

RELATORIO DE INVESTIMENTOS

NOVEMBRO 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 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 NOV/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 NOVEMBRO de 2023, em reunião realizada em 19 de dezembro de 2023.

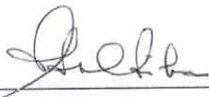
Rosana Teixeira de Carvalho



Lisete de Fátima Oliveira



Solange Siqueira Duarte Silva



Mauracy Moraes de Oliveira





CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2023

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			217.206.242,72	46,67%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	15.697.603,96	3,37%	780	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.075.049,54	1,31%	645	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P...	D+0	49444	21.109.920,43	4,54%	44	3,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	524.219,42	0,11%	788	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.016.701,99	0,65%	216	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.086.760,85	2,17%	106	2,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.129.866,54	1,10%	29	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	9.365.177,81	2,01%	1.131	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.509.044,76	0,75%	99	0,69%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.181.588,36	2,40%	433	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	942.799,97	0,20%	118	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.473.421,45	1,61%	392	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	D+4 du	Não há	5.501.136,47	1,18%	95	1,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	93.384.200,78	20,06%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.076.879,42	1,09%	58	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.891.791,98	0,62%	10.294	0,45%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.955.537,98	0,63%	470	0,15%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	2.044.500,48	0,44%	1.786	2,14%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	606.651,51	0,13%	2.708	0,04%	Artigo 10º, Inciso I



Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 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	316.125,79	0,07%	5.216	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	4.159.186,21	0,89%	668	1,30%	Artigo 10º, Inciso I
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	37.191.383,80	7,99%	14.701	10,10%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			465.445.792,22				

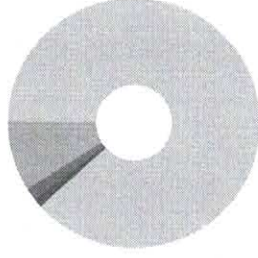
[Handwritten signature]

[Handwritten signature]



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a'	100,00%	217.206.242,72	46,67%	20,00%	37,00%	60,00%	62.061.232,61
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	100,00%	61.640.122,73	13,24%	5,00%	10,00%	60,00%	217.627.352,60
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	46.544.579,22
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	60,00%	37.973.168,82	8,16%	0,00%	18,00%	60,00%	241.294.306,51
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	9.308.915,84
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	93.384.200,78	20,06%	20,00%	20,00%	20,00%	-295.042,34
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	23.272.289,61
Total Renda Fixa	100,00%	410.203.735,05	88,13%	45,00%	86,00%	217,00%	



RENDA FIXA 410.203.735,05
 RENDA VARIÁVEL 5.076.879,42
 EXTERIOR 7.891.830,44
 ESTRUTURADOS 42.273.347,31

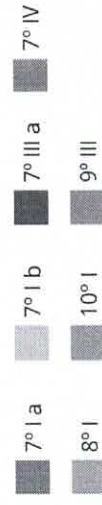
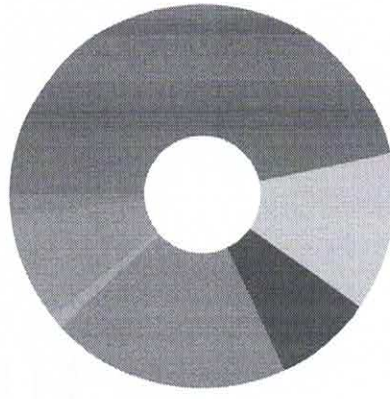
(Handwritten signatures and initials)



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5.076.879,42	1,09%	0,00%	8,00%	30,00%	134.556.858,25
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	46.544.579,22
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	42.273.347,31	9,08%	0,00%	2,00%	10,00%	4.271.231,91
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	23.272.289,61
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	23.272.289,61
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	47.350.226,73	10,17%	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%	46.544.579,22
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	7.891.830,44	1,70%	0,00%	2,00%	10,00%	38.652.748,78
Total Exterior	10,00%	7.891.830,44	1,70%	0,00%	2,50%	20,00%	

Handwritten signature

Handwritten signature



Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI...	217.206.242,72	46,67	-
BANCO BTG PACTUAL	93.384.200,78	20,06	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	55.139.543,72	11,85	-
NOVUS CAPITAL	42.692.520,27	9,17	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	15.216.627,39	3,27	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	14.690.633,12	3,16	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	12.534.623,92	2,69	-
CAIXA DTVM	5.345.334,67	1,15	-
TARPON INVESTIMENTOS	5.076.879,42	1,09	-
ICATU VANGUARDA	4.159.186,21	0,89	-

