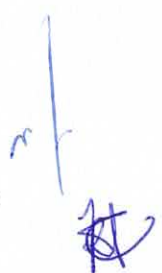




## SUMÁRIO

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 dez/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.

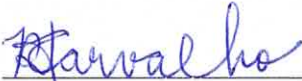
---

## 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 dezembro de 2023, em reunião realizada em 23 de janeiro de 2024.

Rosana Teixeira de Carvalho

  
\_\_\_\_\_

Solange Siqueira Duarte Silva

\_\_\_\_\_

Mauracy Moraes de Oliveira

  
\_\_\_\_\_



CRÉDITO  
& MERCADO

# Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2023

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



**Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			219.234.535,00	46,46%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	15.924.359,84	3,37%	789	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.241.719,98	1,32%	649	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P...	D+0	49444	21.785.724,67	4,62%	44	3,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	530.548,93	0,11%	788	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.065.285,66	0,65%	216	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.361.762,57	2,20%	106	2,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.204.985,86	1,10%	40	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	9.927.872,94	2,10%	1.133	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.604.416,69	0,76%	99	0,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.286.439,99	2,39%	442	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	952.046,22	0,20%	117	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.544.384,89	1,60%	395	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	D+4 du	Não há	5.568.467,91	1,18%	117	1,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	94.119.807,82	19,95%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.576.807,34	1,18%	58	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.977.117,83	0,63%	10.022	0,46%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.032.041,47	0,64%	468	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	2.084.885,91	0,44%	1.743	2,18%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	612.121,48	0,13%	2.628	0,05%	Artigo 10º, Inciso I



**CRÉDITO  
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV

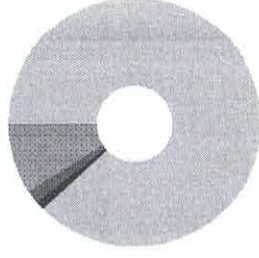
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/12/2023

**Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2023)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	322.577,90	0,07%	5.128	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	4.319.637,53	0,92%	643	1,26%	Artigo 10º, Inciso I
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	37.595.611,41	7,97%	14.386	10,42%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>471.873.159,84</b>				

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

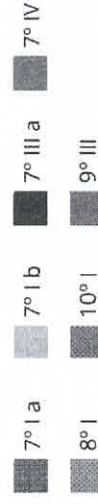
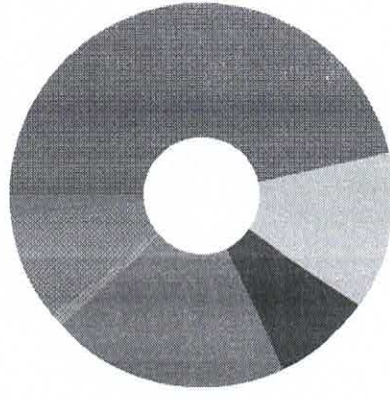
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	219.234.535,00	46,46%	20,00%	37,00%	60,00%	63.889.360,90
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	63.114.387,51	13,38%	5,00%	10,00%	60,00%	220.009.508,39
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	47.187.315,98
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	38.883.628,64	8,24%	0,00%	18,00%	60,00%	244.240.267,26
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	9.437.463,20
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	94.119.807,82	19,95%	20,00%	20,00%	20,00%	254.824,15
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	23.593.657,99
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>415.352.358,97</b>	<b>88,02%</b>	<b>45,00%</b>	<b>86,00%</b>	<b>217,00%</b>	



RENDA FIXA 415.352.358,97  
 RENDA VARIÁVEL 5.576.807,34  
 EXTERIOR 8.094.045,21  
 ESTRUTURADOS 42.849.948,32

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5.576.807,34	1,18%	0,00%	8,00%	30,00%	135.985.140,61
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	47.187.315,98
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	42.849.948,32	9,08%	0,00%	2,00%	10,00%	4.337.367,66
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	23.593.657,99
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	23.593.657,99
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	48.426.755,66	10,26%	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%	47.187.315,98
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	8.094.045,21	1,72%	0,00%	2,00%	10,00%	39.093.270,77
Total Exterior	10,00%	8.094.045,21	1,72%	0,00%	2,50%	20,00%	





Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI...	219.234.535,00	46,46	-
BANCO BTG PACTUAL	94.119.807,82	19,95	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	56.856.795,26	12,05	-
NOVUS CAPITAL	43.164.079,32	9,15	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	15.566.748,43	3,30	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	14.890.856,68	3,16	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	12.694.556,46	2,69	-
TARPON INVESTIMENTOS	5.576.807,34	1,18	-
CAIXA DTVM	5.449.336,00	1,15	-
ICATU VANGUARDA	4.319.637,53	0,92	-

**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'	219.234.535,00	46,46	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	63.114.387,51	13,38	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	38.883.628,64	8,24	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	2,00

2. /

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>								
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%	-	-
	1,45%	11,93%	2,92%	4,62%	11,93%	22,58%	0,49%	0,02%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>								
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,75%	16,05%	4,76%	4,21%	16,05%	23,45%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,73%	15,77%	4,69%	4,09%	15,77%	22,85%	1,45%	0,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,72%	15,83%	4,68%	3,91%	15,83%	22,72%	1,44%	0,05%
	2,74%	15,77%	4,71%	4,04%	15,77%	22,83%	1,46%	0,04%

<b>IRF-M (Benchmark)</b>								
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,48%	16,51%	4,38%	6,28%	16,51%	26,79%	-	-
	1,46%	16,24%	4,35%	6,18%	16,24%	26,09%	0,67%	0,03%

<b>CDI (Benchmark)</b>								
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,95%	13,57%	3,03%	6,68%	13,57%	28,48%	0,02%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,22%	15,53%	3,40%	7,24%	15,53%	35,00%	0,65%	0,02%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90%	12,98%	2,83%	6,15%	12,98%	27,20%	0,01%	0,00%
	0,94%	13,63%	3,01%	6,66%	13,63%	28,40%	0,01%	0,00%

<b>IPCA (Benchmark)</b>								
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,56%	4,62%	1,08%	1,70%	4,62%	10,67%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,98%	12,80%	2,54%	4,68%	12,80%	24,96%	0,07%	0,01%
	1,21%	13,59%	2,92%	4,92%	13,59%	25,74%	0,28%	0,01%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,61%	15,84%	4,04%	5,04%	15,84%	24,91%	0,78%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,20%	-	5,15%	3,15%	-	-	2,27%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,90%	13,05%	2,84%	6,15%	13,05%	27,03%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1,09%	12,66%	3,22%	5,80%	12,66%	29,22%	0,59%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,04%	14,50%	5,96%	8,00%	14,50%	28,27%	1,91%	0,05%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,90%	12,51%	2,73%	5,58%	12,51%	27,64%	0,05%	0,00%

Global BDRX (Benchmark)	2,84%	26,33%	7,77%	9,72%	26,33%	-9,11%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2,59%	24,92%	7,65%	9,07%	24,92%	-10,73%	4,08%	0,15%

Ibovespa (Benchmark)	5,38%	22,28%	15,12%	13,63%	22,28%	28,01%	-	-
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	9,85%	55,36%	11,54%	24,45%	55,36%	78,35%	5,20%	0,19%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,46%	12,13%	2,97%	4,75%	12,13%	23,09%	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	3,86%	21,42%	7,05%	8,00%	21,42%	42,06%	1,81%	0,06%

