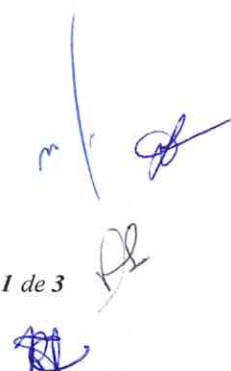


RELATORIO DE INVESTIMENTOS

SETEMBRO 2023

3 TRIMESTRE

Handwritten signatures in blue ink, including a large signature at the top right and a smaller one below it.

SUMÁRIO

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

Handwritten signatures in blue ink, including a vertical line, a signature, and a stamp.

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 SET/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 SETEMBRO 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 setembro e 3º trimestre de 2023



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			175.436.425,87	38,53%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	15.472.144,03	3,40%	794	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.960.825,21	1,31%	638	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	11.076.193,74	2,43%	1.132	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P...	D+0	49444	21.310.150,29	4,68%	44	3,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	515.481,07	0,11%	794	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.312.163,90	0,73%	873	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.946.397,38	0,65%	213	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.897.367,07	2,17%	113	2,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.988.182,63	1,10%	27	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.431.359,06	1,19%	999	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.443.272,78	0,76%	98	0,60%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.956.564,89	2,41%	404	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	928.452,19	0,20%	119	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.363.610,15	4,69%	426	0,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	12.233.301,87	2,69%	385	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	D+4 dia	Não há	5.385.224,64	1,18%	92	1,38%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	90.726.365,19	19,93%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.000.000,00	1,10%	56	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.773.417,02	0,61%	10.797	0,44%	Artigo 9º, Inciso III



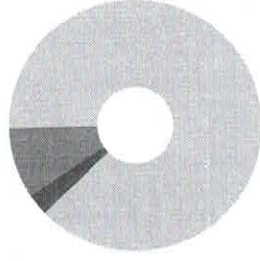
Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.816.634,46	0,62%	477	0,14%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.968.945,28	0,43%	1.882	2,07%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	595.849,66	0,13%	2.895	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	304.446,52	0,07%	5.458	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	4.035.182,72	0,89%	642	1,33%	Artigo 10º, Inciso I
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	36.422.564,75	8,00%	16.124	9,20%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			455.300.522,37				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a'	100,00%	175.436.425,87	38,53%	20,00%	37,00%	60,00%	97.743.887,55
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	100,00%	75.478.905,32	16,58%	5,00%	10,00%	60,00%	197.701.408,10
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	45.530.052,24
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	60,00%	59.741.785,58	13,12%	0,00%	18,00%	60,00%	213.438.527,84
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	9.106.010,45
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	90.726.365,19	19,93%	20,00%	20,00%	20,00%	333.739,28
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	22.765.026,12
Total Renda Fixa	100,00%	401.383.481,96	88,16%	45,00%	86,00%	217,00%	



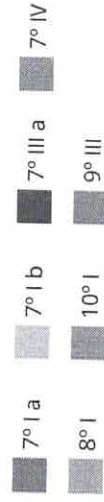
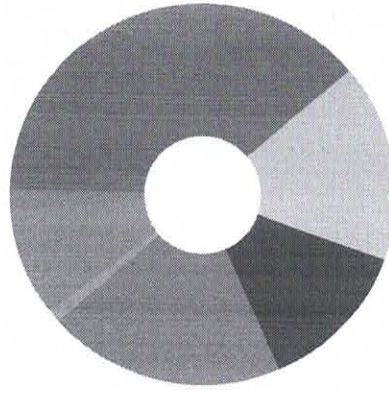
RENDA FIXA 401.383.481,96
 RENDA VARIÁVEL 5.000.000,00
 EXTERIOR 7.558.996,76
 ESTRUTURADOS 41.358.043,65

[Handwritten signatures and initials]



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5.000.000,00	1,10%	0,00%	8,00%	30,00%	131.590.156,71
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	45.530.052,24
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	41.358.043,65	9,08%	0,00%	2,00%	10,00%	4.172.008,59
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	22.765.026,12
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	22.765.026,12
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	46.358.043,65	10,18%	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%	45.530.052,24
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	7.558.996,76	1,66%	0,00%	2,00%	10,00%	37.971.055,48
Total Exterior	10,00%	7.558.996,76	1,66%	0,00%	2,50%	20,00%	

[Handwritten signatures and initials]



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI...	175.436.425,87	38,53	-
BANCO BTG PACTUAL	90.726.365,19	19,93	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.024.089,35	13,62	-
NOVUS CAPITAL	41.807.789,39	9,18	-
CAIXA DTVM	29.836.637,95	6,55	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	17.148.644,53	3,77	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	14.885.549,70	3,27	-
BRADERCO ASSET MANAGEMENT	14.399.837,67	3,16	-
TARPON INVESTIMENTOS	5.000.000,00	1,10	-
ICATU VANGUARDA	4.035.182,72	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 Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	175.436.425,87	38,53	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	75.478.905,32	16,58	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	59.741.785,58	13,12	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	2,00

[Handwritten signatures and initials]



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,29%	8,97%	2,05%	4,08%	11,42%	21,35%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	8,79%	2,06%	4,24%	11,36%	20,79%	0,74%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,93%	10,06%	3,18%	6,50%	13,54%	24,68%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	9,81%	3,11%	6,35%	13,19%	24,03%	0,06%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,11%	8,75%	1,65%	4,25%	11,41%	21,41%	0,99%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,95%	10,79%	-0,52%	6,55%	11,05%	19,09%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,13%	10,65%	-0,74%	6,40%	10,68%	18,20%	2,57%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,97%	10,56%	-0,64%	6,42%	10,75%	18,44%	2,52%	0,05%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,96%	10,58%	-0,57%	6,43%	10,77%	18,51%	2,53%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	0,17%	11,62%	1,83%	7,45%	13,57%	22,67%	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	11,40%	1,75%	7,30%	13,26%	22,03%	1,13%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,75%	11,73%	3,71%	8,44%	13,09%	34,58%	0,30%	0,02%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,02%	10,15%	3,42%	6,85%	13,67%	26,52%	0,02%	0,00%