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 Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	217.206.242,72	46,67	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	61.640.122,73	13,24	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	37.973.168,82	8,16	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	2,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	1,80%	10,51%	1,62%	4,32%	11,55%	22,27%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,79%	10,34%	1,57%	4,19%	11,35%	21,76%	0,73%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,62%	12,95%	0,99%	3,85%	12,73%	20,41%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,48%	12,76%	0,76%	3,57%	12,46%	19,67%	1,91%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,61%	12,68%	0,93%	3,66%	12,44%	19,79%	1,90%	0,05%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	2,61%	12,70%	0,93%	3,73%	12,45%	19,83%	1,90%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	2,47%	14,81%	3,03%	6,96%	16,50%	27,30%	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,48%	14,57%	2,98%	6,84%	16,24%	26,56%	1,09%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,92%	12,04%	2,92%	6,33%	13,30%	26,87%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,99%	12,57%	3,13%	6,86%	13,88%	28,23%	0,03%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,99%	12,50%	3,14%	6,91%	13,77%	28,30%	0,03%	0,00%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,44%	14,13%	2,92%	8,62%	14,69%	35,91%	0,85%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,91%	11,97%	2,90%	6,35%	13,23%	27,07%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,28%	4,04%	0,78%	1,05%	4,68%	10,86%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,70%	-	0,27%	3,09%	-	-	2,70%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,19%	11,71%	2,01%	5,41%	13,05%	24,66%	0,33%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,44%	12,23%	2,11%	5,85%	13,51%	25,27%	0,43%	0,01%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,60%	14,00%	2,08%	5,68%	13,58%	23,99%	1,40%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,92%	12,04%	2,92%	6,33%	13,30%	26,87%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3,98%	12,21%	4,77%	8,63%	12,36%	27,30%	2,07%	0,05%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,95%	11,51%	2,68%	5,92%	12,80%	27,50%	0,07%	0,00%
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1,23%	11,44%	2,67%	6,11%	12,04%	29,05%	0,47%	0,01%

Global BDRX (Benchmark)	6,46%	22,84%	1,17%	7,21%	17,66%	-10,11%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	6,42%	21,77%	1,18%	6,82%	15,93%	-11,50%	4,68%	0,16%

Ibovespa (Benchmark)	12,54%	16,04%	10,01%	17,53%	13,20%	24,94%	-	-
TARPON GT INSTITUCIONAL I FICAÇÕES	8,07%	41,43%	9,31%	24,77%	34,69%	77,11%	8,53%	0,20%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,80%	10,51%	1,62%	4,32%	11,55%	22,27%	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	4,45%	16,91%	3,00%	7,70%	17,47%	37,79%	2,00%	0,06%

MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	6,74%	11,97%	1,58%	5,91%	3,56%	-15,18%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,03%	13,27%	0,76%	7,17%	7,75%	-13,63%	4,35%	0,15%

