

RELATORIO DE INVESTIMENTOS

AGOSTO 2023

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 à disposição dos Conselhos de Administração e Fiscal para acompanhamento e homologação.

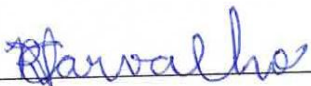
2. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos do São Roque Prev analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês ago/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 agosto de 2023, em reunião realizada em 26 de setembro 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 agosto de 2023

[Handwritten signature]

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



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2023)

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/08/2023

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			174.178.267,07	38,48%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	15.454.965,59	3,41%	790	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.019.144,57	1,33%	623	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	10.976.947,17	2,43%	1.128	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P...	D+0	49444	21.652.836,50	4,78%	44	3,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	513.407,77	0,11%	793	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.300.418,93	0,73%	876	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	13.738.414,75	3,04%	996	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.482.746,69	0,77%	95	0,63%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.842.781,15	2,40%	389	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	924.272,06	0,20%	118	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	36.095.799,64	7,97%	424	0,64%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.955.239,75	0,65%	213	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	12.105.980,11	2,67%	383	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	D+4 du	Não há	5.345.227,81	1,18%	86	1,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Inf	Não se aplica	90.139.334,71	19,91%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.869.928,13	0,63%	11.068	0,43%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.921.058,96	0,65%	485	0,14%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.988.869,74	0,44%	1.928	2,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	590.793,72	0,13%	2.987	0,04%	Artigo 10º, Inciso I



Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 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	301.721,86	0,07%	5.579	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	36.225.681,84	8,00%	16.660	8,90%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			452.623.838,52				

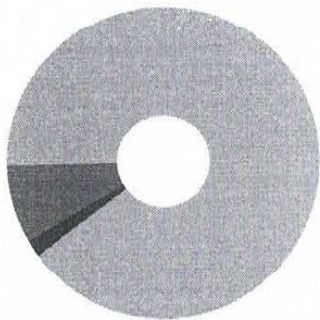
2



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a'	100,00%	174.178.267,07	38,48%	20,00%	37,00%	60,00%	97.396.036,04
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	100,00%	57.917.720,53	12,80%	5,00%	10,00%	60,00%	213.656.582,58
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	45.262.383,85
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	60,00%	85.490.461,96	18,89%	0,00%	18,00%	60,00%	186.083.841,15
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	9.052.476,77
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	90.139.334,71	19,91%	20,00%	20,00%	20,00%	385.432,99
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	22.631.191,93
Total Renda Fixa	100,00%	407.725.784,27	90,08%	45,00%	86,00%	217,00%	



RENDA FIXA 407.725.784,27

EXTERIOR 7.779.856

ESTRUTURADOS 37.118.197,42

2

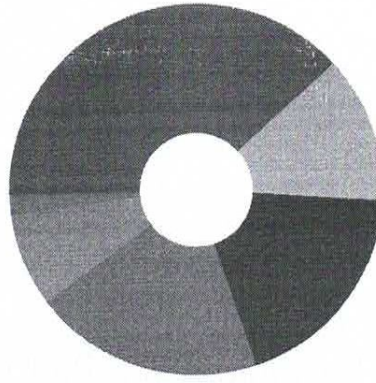


CRÉDITO & MERCADO

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2023

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	8,00%	30,00%	135.787.151,56
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	45.262.383,85
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	37.118.197,42	8,20%	0,00%	2,00%	10,00%	8.144.186,43
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	22.631.191,93
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	22.631.191,93
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	37.118.197,42	8,20%	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%	45.262.383,85
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	7.779.856,83	1,72%	0,00%	2,00%	10,00%	37.482.527,02
Total Exterior	10,00%	7.779.856,83	1,72%	0,00%	2,50%	20,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...)	174.178.267,07	38,48	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT	90.139.334,71	19,91	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	70.712.236,71	15,62	-
CAIXA DTVM	44.647.472,94	9,86	-
NOVUS CAPITAL	41.570.909,65	9,18	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	14.325.527,84	3,16	-
ITAÚ UNIBANCO	12.105.980,11	2,67	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	4.944.109,49	1,09	-

