

RELATORIO DE INVESTIMENTOS

FEVEREIRO 2023

Handwritten signatures in blue ink, including a vertical line and several scribbled marks.

SUMÁRIO

1. Apresentação	3
2. Parecer do Comitê de Investimentos	3
3. Aprovação do Conselho de Administração	3



1. APRESENTAÇÃO

Este documento apresenta a posição da carteira de investimentos do São Roque Prev por segmentos e ativos, por tipo de risco, por instituição financeira e por limites da Política de Investimentos, e o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos.

Tem por objetivo demonstrar os resultados das ações do deliberadas pelo Comitê de Investimentos.

Após cada reunião é elaborado uma ata que fica a disposição dos Conselhos de Administração e Fiscal para acompanhamento e homologação.

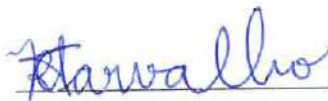
2. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos do São Roque Prev analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês fev/2023 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do São Roque Prev e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

3. APROVAÇÃO DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO

O Conselho de Administração, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, HOMOLOGA o relatório de investimentos referente ao mês de março de 2023, em reunião realizada em 24 de março de 2023.

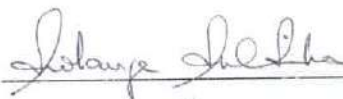
Rosana Teixeira de Carvalho



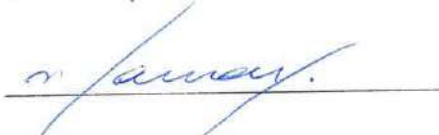
Lisete de Fátima Oliveira



Solange Siqueira Duarte Silva



Mauracy Moraes de Oliveira





CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2023

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

/

[Handwritten signature]



CRÉDITO & MERCADO

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			130.193.969,79	30,69%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.252.724,82	0,77%	765	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.708.764,50	0,64%	527	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	539.368,33	0,13%	1.123	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	20.212.921,47	4,76%	359	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.355.230,75	1,26%	794	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDIKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIC RE...	D+0	Não há	3.133.779,12	0,74%	936	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA F...	D+0	Não há	11.373.957,97	2,68%	926	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	D+0	Não há	1.457.450,78	0,34%	705	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	18.846.238,80	4,44%	922	0,48%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.150.884,36	0,74%	81	0,97%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.133.276,12	2,39%	327	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.730.673,60	2,53%	124	1,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL MATRIZ FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	33.733.876,24	7,95%	384	0,60%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.291.883,09	0,30%	231	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	37.757.796,84	8,90%	215	1,73%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.315.790,41	2,67%	334	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info		84.473.360,30	19,91%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	D+4	Não há	20.624.095,98	4,86%	627	5,71%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.102.916,83	1,44%	42	1,13%	Artigo 8º, Inciso I

2



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.609.134,27	0,61%	13.204	0,40%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.550.926,20	0,60%	502	0,13%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.900.872,09	0,45%	2.467	1,62%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	554.552,69	0,13%	3.277	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	281.160,43	0,07%	6.693	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		13.289.225,77	3,13%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			424.285.605,98				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			13.289.225,77				Artigo 6º
PL Total			437.574.831,75				



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	130.193.969,79	30,69%	20,00%	37,00%	60,00%	124.377.393,80
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	48.034.197,74	11,32%	5,00%	10,00%	60,00%	206.537.165,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	42.428.560,60
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	126.960.419,46	29,92%	0,00%	18,00%	60,00%	127.610.944,13
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	8.485.712,12
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	84.473.360,30	19,91%	20,00%	20,00%	20,00%	383.760,90
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	21.214.280,30
Total Renda Fixa	100,00%	389.661.947,29	91,84%	45,00%	86,00%	217,00%	



