80%	52,35%	56,31%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,02%	31,10%	8,12%	16,72%	37,90%	66,09%	5,60%	11,92%



CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/11/2024

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	5,73%	26,47%	6,80%	14,30%	32,06%	47,85%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6,04%	31,71%	8,25%	17,03%	38,60%	67,62%	5,60%	11,93%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	5,94%	29,84%	8,22%	16,11%	36,44%	58,00%	6,03%	12,22%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	6,02%	31,19%	8,15%	16,82%	37,97%	66,17%	5,60%	11,91%



CRÉDITO  
& MERCADO

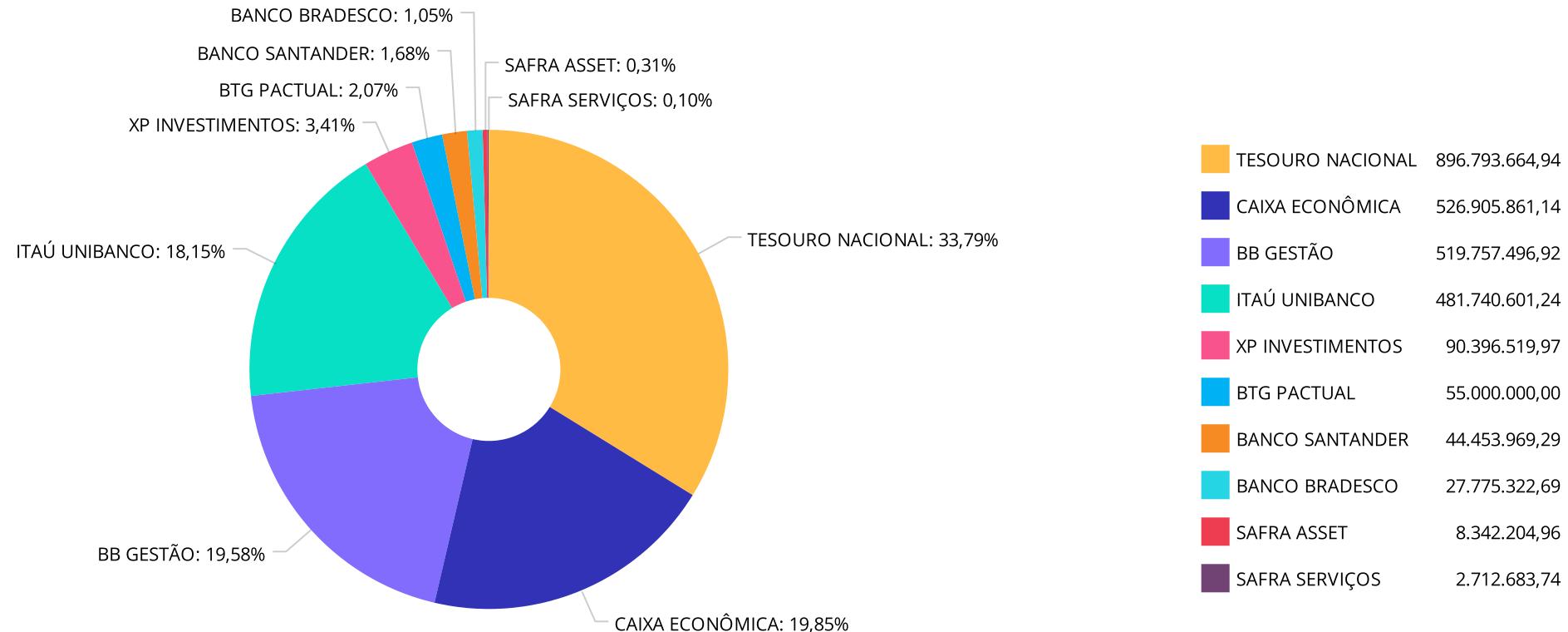
FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/11/2024