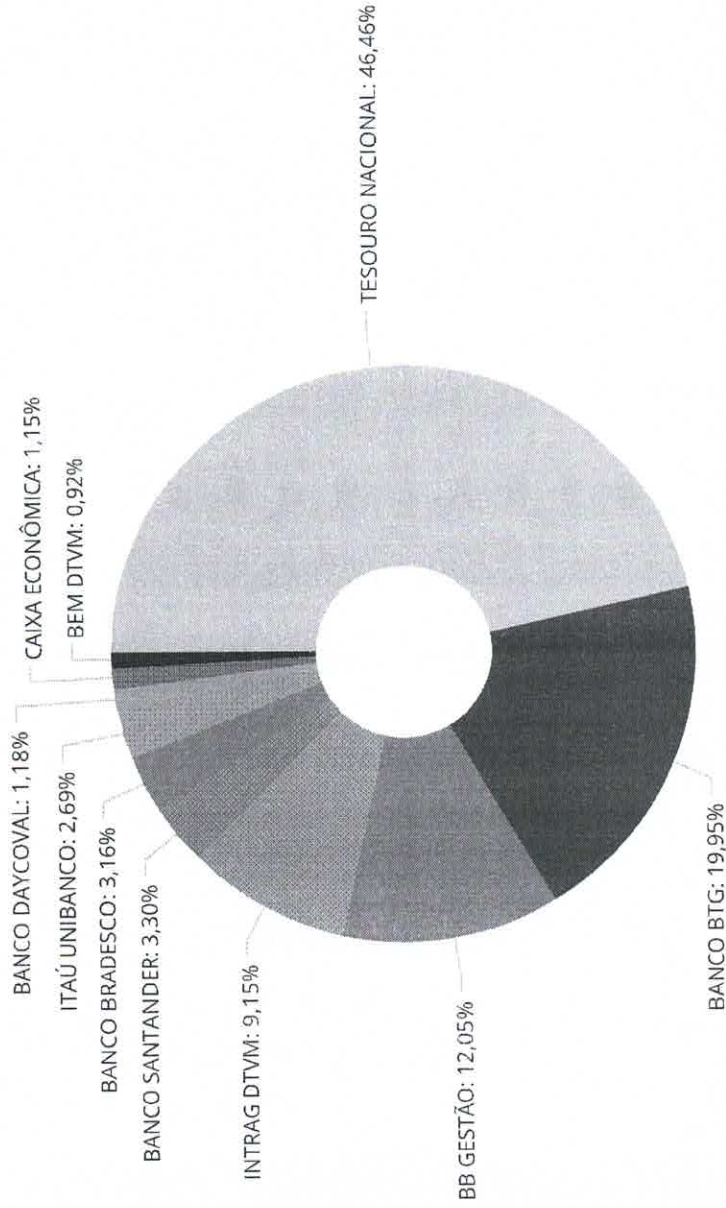
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	2,57%	14,84%	7,88%	8,03%	14,84%	-15,60%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,95%	16,61%	7,35%	8,82%	16,61%	-13,59%	4,59%	0,14%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	2,57%	14,84%	7,88%	8,03%	14,84%	-15,60%	-	-
<b>BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	2,95%	16,61%	7,34%	8,82%	16,61%	-13,59%	4,59%	14,099%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	2,84%	26,33%	7,77%	9,72%	26,33%	-9,11%	-	-
<b>ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	1,98%	8,77%	5,89%	9,52%	8,77%	-8,60%	4,16%	13,414%
<b>CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I</b>	2,59%	24,92%	7,65%	9,07%	24,92%	-10,73%	4,08%	15,398%

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



Administrador	Valor
TESOURO NACIONAL	219.234.535,00
BANCO BTG	94.119.807,82
BB GESTÃO	56.856.795,26
INTRAG DTVM	43.164.079,32
BANCO SANTANDER	15.566.748,43
BANCO BRADESCO	14.890.856,68
ITAÚ UNIBANCO	12.694.556,46
BANCO DAYCOVAL	5.576.807,34
CAIXA ECONÔMICA	5.449.336,00
BEM DTVM	4.319.637,53







**CRÉDITO  
& MERCADO**

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

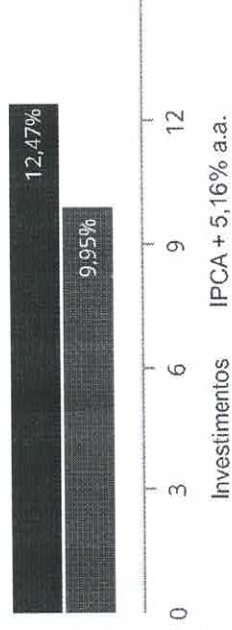
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

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	4.267,928098	79.996.678,20	84.133.666,59	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	04/11/2022	12.236	4.086,264032100	4.352,31012	49.999.526,70	53.254.866,62	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	03/03/2023	10.032	3.987,19898800	4.086,423121	39.999.580,25	40.994.996,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	20/11/2023	1.000	4.352,820989	4.411,536431	4.352.820,99	4.411.536,43	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	23/11/2023	8.300	4.339,115559	4.393,083613	36.014,659,14	36.462.593,98	Curva