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)

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a'	174.178.267,07	38,48	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	57.917.720,53	12,80	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	85.490.461,96	18,89	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'b'	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00	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	7.779.856,83	1,72	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	37.118.197,42	8,20	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

2,



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,77%	8,66%	2,75%	5,42%	11,80%	22,33%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	8,41%	2,76%	5,32%	11,53%	21,66%	0,90%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,15%	9,05%	3,44%	6,81%	13,74%	24,03%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	8,82%	3,37%	6,66%	13,40%	23,37%	0,18%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,61%	8,75%	2,66%	5,76%	11,97%	23,03%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,58%	8,63%	2,58%	5,68%	11,73%	22,46%	0,95%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,38%	11,84%	2,83%	10,43%	13,76%	20,07%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,39%	11,92%	2,79%	10,53%	13,59%	19,32%	1,71%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	11,65%	2,71%	10,26%	13,45%	19,42%	1,74%	0,05%
CDI (Benchmark)	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,30%	9,08%	3,66%	6,98%	13,97%	26,56%	0,04%	0,00%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,53%	10,90%	5,54%	7,90%	14,33%	-	0,77%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,22%	9,04%	3,56%	7,00%	13,78%	25,89%	0,05%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,05%	8,15%	3,07%	6,14%	12,44%	22,66%	0,01%	0,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,27%	9,16%	3,63%	7,00%	14,06%	26,49%	0,02%	0,00%



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2023

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,23%	3,23%	0,27%	1,83%	4,61%	13,74%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,63%	9,92%	3,67%	7,75%	13,76%	23,41%	0,58%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DÍNÂMICA FIC RENDA FIXA	0,37%	11,68%	3,52%	9,87%	12,79%	24,05%	1,25%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67%	-	2,81%	-	-	-	2,18%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,62%	9,51%	3,34%	7,38%	13,10%	23,77%	0,50%	0,02%

2



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,14%	8,87%	3,32%	6,68%	13,55%	25,14%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,95%	8,55%	3,35%	6,04%	12,00%	26,09%	0,41%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,61%	7,09%	3,68%	7,31%	10,35%	17,96%	1,77%	0,06%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,90%	8,59%	3,15%	6,54%	13,08%	26,10%	0,23%	0,00%
Global BDRX (Benchmark)	3,26%	21,43%	5,97%	15,02%	15,64%	-2,06%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	20,35%	5,57%	14,51%	14,37%	-4,08%	8,36%	0,23%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,94%	10,22%	4,26%	6,72%	7,19%	-8,38%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,73%	12,41%	6,36%	10,00%	11,02%	-5,94%	7,31%	0,21%