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

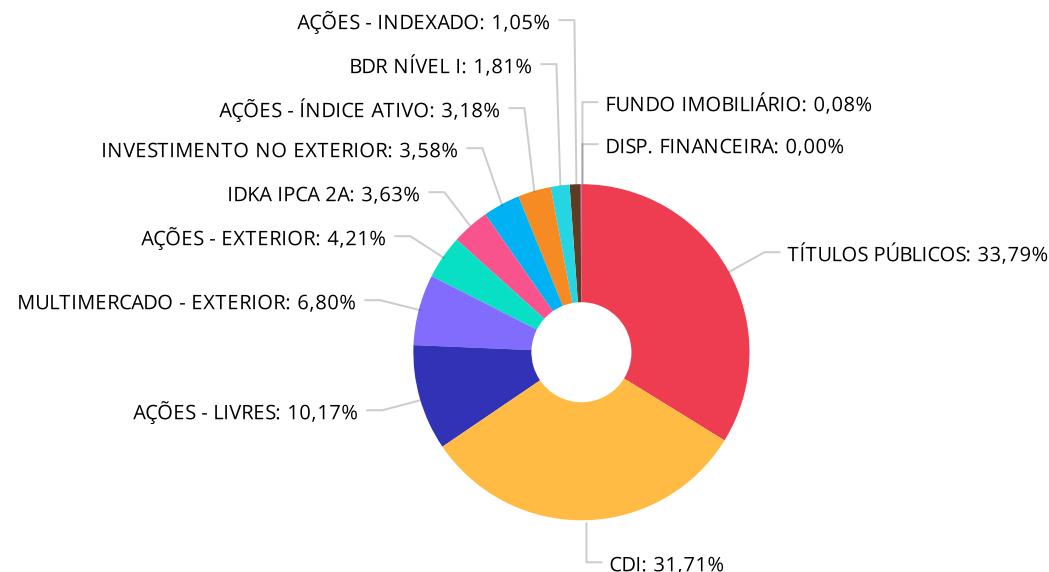
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	8,32%	63,02%	14,60%	30,35%	67,66%	97,27%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	9,33%	49,00%	13,18%	28,50%	52,74%	66,76%	8,66%	14,500%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	8,26%	61,18%	14,30%	30,24%	65,35%	91,70%	7,66%	15,878%
<b>MSCI WORLD (Benchmark)</b>	9,45%	50,33%	11,38%	27,72%	54,56%	60,12%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	6,82%	47,36%	8,86%	23,93%	52,76%	69,50%	9,38%	15,346%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	8,04%	46,99%	10,54%	25,81%	52,91%	57,30%	7,11%	12,504%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FICAÇÕES	1,95%	34,31%	5,62%	19,94%	37,44%	37,60%	10,29%	14,312%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVESTIMENTO NO EXTER...	9,22%	38,61%	7,55%	20,25%	45,70%	39,59%	9,17%	15,700%

## Distribuição dos ativos por Administradores - base (Novembro / 2024)





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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	896.793.664,94	■ CDI	841.570.162,73	■ AÇÕES - LIVRES	270.014.407,96	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	180.417.745,46
■ AÇÕES - EXTERIOR	111.628.476,53	■ IDKA IPCA 2A	96.313.150,52	■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR	94.968.097,77	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	84.283.360,41
■ BDR NÍVEL I	48.005.835,88	■ AÇÕES - INDEXADO	27.775.322,69	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.108.100,00	■ DISP. FINANCEIRA	46.396,13



## Carteira de Títulos Públicos no mês de (Novembro / 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	4.458,52376	39.843.549,55	46.078.843,05	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/07/2022	9.782	4.089,215327	4.448,412521	40.000.704,33	43.514.371,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	11/07/2022	7.384	4.062,955171	4.422,656574	30.000.860,98	32.656.896,14	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	9.987	4.004,964372	4.469,15867	39.997.579,18	44.633.487,63	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/02/2022	10.047	3.981,059981	4.467,845126	39.997.709,63	44.888.439,98	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/03/2022	15.090	3.904,253962	4.454,517667	58.915.192,29	67.218.671,59	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	29/06/2022	296	4.047,135758	4.414,849494	1.197.952,18	1.306.795,45	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/07/2022	498	3.985,691744	4.375,639533	1.984.874,49	2.179.068,48	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/03/2022	10.178	3.916,536627	4.532,544833	39.862.509,79	46.132.241,31	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2022	10.225	3.911,428571	4.510,624785	39.994.357,14	46.121.138,42	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/03/2022	3.890	3.876,160059	4.475,861675	15.078.262,63	17.411.101,91	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/02/2022	15.015	3.926,828179	4.495,748129	58.961.325,11	67.503.658,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/05/2022	2.400	4.016,527746	4.464,951837	9.639.666,59	10.715.884,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/05/2022	4.840	4.131,678715	4.470,062005	19.997.324,98	21.635.100,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	11/05/2022	2.310	4.113,158402	4.444,589714	9.501.395,91	10.267.002,23	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	223	4.039,820802	4.419,326891	900.880,04	985.509,89	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	520	4.013,452065	4.419,326891	2.086.995,07	2.298.049,98	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	03/03/2023	10.479	3.816,987204	4.194,252556	39.998.208,91	43.951.572,53	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/05/2022	4.940	3.993,115642	4.504,820751	19.725.991,27	22.253.814,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	15/06/2022	9.790	4.007,081511	4.487,897409	39.229.327,99	43.936.515,63	Curva



CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/11/2024

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

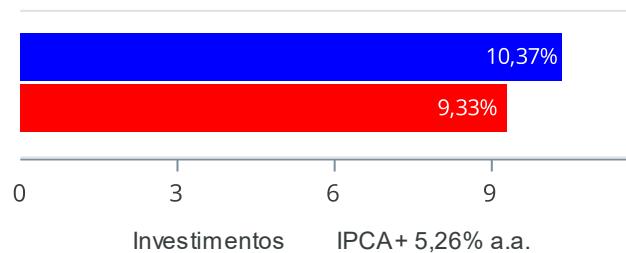
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	03/03/2023	10.479	3.816,987204	4.194,252556	39.998.208,91	43.951.572,53	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/07/2022	5.050	3.929,948645	4.321,570373	19.846.240,66	21.823.930,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/03/2023	10.386	3.851,268116	4.101,837495	39.999.270,65	42.601.684,22	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	07/07/2022	5.024	3.888,609735	4.339,471236	19.536.375,31	21.801.503,48	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	23/11/2022	10.213	3.916,628783	4.321,531098	40.000.529,76	44.135.797,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	06/02/2023	10.327	3.760,654822	4.165,564044	38.836.282,35	43.017.779,88	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	03/03/2023	10.549	3.792,196447	4.165,564044	40.003.880,32	43.942.535,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	29/06/2022	4.935	3.965,241251	4.431,092061	19.568.465,57	21.867.439,32	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%
Setembro	2.698.566.075,99	112.071.700,00	126.418.656,05	2.694.382.808,93	10.163.688,99	221.571.162,86	0,36%	8,32%	0,87%	7,38%	112,81%	3,15%
Outubro	2.694.382.808,93	491.889.679,78	506.349.292,88	2.697.757.838,87	17.834.643,04	239.405.805,90	0,56%	8,93%	1,03%	8,48%	105,23%	2,79%
Novembro	2.697.757.838,87	164.058.919,80	254.722.322,77	2.645.031.424,04	37.936.988,14	277.342.794,04	1,33%	10,37%	0,78%	9,33%	111,18%	3,75%