RENDA FIXA 389.661.947,29
 RENDA VARIÁVEL 26.727.012,81
 EXTERIOR 7.060.932,56
 ESTRUTURADOS 835.713,32

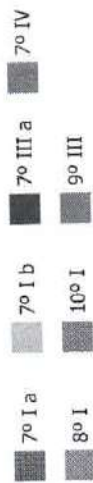
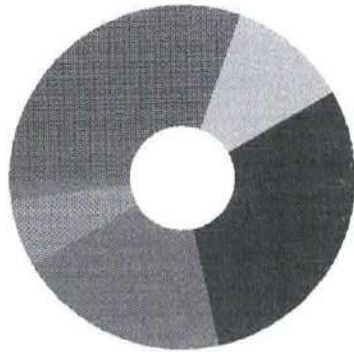
[Handwritten signature]



CRÉDITO & MERCADO

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	26.727.012,81	6,30%	0,00%	8,00%	30,00%	100.558.668,98
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	42.428.560,60
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	835.713,32	0,20%	0,00%	2,00%	10,00%	41.592.847,28
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	21.214.280,30
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	21.214.280,30
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	27.562.726,13	6,50%	0,00%	11,50%	60,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	42.428.560,60
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	7.060.932,56	1,66%	0,00%	2,00%	10,00%	35.367.628,04
Total Exterior	10,00%	7.060.932,56	1,66%	0,00%	2,50%	20,00%	

Handwritten signature and initials in blue ink.



Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PUBL...	130.193.969,79	30,69	-
CAIXA DTVM	70.463.491,07	16,61	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	68.793.248,17	16,21	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	37.757.795,84	8,90	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.284.160,48	3,13	0,00
ITAÚ UNIBANCO	13.216.662,50	3,12	0,00
ITAÚ DTVM	6.102.916,83	1,44	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 496/2)

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'	130.193.969,79	30,69	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	48.034.197,74	11,32	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	126.960.419,46	29,92	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	26.727.012,81	6,30	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	7.060.932,56	1,66	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	835.713,32	0,20	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

[Handwritten signature]



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,62%	3,08%	4,36%	6,05%	11,25%	18,71%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	2,93%	4,20%	5,90%	10,95%	17,94%	1,47%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,98%	2,09%	3,30%	6,49%	12,81%	17,61%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	2,03%	3,21%	6,32%	12,47%	16,97%	0,32%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,41%	2,82%	3,79%	5,87%	11,57%	18,62%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,40%	2,79%	3,73%	5,73%	11,31%	17,99%	1,19%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,39%	2,79%	3,73%	5,76%	11,45%	18,22%	1,18%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	1,26%	1,26%	1,08%	3,02%	7,94%	8,94%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	1,26%	1,04%	2,90%	7,88%	8,38%	2,45%	0,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,24%	1,25%	0,98%	2,77%	7,50%	7,71%	2,38%	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,26%	1,22%	0,98%	2,84%	7,75%	8,45%	2,48%	0,04%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,22%	1,13%	0,87%	2,61%	7,53%	8,23%	2,55%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	2,43%	3,41%	6,59%	12,46%	19,86%	0,42%	0,03%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,88%	2,02%	3,21%	6,60%	13,45%	20,58%	0,03%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,79%	1,90%	3,05%	6,34%	12,95%	19,81%	0,04%	0,00%

3



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,82%	1,96%	3,11%	6,53%	13,29%	20,83%	0,11%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,85%	1,89%	2,95%	5,94%	11,87%	16,92%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)								
	0,84%	1,37%	2,00%	2,73%	5,60%	16,73%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,97%	2,01%	3,17%	5,58%	11,28%	13,35%	0,28%	0,01%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,99%	1,99%	3,21%	5,33%	11,04%	14,28%	0,44%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,14%	1,65%	1,27%	2,66%	8,04%	14,35%	1,88%	0,02%

2



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-0,65%	3,28%	-4,48%	0,44%	-9,43%	-5,71%	-	-
Global BDRX (Benchmark)	1,15%	5,57%	1,12%	0,53%	-9,60%	-7,95%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	-7,49%	-4,38%	-6,72%	-4,19%	-7,26%	-4,64%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	-6,41%	-3,30%	-5,92%	-6,67%	-6,62%	-6,97%	8,21%	0,21%
ITAU FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	-6,91%	-3,78%	-5,83%	-4,46%	-6,37%	-10,56%	7,61%	0,21%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FIMULTIMERCADO LP	0,82%	1,93%	3,12%	6,15%	13,21%	20,11%	0,08%	0,01%
CAIXA RV 30 FIMULTIMERCADO LP	-1,89%	-0,21%	-0,07%	2,83%	7,85%	12,80%	2,75%	0,07%