2



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2023

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

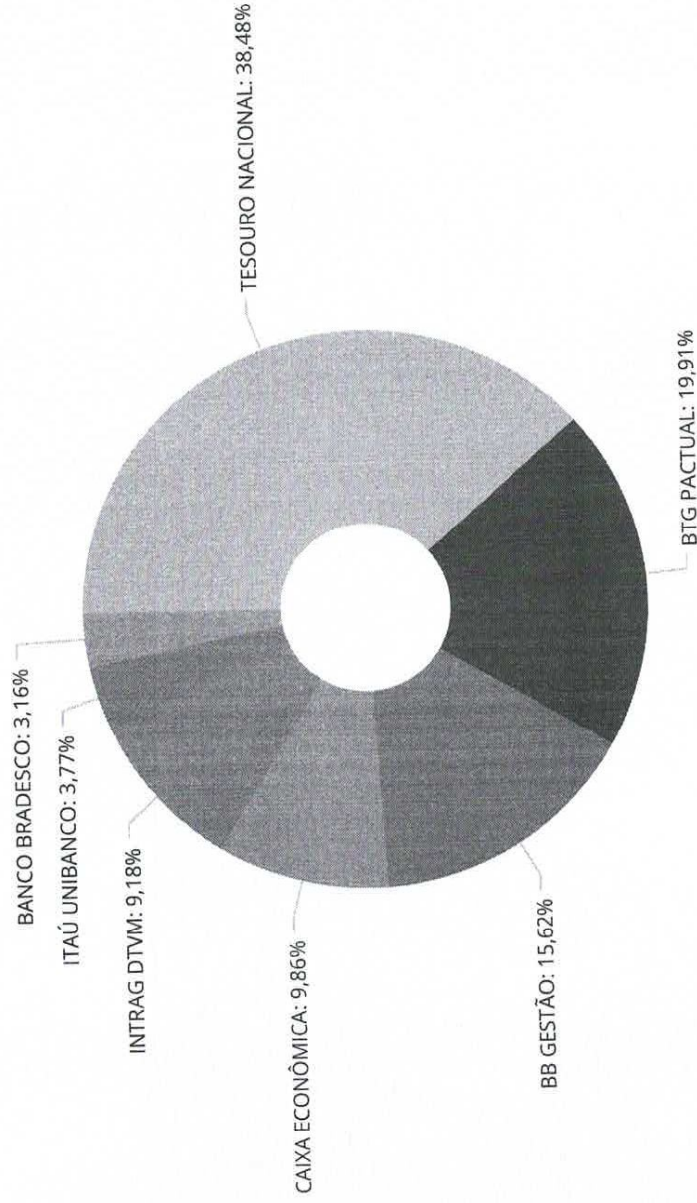
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	1,94%	10,22%	4,26%	6,72%	7,19%	-8,38%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,73%	12,41%	6,36%	10,00%	11,02%	-5,94%	7,31%	20,748%
Global BDRX (Benchmark)	3,26%	21,43%	5,97%	15,02%	15,64%	-2,06%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	20,35%	5,57%	14,51%	14,97%	-4,08%	8,36%	22,747%
ITAU FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,61%	3,76%	3,31%	4,63%	4,52%	-2,39%	8,30%	19,695%

M.



CRÉDITO & MERCADO

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



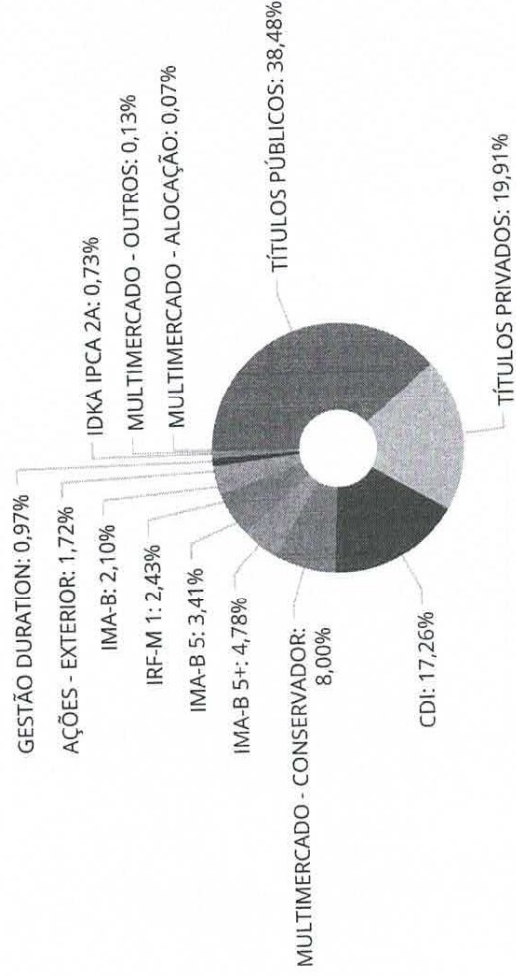
Administrador	Valor
TESOURO NACIONAL	174.178.267,07
BTG PACTUAL	90.139.334,71
BB GESTÃO	70.712.236,71
CAIXA ECONÔMICA	44.647.472,94
INTRAG DTVM	41.570.909,65
ITAÚ UNIBANCO	17.050.089,60
BANCO BRADESCO	14.325.527,84