**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	415.684.852,33	516.807,90	2.125.592,86	419.457.860,72	5.381.793,35	5.381.793,35	1,29%	1,29%	0,97%	0,97%	133,12%	2,36%
Fevereiro	419.457.860,72	6.973.832,76	6.244.425,99	422.199.303,38	2.012.035,89	7.393.829,24	0,48%	1,78%	1,20%	2,19%	81,37%	1,97%
Março	422.199.303,38	100.645.059,58	100.069.417,00	427.389.027,57	4.614.081,61	12.007.910,85	1,09%	2,89%	1,17%	3,39%	85,35%	0,59%
Abril	427.389.027,57	3.349.467,29	3.231.633,53	431.714.954,77	4.208.093,44	16.216.004,29	0,98%	3,90%	0,97%	4,39%	88,88%	0,54%
Mai	431.714.954,77	59.727.603,33	59.271.376,08	437.708.850,22	5.537.688,20	21.753.672,49	1,28%	5,23%	0,67%	5,09%	102,80%	0,66%
Junho	437.708.850,22	19.523.274,38	19.384.502,40	440.836.136,79	2.988.514,59	24.742.187,08	0,68%	5,95%	0,34%	5,45%	109,24%	1,01%
Julho	440.836.136,79	3.300.096,54	3.000.190,39	444.316.690,85	3.180.647,91	27.922.834,99	0,72%	6,72%	0,54%	6,02%	111,58%	0,77%
Agosto	444.316.690,85	7.238.871,49	6.290.612,99	448.897.034,11	3.632.084,76	31.554.919,75	0,82%	7,59%	0,69%	6,75%	112,36%	0,91%
Setembro	448.897.034,11	27.458.756,39	27.329.084,48	451.102.287,14	2.075.581,12	33.630.500,87	0,46%	8,08%	0,66%	7,46%	108,40%	1,40%
Outubro	451.102.287,14	128.548.131,74	129.683.180,43	457.267.210,52	7.299.972,07	40.930.472,94	1,62%	9,83%	0,66%	8,17%	120,38%	1,73%
Novembro	457.267.210,52	143.787.957,96	145.207.676,09	460.902.996,64	5.055.504,25	45.985.977,19	1,11%	11,05%	0,68%	8,91%	124,06%	1,46%
Dezembro	460.902.996,64	6.006.514,15	5.454.815,05	467.376.655,34	5.921.959,60	51.907.936,79	1,28%	12,47%	0,96%	9,95%	125,31%	1,21%

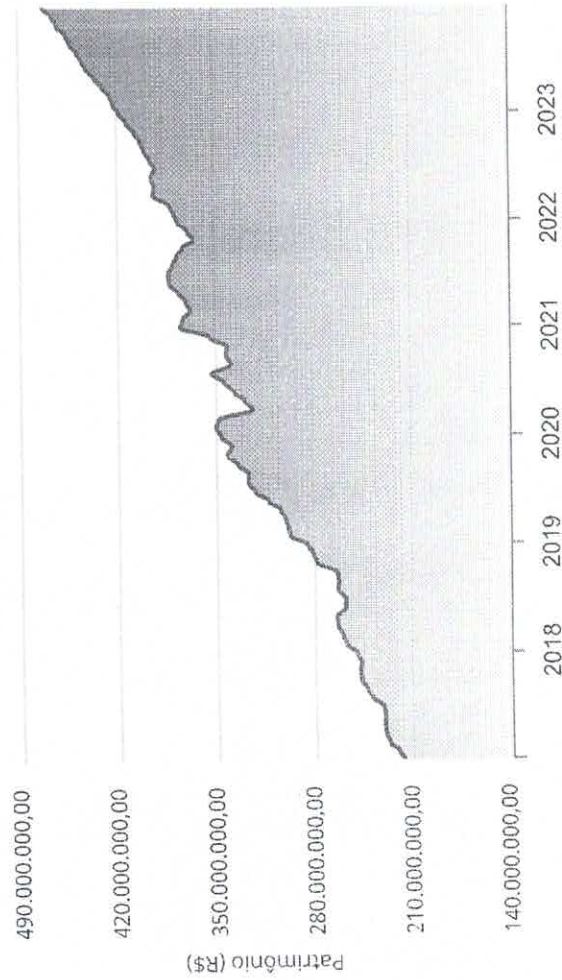
**Investimentos x Meta de Rentabilidade**