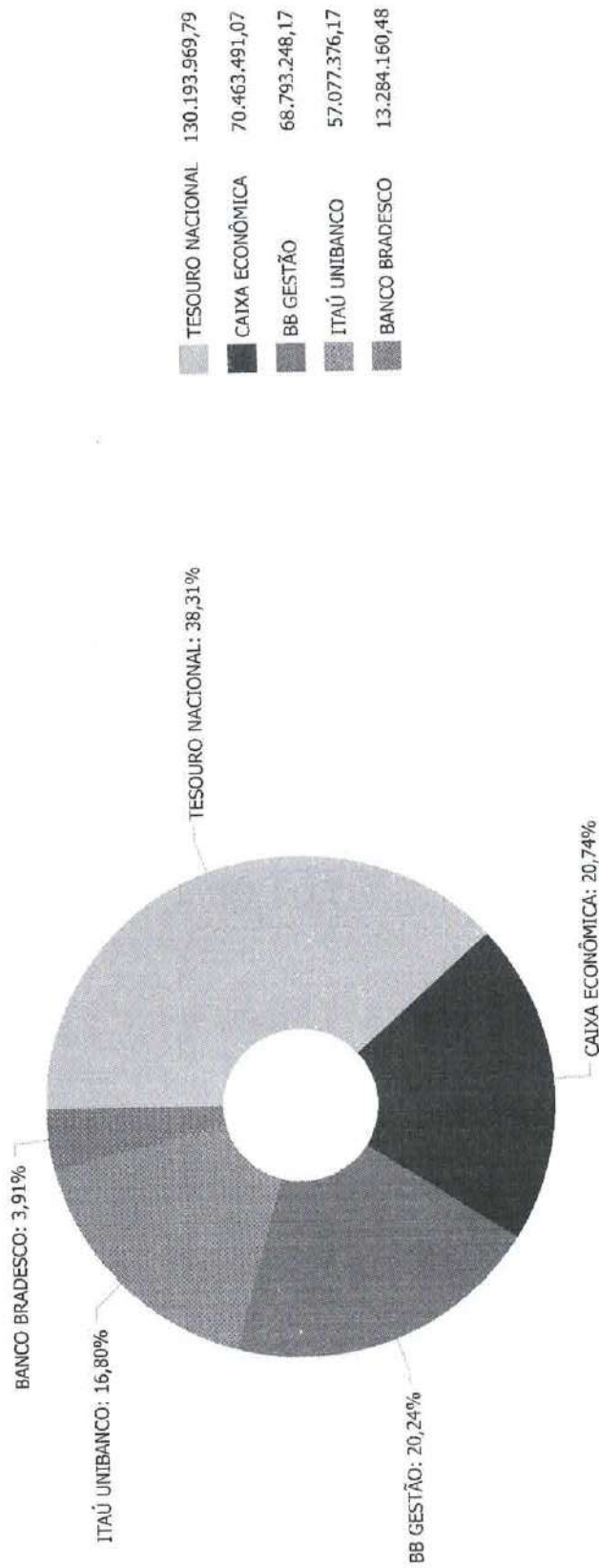
3
[Handwritten signature]



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-0,65%	3,28%	-4,48%	0,44%	-9,43%	-5,71%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-	2,19%	-3,10%	-	-	-	7,60%	17,15%
Global BDRX (Benchmark)	1,15%	5,57%	1,12%	0,53%	-9,60%	-7,95%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-	5,10%	0,14%	-	-	-	9,98%	18,28%
ITAÚ FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-	-0,83%	-5,76%	-	-	-	7,65%	15,02%