Handwritten signature



**CRÉDITO
& MERCADO**

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



Sub-Segment	Value	Sub-Segment	Value
TÍTULOS PÚBLICOS	174.178.267,07	TÍTULOS PRIVADOS	90.139.334,71
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	36.225.681,84	IMA-B 5	21.652.836,50
IRF-M 1	10.976.947,17	AÇÕES - EXTERIOR	9.501.891,26
GESTÃO DURATION	4.392.919,58	MULTIMERCADO - OUTROS	3.300.418,93
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	301.721,86	CDI	78.128.203,46
		IMA-B 5	15.454.965,59
		AÇÕES - EXTERIOR	7.779.856,83
		MULTIMERCADO - OUTROS	590.793,72

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 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	4.139,997164	79.996.678,20	81.611.764,09	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	04/11/2022	12.236	4.086,264032100	4.222,899008	49.999.526,70	51.671.392,26	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	03/03/2023	10.032	3.987,19898800	4.076,466379	39.999.580,25	40.895.110,71	Curva

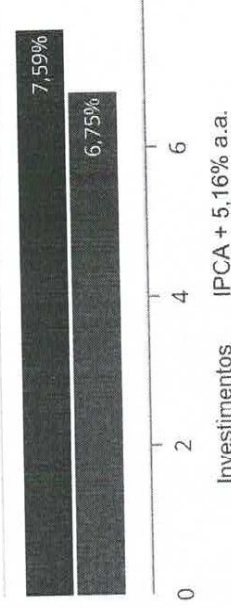
2



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%	5.381.793,35	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%	7.393.829,24	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%	12.007.910,85	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%	16.216.004,29	0,37%	4,39%	88,88%	0,54%
Mai	431.714.954,77	59.727.603,33	59.271.376,08	437.708.850,22	5.537.668,20	21.753.672,49	1,28%	21.753.672,49	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%	24.742.187,08	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%	27.922.834,99	0,54%	6,02%	111,55%	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%	31.554.919,75	0,69%	6,75%	112,36%	0,91%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