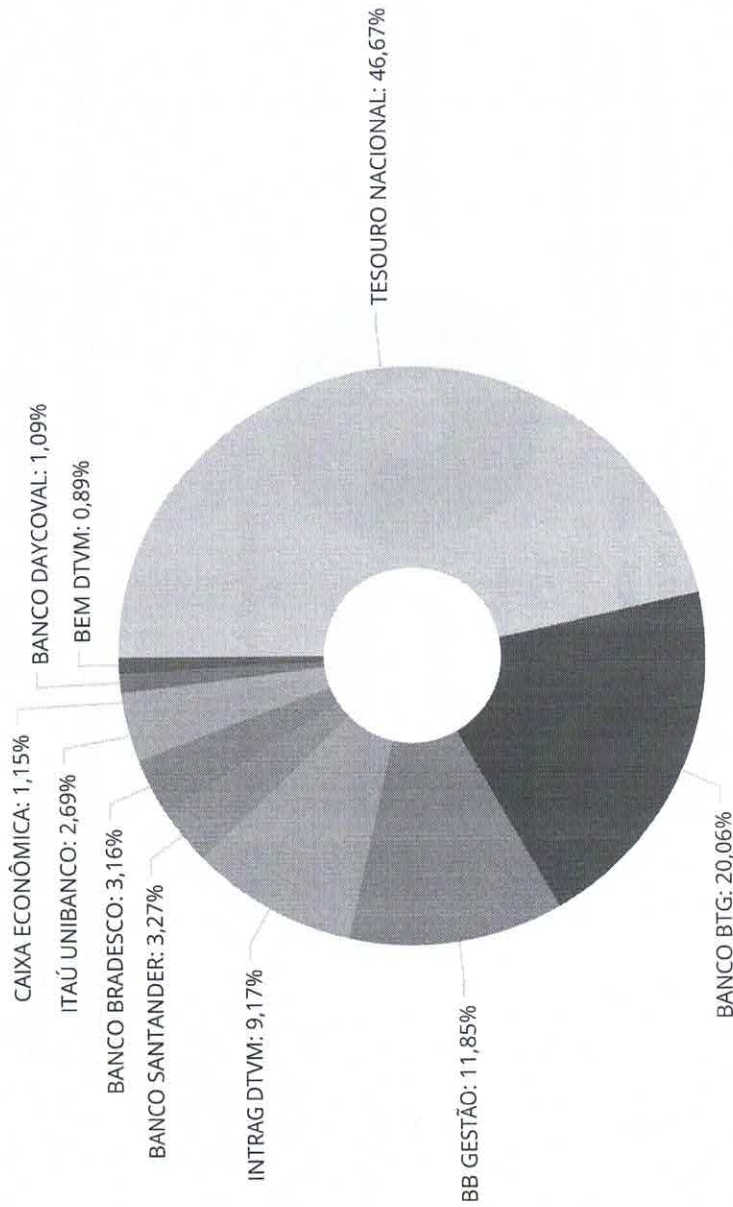


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	6,74%	11,97%	1,58%	5,91%	3,56%	-15,18%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6,03%	13,27%	0,76%	7,17%	7,75%	-13,63%	4,35%	14,967%
Global BDRX (Benchmark)	6,46%	22,84%	1,17%	7,21%	17,66%	-10,11%	-	-
ITAU FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5,22%	6,67%	2,80%	6,20%	2,59%	-8,59%	4,26%	14,310%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,42%	21,77%	1,18%	6,82%	15,93%	-11,50%	4,68%	16,408%



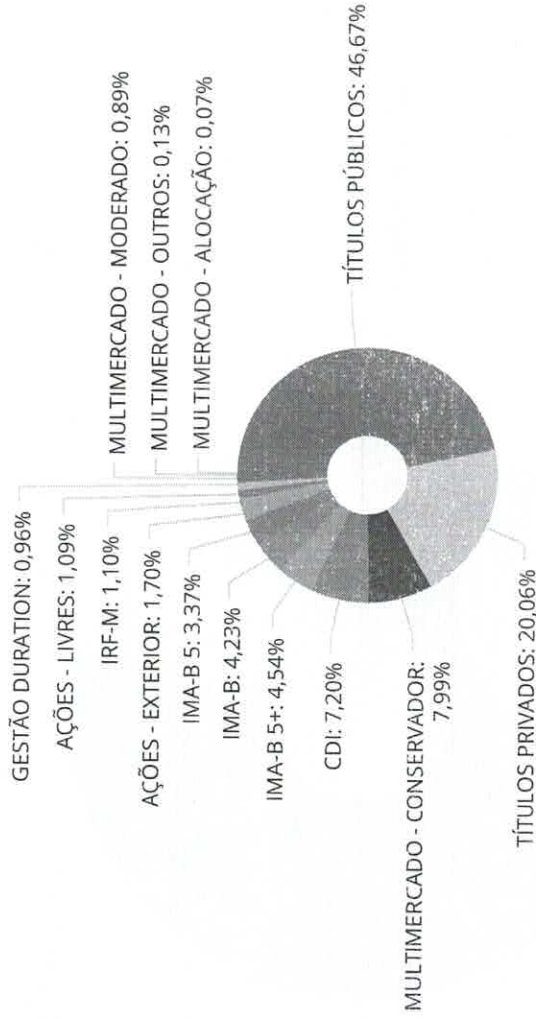
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Novembro / 2023)



Administrador	Valor
TESOURO NACIONAL	217.206.242,72
BANCO BTG	93.384.200,78
BB GESTÃO	55.139.543,72
INTRAG DTVM	42.692.520,27
BANCO SANTANDER	15.216.627,39
BANCO BRADESCO	14.690.633,12
ITAÚ UNIBANCO	12.534.623,92
CAIXA ECONÔMICA	5.345.334,67
BANCO DAYCOVAL	5.076.879,42
BEM DTVM	4.159.186,21