## Investimentos x Meta de Rentabilidade





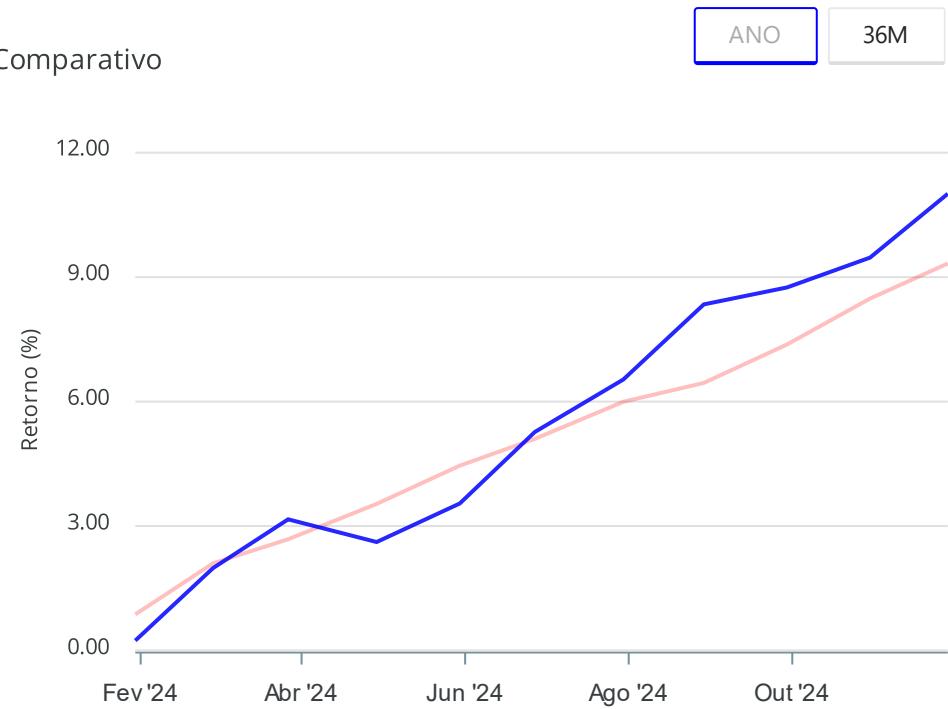
CRÉDITO  
& MERCADO

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

Meta de Rentabilidade



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

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TÍTULOS PÚBLICOS	897.702.588,68	0,00	8.589.887,88	896.793.664,94	7.680.964,14	0,86%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	283.085.492,11	314.086,77	29.743.000,00	255.942.726,11	2.286.147,23	0,81%	0,81%	0,01%
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	203.202.502,31	0,00	0,00	204.824.169,37	1.621.667,06	0,80%	0,80%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDENC...	293.118.234,54	29.718.000,00	35.842.617,79	289.377.838,69	2.384.221,94	0,74%	0,81%	0,01%
TREND PÓS-FIXADO FIC RENDA FIXA SIMPLES	30.012.573,15	60.109.700,97	0,00	90.396.519,97	274.245,85	0,30%	0,82%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	96.099.762,25	17.700,00	0,00	96.313.150,52	195.688,27	0,20%	0,20%	1,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	939.000,00	1.028.908,56	939.366,41	1.028.908,59	366,44	0,02%	0,72%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.804.160.153,04</b>	<b>91.188.396,30</b>	<b>75.114.872,08</b>	<b>1.834.676.978,19</b>	<b>14.443.300,93</b>	<b>0,79%</b>		<b>0,13%</b>



CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/11/2024

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

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FIAÇÕES	60.127.270,69	0,00	0,00	63.700.978,66	3.573.707,97	5,94%	5,94%	6,03%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	134.078.834,74	0,00	86.824.176,71	54.812.746,74	7.558.088,71	5,64%	6,02%	5,60%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	137.174.793,83	18.688.523,50	93.384.158,92	70.604.998,72	8.125.840,31	5,21%	6,02%	5,60%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	55.000.000,00	0,00	55.000.000,00	0,00	0,00%	6,04%	5,60%
ITAÚ DUNAMIS FICAÇÕES	146.149.762,72	0,00	0,00	144.668.760,27	-1.481.002,45	-1,01%	-1,01%	8,86%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FICAÇÕES	45.498.921,13	0,00	0,00	44.919.616,84	-579.304,29	-1,27%	-1,27%	11,96%
BB IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	39.155.581,47	0,00	0,00	38.309.282,87	-846.298,60	-2,16%	-2,16%	7,93%
BB SELEÇÃO FATORIAL FICAÇÕES	37.162.066,66	0,00	0,00	36.248.994,31	-913.072,35	-2,46%	-2,46%	6,10%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FICAÇÕES	28.672.697,81	0,00	0,00	27.775.322,69	-897.375,12	-3,13%	-3,13%	8,14%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FICAÇÕES	48.283.965,89	0,00	0,00	45.974.077,54	-2.309.888,35	-4,78%	-4,78%	9,55%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FICAÇÕES	1.812.140,27	0,00	0,00	1.723.949,18	-88.191,09	-4,87%	-4,87%	9,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FICAÇÕES	8.745.108,86	0,00	0,00	8.318.462,79	-426.646,07	-4,88%	-4,88%	10,55%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FICAÇÕES	34.947.814,40	0,00	0,00	33.145.890,01	-1.801.924,39	-5,16%	-5,16%	9,99%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.250.000,00	0,00	17.700,00	2.108.100,00	-124.200,00	-5,52%	-	-
SAFRA AÇÕES LIVRE FICAÇÕES	1.054.777,81	0,00	0,00	988.734,56	-66.043,25	-6,26%	-6,26%	11,43%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>725.113.736,28</b>	<b>73.688.523,50</b>	<b>180.226.035,63</b>	<b>628.299.915,18</b>	<b>9.723.691,03</b>	<b>1,22%</b>		<b>7,75%</b>



CRÉDITO  
& MERCADO

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/11/2024

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

**FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	7.629.965,83	0,00	0,00	8.342.204,96	712.239,13	9,33%	9,33%	8,66%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT IS INVEST...	37.150.982,34	0,00	0,00	40.577.365,32	3.426.382,98	9,22%	9,22%	9,17%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	36.636.153,57	0,00	0,00	39.663.630,92	3.027.477,35	8,26%	8,26%	7,66%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	41.145.227,62	0,00	0,00	44.453.969,29	3.308.741,67	8,04%	8,04%	7,11%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	47.288.342,94	0,00	0,00	50.514.128,48	3.225.785,54	6,82%	6,82%	9,38%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	7.209.259,87	0,00	0,00	7.350.132,55	140.872,68	1,95%	1,95%	10,29%
<b>Total Exterior</b>	<b>177.059.932,17</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>190.901.431,52</b>	<b>13.841.499,35</b>	<b>7,82%</b>		<b>8,45%</b>

## 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.