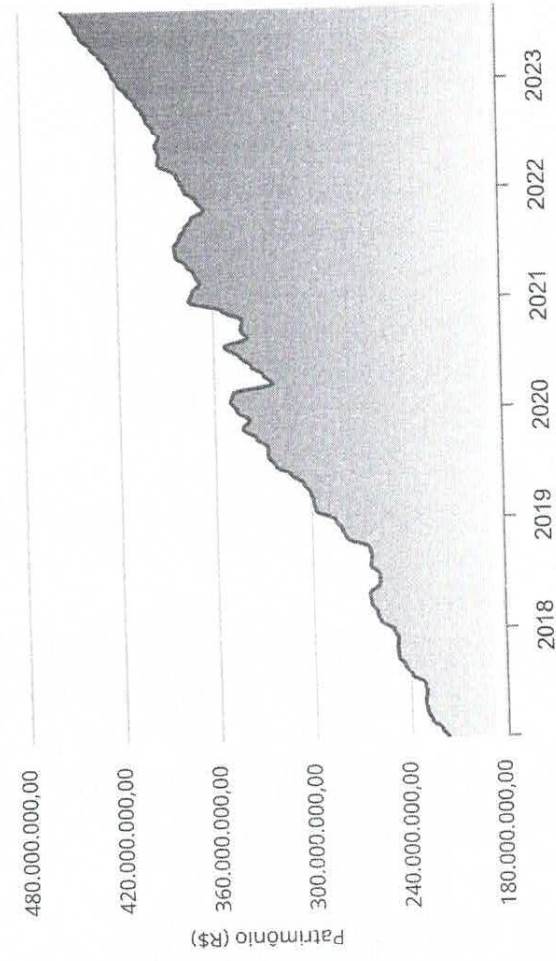


CRÉDITO & MERCADO

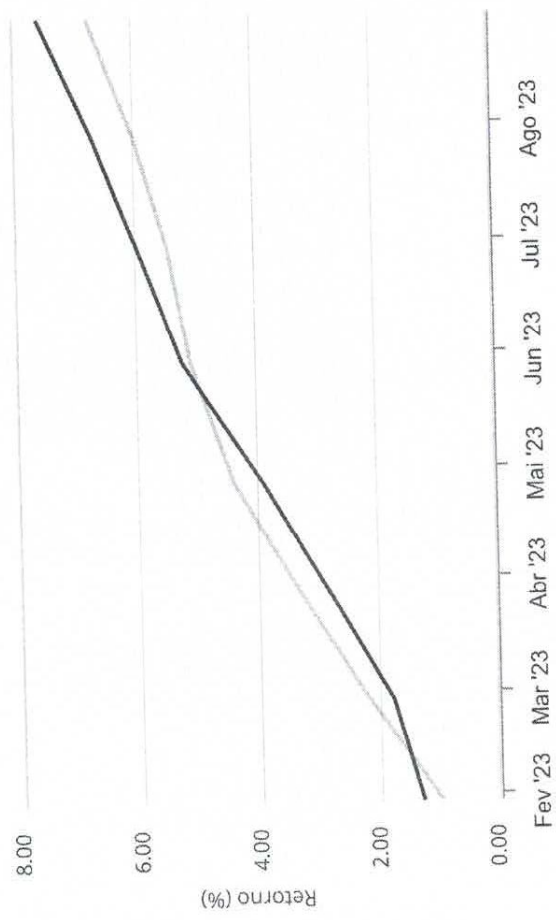
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

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

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	5.264.563,03	0,00	0,00	5.345.227,81	80.664,78	1,53%	1,53%	0,77%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.950.567,18	0,00	0,00	12.105.980,11	155.412,93	1,30%	1,30%	0,04%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.707.120,39	0,00	0,00	10.842.781,15	135.660,76	1,27%	1,27%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	35.661.589,84	0,00	0,00	36.095.799,64	434.209,80	1,22%	1,22%	0,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	10.855.819,64	0,00	0,00	10.976.947,17	121.127,53	1,12%	1,12%	0,18%
LETRA FINANCEIRA BTG	89.367.259,41	0,00	0,00	90.139.334,71	772.075,30	0,86%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	8.829.937,92	7.238.871,49	2.457.005,08	13.738.414,75	126.610,42	0,79%	1,05%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.275.056,05	0,00	0,00	3.300.418,93	25.362,88	0,77%	0,77%	0,90%
TÍTULOS PÚBLICOS	176.736.386,73	0,00	3.900.562,79	174.178.267,07	1.342.443,13	0,76%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	510.190,03	0,00	0,00	513.407,77	3.217,74	0,63%	0,63%	0,58%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	918.563,40	0,00	0,00	924.272,06	5.708,66	0,62%	0,62%	0,50%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.365.709,13	0,00	0,00	15.454.965,59	89.256,46	0,58%	0,58%	0,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.944.337,15	0,00	0,00	2.955.239,75	10.902,60	0,37%	0,37%	1,25%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.496.411,93	0,00	0,00	3.482.746,69	-13.665,24	-0,39%	-0,39%	1,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.043.395,13	0,00	0,00	6.019.144,57	-24.250,56	-0,40%	-0,40%	1,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	21.798.423,81	0,00	0,00	21.652.836,50	-145.587,31	-0,67%	-0,67%	2,18%
Total Renda Fixa	403.725.330,77	7.238.871,49	5.357.567,87	407.725.784,27	3.119.149,88	0,77%		0,66%



FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

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

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	35.886.263,46	0,00	0,00	36.225.681,84	339.418,38	0,95%	0,95%	0,41%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	585.511,43	0,00	0,00	590.793,72	5.282,29	0,90%	0,90%	0,23%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	303.576,53	0,00	0,00	301.721,86	-1.854,67	-0,61%	-0,61%	1,77%
Total Renda Variável	36.775.351,42	0,00	0,00	37.118.197,42	342.846,00	0,93%		0,42%



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2023

FUNDOS EXTERIOR

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

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.838.633,28	0,00	0,00	2.921.058,96	82.425,68	2,90%	2,90%	8,36%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.793.609,64	0,00	0,00	2.869.928,13	76.318,49	2,73%	2,73%	7,31%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.938.227,54	0,00	0,00	1.988.869,74	50.642,20	2,61%	2,61%	8,30%
Total Exterior	7.570.470,46	0,00	0,00	7.779.856,83	209.386,37	2,77%		7,95%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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.