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	217.206.242,72	■ TÍTULOS PRIVADOS	93.384.200,78	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	37.191.383,80
■ CDI	33.521.324,09	■ IMA-B 5+	21.109.920,43	■ IMA-B	19.670.855,15
■ IMA-B 5	15.697.603,96	■ AÇÕES - EXTERIOR	7.891.830,44	■ IRF-M	5.129.866,54
■ AÇÕES - LIVRES	5.076.879,42	■ GESTÃO DURATION	4.483.721,38	■ MULTIMERCADO - MODERADO	4.159.186,21
■ MULTIMERCADO - OUTROS	606.651,51	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	316.125,79		



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

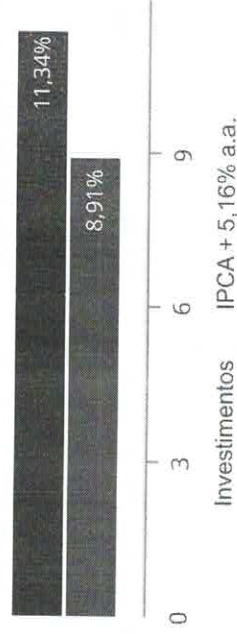
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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	4.231,705953	79.996.678,20	83.419.619,45	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	04/11/2022	12.236	4.086,264032100	4.311,728516	49.999.526,70	52.758.310,12	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	03/03/2023	10.032	3.987,19898800	4.045,22826	39.999.580,25	40.581.729,90	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	20/11/2023	1.000	4.352,820989	4.334,320133	4.352.820,99	4.334.320,13	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	23/11/2023	8.300	4.339,115559	4.334,320133	36.014.659,14	35.974.857,10	Mercado

[Handwritten signature]

**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	5.537.668,20	21.753.672,49	1,28%	5,23%	0,67%	5,09%	102,80%	0,66%
Junho	437.708.850,22	19.523.274,36	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	146.441.418,18	460.902.996,64	6.289.246,34	47.219.719,28	1,38%	11,34%	0,68%	8,91%	127,39%	1,46%