2. /

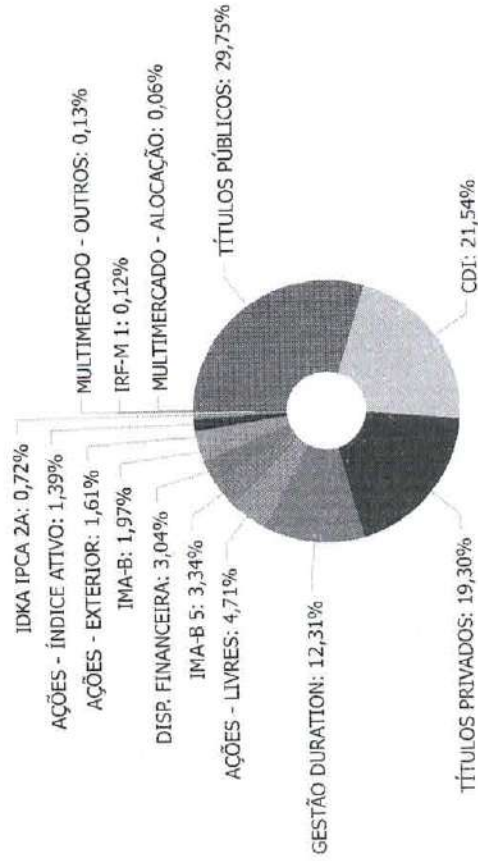


[Handwritten signature]



CRÉDITO & MERCADO

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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	130.193.969,79	■ CDI	84.473.360,30	■ GESTÃO DURATION	53.843.701,19
■ AÇÕES - LIVRES	20.624.095,98	■ IM-A-B 5	13.289.225,77	■ IM-A-B	8.608.982,73
■ AÇÕES - EXTERIOR	7.060.932,56	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.133.779,12	■ MULTIMERCADO - OUTROS	554.552,89
■ IRF-M 1	539.368,33	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	281.160,43		

23



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Fevereiro / 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	30/06/2022	19.713	4058,06717400	4.041,338340	79.896.678,20	79.666.902,70	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	04/11/2022	12.236	4.086,264032100	4.129,377827	49.898.526,70	50.527.067,09	Curva

[Handwritten signature]

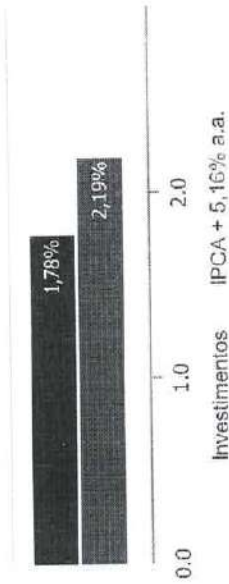


**CRÉDITO
& MERCADO**

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	417.592.348,34	766.976,95	2.178.354,66	421.582.644,05	5.401.673,42	5.401.673,42	1,29%	1,29%	0,97%	0,97%	133,01%	2,36%
Fevereiro	421.562.644,05	6.973.832,76	6.360.870,26	424.285.605,98	2.029.989,43	7.431.672,85	0,48%	1,78%	1,20%	2,19%	81,40%	1,97%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



21
[Handwritten signature]