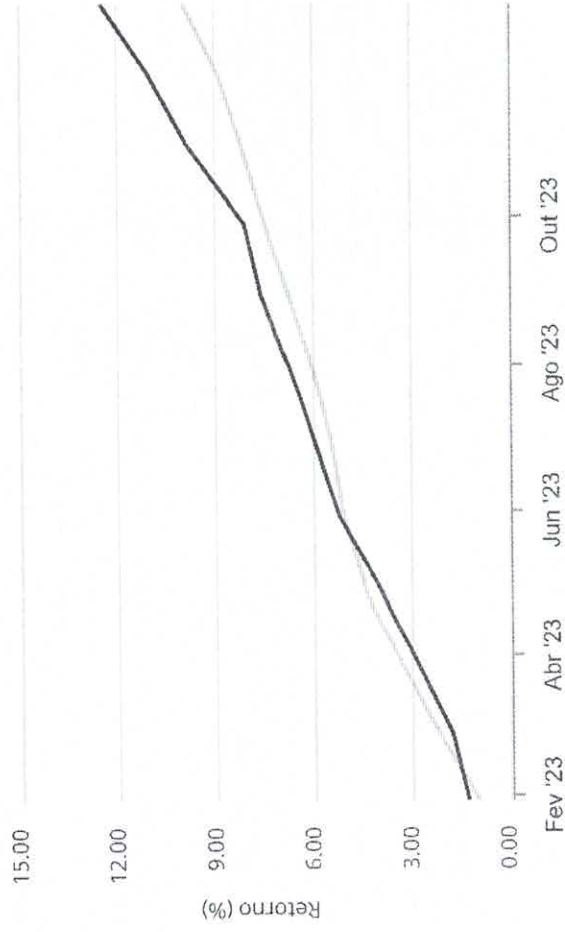
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

*m /*



**CRÉDITO  
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - PREV  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

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

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FIRENDA FIXA PRE...	21.109.920,43	0,00	0,00	21.785.724,67	675.804,24	3,20%	3,20%	2,27%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA PREVIDENCI...	6.075.049,54	0,00	0,00	6.241.719,98	166.670,44	2,74%	2,74%	1,46%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	10.086.760,85	0,00	0,00	10.361.762,57	275.001,72	2,73%	2,73%	1,45%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.509.044,76	0,00	0,00	3.604.416,69	95.371,93	2,72%	2,72%	1,44%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.016.701,99	0,00	0,00	3.065.285,66	48.583,67	1,61%	1,61%	0,78%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.129.866,54	0,00	0,00	5.204.965,86	75.119,32	1,46%	1,46%	0,67%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.697.603,96	0,00	0,00	15.924.359,84	226.755,88	1,44%	1,44%	0,49%
NOVUS INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA LP	5.501.136,47	0,00	0,00	5.568.467,91	67.331,44	1,22%	1,22%	0,65%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	524.219,42	0,00	0,00	530.548,93	6.329,51	1,21%	1,21%	0,28%
CAIXA BRASILEIRA FIC RENDA FIXA LP	942.799,97	0,00	0,00	952.046,22	9.246,25	0,98%	0,98%	0,07%
ITAU INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.473.421,45	0,00	0,00	7.544.384,89	70.963,44	0,95%	0,95%	0,02%
BRADERCO PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.181.588,36	0,00	0,00	11.286.439,99	104.851,63	0,94%	0,94%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	217.206.242,72	0,00	0,00	219.234.535,00	2.028.292,28	0,93%	-	-
LETRA FINANCEIRA BTG	93.384.200,78	0,00	0,00	94.119.807,82	735.607,04	0,79%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	9.365.177,81	3.024.278,00	2.558.120,58	9.927.872,94	96.537,71	0,78%	0,90%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.982.236,15	2.983.562,73	0,00	1.326,58	0,04%	0,82%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>410.203.735,05</b>	<b>6.006.514,15</b>	<b>5.541.683,31</b>	<b>415.352.358,97</b>	<b>4.683.793,08</b>	<b>1,14%</b>		<b>0,95%</b>



**CRÉDITO  
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - PREV  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