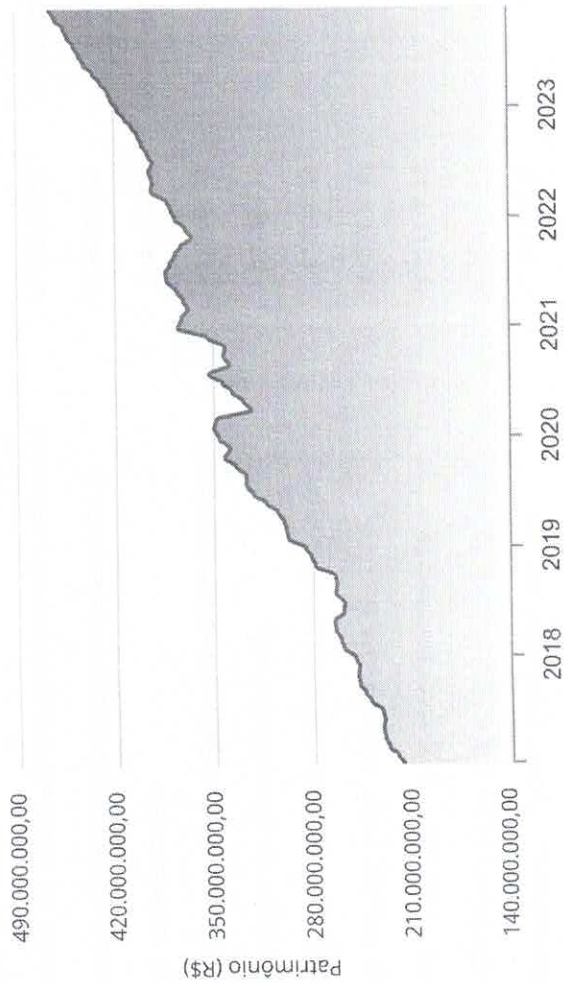
Investimentos x Meta de Rentabilidade



CRÉDITO & MERCADO

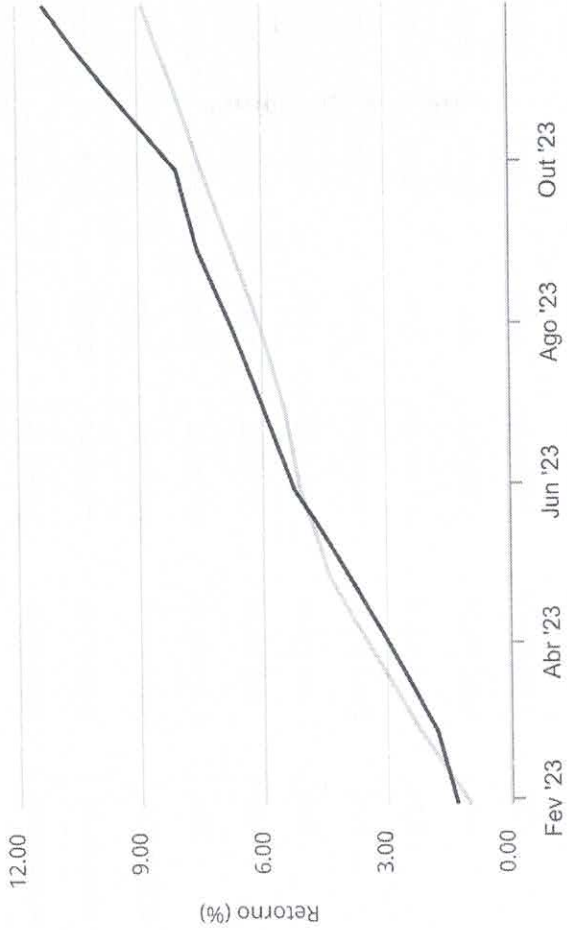
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B

IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1

IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

[Handwritten signatures and initials]



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	21.142.025,50	0,00	599.497,85	21.109.920,43	567.392,78	2,68%	2,70%	2,70%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	9.830.335,82	0,00	0,00	10.086.760,85	256.425,03	2,61%	2,61%	1,90%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.920.654,61	0,00	0,00	6.075.049,54	154.394,93	2,61%	2,61%	1,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.940.268,39	0,00	0,00	3.016.701,99	76.433,60	2,60%	2,60%	1,40%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.424.048,40	0,00	0,00	3.509.044,76	84.996,36	2,48%	2,48%	1,91%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.005.976,99	0,00	0,00	5.129.866,54	123.889,55	2,47%	2,47%	1,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.422.016,74	0,00	0,00	15.697.603,96	275.587,22	1,79%	1,79%	0,73%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	5.422.931,47	0,00	0,00	5.501.136,47	78.205,00	1,44%	1,44%	0,85%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	516.804,04	0,00	0,00	524.219,42	7.415,38	1,43%	1,43%	0,43%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	931.683,17	0,00	0,00	942.799,97	11.116,80	1,19%	1,19%	0,33%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.072.088,04	0,00	0,00	11.181.588,36	109.500,32	0,99%	0,99%	0,03%
LETRA FINANCEIRA BTG	7.786.602,35	93.000.000,00	8.374.703,18	93.384.200,78	972.301,61	0,96%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.363.236,05	0,00	5.000.000,00	7.473.421,45	110.185,40	0,89%	0,99%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	40.332.123,64	9.067.934,12	40.344.423,11	9.365.177,81	309.543,16	0,63%	0,91%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	265.530.796,35	40.367.480,11	90.412.186,29	217.206.242,72	1.720.152,55	0,56%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	260.167,68	1.836.039,54	2.097.803,29	0,00	1.596,07	0,08%	0,83%	0,01%
Total Renda Fixa	407.901.759,24	144.271.453,77	146.828.613,72	410.203.735,05	4.859.135,76	1,19%		1,22%



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

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

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	4.697.931,61	0,00	0,00	5.076.879,42	378.947,81	8,07%	8,07%	8,53%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	3.981.816,97	0,00	0,00	4.159.186,21	177.369,24	4,45%	4,45%	2,00%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	304.020,84	0,00	0,00	316.125,79	12.104,95	3,98%	3,98%	2,07%
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	36.739.464,35	0,00	0,00	37.191.383,80	451.919,45	1,23%	1,23%	0,47%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	600.930,07	0,00	0,00	606.651,51	5.721,44	0,95%	0,95%	0,07%
Total Renda Variável	46.324.163,84	0,00	0,00	47.350.226,73	1.026.062,89	2,21%		1,47%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.777.225,47	0,00	0,00	2.955.537,98	178.312,51	6,42%	6,42%	4,68%
BB AÇÕES GLOBAIS FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.727.389,37	0,00	0,00	2.891.791,98	164.402,61	6,03%	6,03%	4,35%
ITAÚ FIAÇÕES BDR NÍVEL I	1.943.022,35	0,00	0,00	2.044.500,48	101.478,13	5,22%	5,22%	4,26%
Total Exterior	7.447.637,19	0,00	0,00	7.891.830,44	444.193,25	5,96%		4,45%



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.