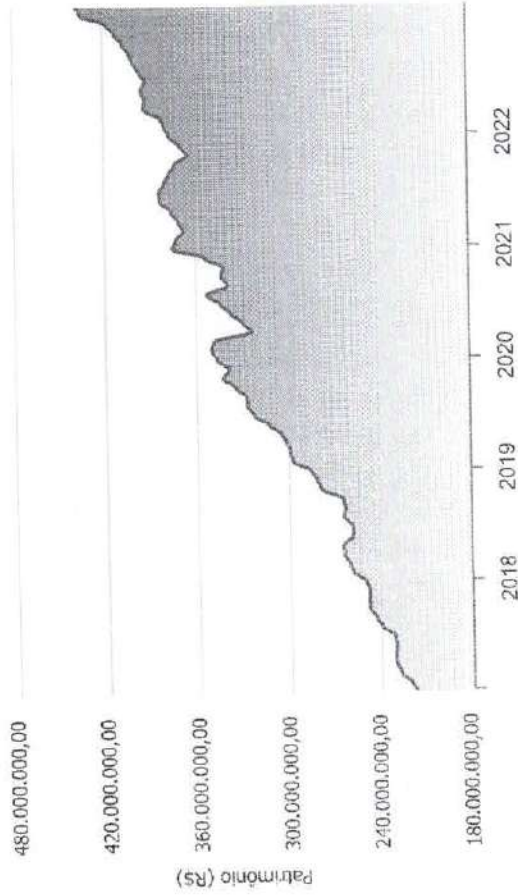


CRÉDITO & MERCADO

Gráficos Ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO

Evolução do Patrimônio



- 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



Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.067.350,07	0,00	0,00	3.133.779,12	46.429,05	1,50%	1,50%	1,47%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.207.850,77	0,00	0,00	3.252.724,82	44.874,05	1,40%	1,40%	1,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.217.952,39	0,00	0,00	11.373.957,97	156.005,58	1,39%	1,39%	1,18%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.674.864,85	0,00	0,00	2.708.764,50	33.899,65	1,27%	1,27%	2,45%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.439.353,32	0,00	0,00	1.457.450,78	18.097,46	1,26%	1,26%	2,48%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.112.326,81	0,00	0,00	3.150.884,36	38.557,55	1,24%	1,24%	2,38%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.276.270,13	0,00	0,00	1.291.893,09	15.612,96	1,22%	1,22%	2,55%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	37.331.568,49	0,00	0,00	37.757.795,84	426.228,35	1,14%	1,14%	1,98%
LETRA FINANCEIRA BTG	83.573.065,62	0,00	0,00	84.473.360,30	900.294,68	1,08%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	10.625.113,85	0,00	0,00	10.730.673,60	105.559,75	0,99%	0,99%	0,44%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.304.046,70	0,00	0,00	5.355.230,75	51.184,05	0,96%	0,97%	0,28%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	534.232,61	0,00	0,00	539.368,33	5.135,72	0,96%	0,96%	0,32%
TÍTULOS PÚBLICOS	132.730.126,63	0,00	3.807.236,25	130.193.969,79	1.271.079,41	0,96%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	20.029.676,35	0,00	0,00	20.212.921,47	183.245,12	0,91%	0,91%	0,42%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.045.007,94	0,00	0,00	10.133.276,12	88.268,18	0,88%	0,88%	0,03%
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.223.521,71	0,00	0,00	11.315.790,41	92.268,70	0,82%	0,82%	0,11%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	33.468.535,47	0,00	0,00	33.733.876,24	265.340,77	0,79%	0,79%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	14.221.368,77	6.973.832,76	2.453.634,01	18.846.238,80	144.671,28	0,68%	0,85%	0,00%
Total Renda Fixa	385.102.232,48	6.973.832,76	6.300.870,26	389.661.947,29	3.886.752,31	1,01%		0,78%

2



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/02/2023

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável/Estruturados/Imobiliário	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instít	Var - Mês
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	550.018,90	0,00	0,00	554.552,89	4.533,99	0,82%	0,82%	0,08%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	286.593,25	0,00	0,00	281.160,43	-5.422,82	-1,89%	-1,89%	2,75%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	22.037.144,97	0,00	0,00	20.624.095,98	-1.413.048,99	-6,41%	-6,41%	8,21%
ITAU FOF RPI IBOVESPAATIVO FIAÇÕES	6.555.675,97	0,00	0,00	6.102.916,83	-452.759,14	-6,91%	-6,91%	7,61%
Total Renda Variável	29.429.423,09	0,00	0,00	27.562.726,13	-1.866.696,96	-6,34%		7,86%

3



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instt	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.531.943,67	0,00	0,00	2.550.926,20	18.982,53	0,75%	0,75%	9,98%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.601.168,79	0,00	0,00	2.609.134,27	7.965,48	0,31%	0,31%	7,60%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.917.876,02	0,00	0,00	1.900.872,09	-17.003,93	-0,89%	-0,89%	7,85%
Total Exterior	7.050.988,48	0,00	0,00	7.060.932,56	9.944,08	0,14%		8,53%

23



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 empresa. As informações aqui contidas são somente com 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 os produtos mencionados; entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

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

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.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º 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 nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, 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.