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

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5.076.879,42	0,00	0,00	5.576.807,34	499.927,92	9,85%	9,85%	5,20%
ICATU VANGUARDA I GARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	4.159.186,21	0,00	0,00	4.319.637,53	160.451,32	3,86%	3,86%	1,81%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	316.125,79	0,00	0,00	322.577,90	6.452,11	2,04%	2,04%	1,91%
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	37.191.383,80	0,00	0,00	37.595.611,41	404.227,61	1,09%	1,09%	0,59%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	606.651,51	0,00	0,00	612.121,48	5.469,97	0,90%	0,90%	0,05%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>47.350.226,73</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>48.426.755,66</b>	<b>1.076.528,93</b>	<b>2,27%</b>		<b>1,23%</b>



**CRÉDITO  
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - PREV  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

**FUNDOS EXTERIOR**

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

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.891.791,98	0,00	0,00	2.977.117,83	85.325,85	2,95%	2,95%	4,59%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.955.537,98	0,00	0,00	3.032.041,47	76.503,49	2,59%	2,59%	4,08%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.044.500,48	0,00	0,00	2.084.885,91	40.385,43	1,98%	1,98%	4,16%
<b>Total Exterior</b>	<b>7.891.830,44</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>8.094.045,21</b>	<b>202.214,77</b>	<b>2,56%</b>		<b>4,29%</b>

**CRÉDITO  
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - PREV

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
LETRA FINANCEIRA BTG	90.726.365,19	93.000.000,00	97.181.606,54	94.119.807,62	7.575.049,17	4,12%	-
TÍTULOS PÚBLICOS	175.436.425,87	129.164.637,12	89.178.444,20	219.234.535,00	3.811.916,21	1,25%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	21.310.150,29	0,00	599.497,85	21.785.724,67	1.075.072,23	5,04%	5,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	53.932.955,13	44.547.507,29	9.327.872,94	542.425,10	1,01%	2,83%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	9.897.387,07	0,00	0,00	10.361.762,57	464.395,50	4,69%	4,69%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.472.144,03	0,00	0,00	15.924.359,84	452.215,81	2,92%	2,92%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.956.564,89	0,00	0,00	11.286.439,99	329.875,10	3,01%	3,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.233.301,87	0,00	5.000.000,00	7.544.384,89	311.083,02	2,54%	3,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.960.825,21	0,00	0,00	6.241.719,98	280.894,77	4,71%	4,71%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.988.182,63	0,00	0,00	5.204.985,86	216.803,23	4,35%	4,35%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	5.385.224,64	0,00	0,00	5.568.467,91	183.243,27	3,40%	3,40%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.443.272,78	0,00	0,00	3.604.416,69	161.143,91	4,68%	4,68%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	21.363.610,15	0,00	21.501.170,69	0,00	137.560,54	0,64%	2,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.946.397,38	0,00	0,00	3.065.285,66	118.888,28	4,04%	4,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	11.076.193,74	0,00	11.143.422,54	0,00	67.228,80	0,61%	2,80%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.431.359,06	7.177.475,02	12.647.322,79	0,00	38.488,71	0,31%	2,58%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	928.452,19	0,00	0,00	952.046,22	23.594,03	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	515.481,07	0,00	0,00	530.548,93	15.067,86	2,92%	2,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.312.163,90	0,00	3.300.621,46	0,00	-11.542,44	-0,35%	2,86%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>401.383.481,96</b>	<b>283.275.067,27</b>	<b>285.099.593,36</b>	<b>415.352.358,97</b>	<b>15.793.403,10</b>	<b>2,31%</b>	



**CRÉDITO  
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - PREV  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	36.422.564,75	0,00	0,00	37.595.611,41	1.173.046,66	3,22%	3,22%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5.000.000,00	0,00	0,00	5.576.807,34	576.807,34	11,54%	11,54%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	4.035.182,72	0,00	0,00	4.319.637,53	284.454,81	7,05%	7,05%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	304.446,52	0,00	0,00	322.577,90	18.131,38	5,96%	5,96%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	595.849,66	0,00	0,00	612.121,48	16.271,82	2,73%	2,73%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>46.358.043,65</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>48.426.755,66</b>	<b>2.068.712,01</b>	<b>4,46%</b>	



**CRÉDITO  
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.816.634,46	0,00	0,00	3.032.041,47	215.407,01	7,65%	7,65%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.773.417,02	0,00	0,00	2.977.117,83	203.700,81	7,34%	7,34%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.968.945,28	0,00	0,00	2.084.885,91	115.940,63	5,89%	5,89%
<b>Total Exterior</b>	<b>7.558.996,76</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>8.094.045,21</b>	<b>535.048,45</b>	<b>7,08%</b>	





**CRÉDITO  
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - PREVID  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
LETRA FINANCEIRA BTG	82.473.700,26	93.000.000,00	97.181.606,54	94.119.807,82	15.827.714,10	9,02%	-
TÍTULOS PÚBLICOS	131.154.367,36	169.164.217,36	96.886.243,24	219.234.535,00	15.802.193,52	5,26%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	33.104.421,89	0,00	36.501.170,69	0,00	3.396.748,80	10,26%	13,39%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	15.478.070,47	89.424.502,58	106.766.361,43	0,00	1.863.788,38	1,78%	11,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	20.778.323,71	599.497,85	21.785.724,67	1.606.898,81	7,73%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.098.007,96	0,00	5.000.000,00	7.544.384,89	1.446.376,93	13,03%	13,57%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.933.007,10	0,00	0,00	11.286.439,99	1.353.432,89	13,63%	13,63%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.164.349,41	11.509.504,93	0,00	15.924.359,84	1.250.505,50	8,52%	11,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	19.733.529,07	0,00	20.778.323,71	0,00	1.044.794,64	5,29%	13,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	37.145.131,52	0,00	35.000.000,00	3.065.285,66	920.154,14	2,48%	15,84%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.675.146,04	2.795.922,83	0,00	6.241.719,98	770.651,11	14,09%	15,77%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	528.644,99	10.000.000,00	11.143.422,54	0,00	614.777,55	5,84%	12,88%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,00	5.002.539,40	0,00	5.568.467,91	565.928,51	11,31%	15,53%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	53.932.955,13	44.547.507,29	9.927.872,94	542.425,10	1,01%	12,98%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.111.960,13	0,00	0,00	3.604.416,69	492.456,56	15,82%	15,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.065.820,45	0,00	11.512.842,30	0,00	447.021,85	4,04%	11,96%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	10.521.611,36	0,00	10.000.000,00	952.046,22	430.434,86	4,09%	12,80%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	0,00	10.000.000,00	0,00	10.361.762,57	361.762,57	3,62%	15,77%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.249.668,15	0,00	5.000.000,00	530.548,93	280.880,78	5,35%	13,59%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.044.457,64	0,00	3.300.621,46	0,00	256.163,82	8,41%	11,90%



**CRÉDITO  
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - PREV  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.204.985,86	204.985,86	4,10%	16,24%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.439.826,32	0,00	1.482.784,91	0,00	42.958,59	2,98%	15,86%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.277.428,72	0,00	1.314.638,19	0,00	37.209,47	2,91%	15,98%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>382.199.148,84</b>	<b>470.607.965,94</b>	<b>487.015.020,15</b>	<b>415.352.358,97</b>	<b>49.560.264,34</b>	<b>5,81%</b>	



**CRÉDITO  
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - PREV  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,00	35.005.078,80	0,00	37.595.611,41	2.590.532,61	7,40%	12,66%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.576.807,34	576.807,34	11,54%	55,36%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.319.637,53	319.637,53	7,99%	21,42%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	544.054,07	0,00	0,00	612.121,48	68.067,41	12,51%	12,51%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	281.740,61	0,00	0,00	322.577,90	40.837,29	14,49%	14,49%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	6.342.672,16	0,00	5.798.618,96	0,00	-544.053,20	-8,58%	19,09%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	21.327.713,60	0,00	19.806.012,55	0,00	-1.521.701,05	-7,13%	20,49%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>28.496.180,44</b>	<b>44.005.078,80</b>	<b>25.604.631,51</b>	<b>48.426.755,66</b>	<b>1.530.127,93</b>	<b>3,26%</b>	



**CRÉDITO  
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - PREV  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/12/2023

**FUNDOS EXTERIOR**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2023

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.427.153,63	0,00	0,00	3.032.041,47	604.887,84	24,92%	24,92%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.553.120,33	0,00	0,00	2.977.117,83	423.997,50	16,61%	16,61%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.916.745,10	0,00	0,00	2.084.885,91	168.140,81	8,77%	8,77%
<b>Total Exterior</b>	<b>6.897.019,06</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>8.094.045,21</b>	<b>1.197.026,15</b>	<b>17,36%</b>	



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.