[Handwritten signatures and initials]



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,90%	9,12%	2,96%	5,95%	12,33%	23,32%	0,01%	0,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,31%	3,54%	6,88%	13,98%	27,19%	0,03%	0,00%
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	10,23%	3,54%	6,91%	13,89%	27,22%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,26%	3,50%	0,61%	1,38%	5,19%	12,73%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,40%	10,36%	1,94%	6,89%	12,82%	23,47%	0,60%	0,01%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,30%	11,35%	0,97%	6,94%	10,76%	22,65%	1,61%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,58%	-	-1,90%	-	-	-	3,59%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,45%	10,01%	2,08%	6,48%	12,18%	23,72%	0,54%	0,01%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,97%	9,93%	3,22%	6,47%	13,44%	25,80%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,54%	9,14%	2,50%	5,86%	11,05%	26,81%	0,39%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,90%	8,06%	1,93%	7,76%	9,73%	20,93%	2,15%	0,06%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,86%	9,52%	2,78%	6,24%	12,70%	26,54%	0,12%	0,00%

Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-3,58%	16,05%	1,32%	7,00%	20,13%	-7,28%	4,97%	0,22%

Ibovespa (Benchmark)	0,71%	6,22%	-1,29%	14,41%	5,93%	5,03%	-	-
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	7,66%	39,29%	11,58%	45,55%	32,33%	58,35%	8,10%	0,22%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,13%	8,89%	1,73%	4,32%	11,65%	21,97%	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	-0,07%	13,43%	0,89%	8,50%	19,88%	26,93%	3,11%	0,07%

MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-3,42%	6,46%	0,14%	2,32%	9,66%	-12,05%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,36%	8,63%	1,38%	5,25%	14,63%	-9,67%	5,58%	0,20%

2

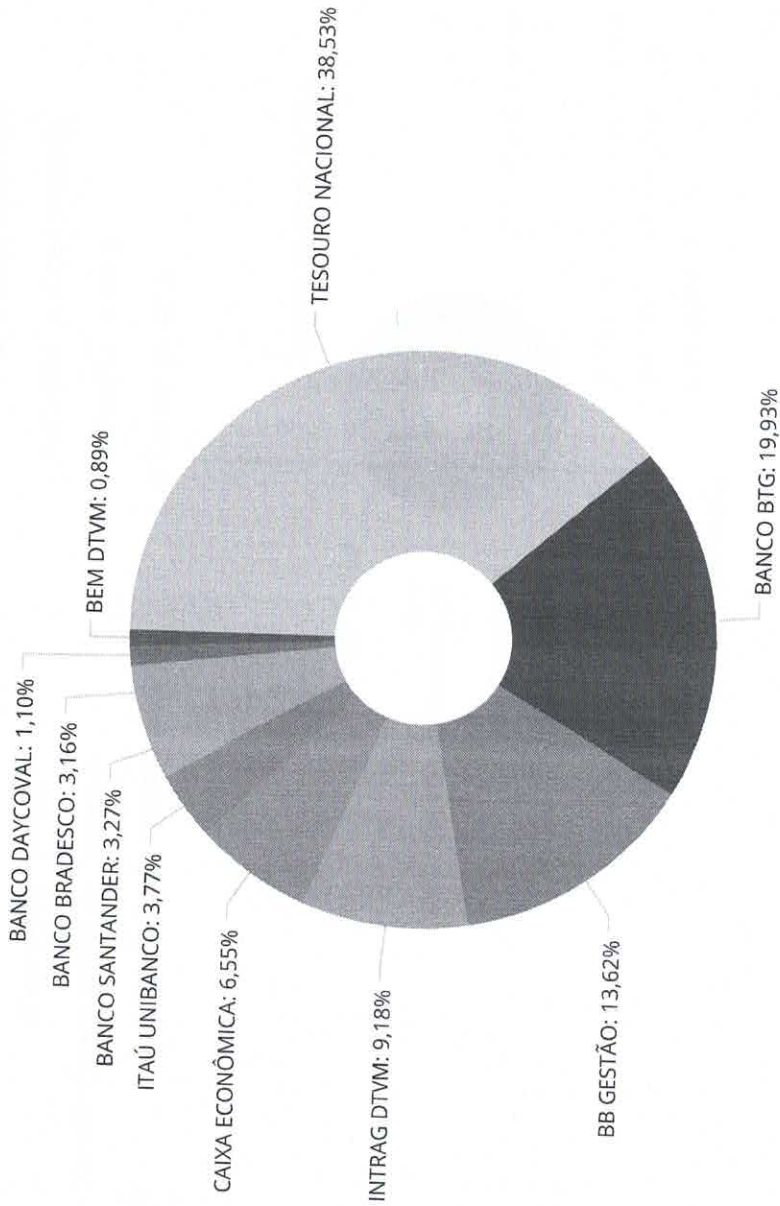


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-3,42%	6,46%	0,14%	2,32%	9,68%	-12,05%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,36%	8,63%	1,38%	5,25%	14,63%	-9,67%	5,58%	20,255%
Global BDRX (Benchmark)	-3,46%	17,23%	1,81%	7,82%	21,85%	-5,29%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,00%	2,72%	3,43%	5,44%	9,64%	-5,49%	4,96%	19,288%
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,57%	16,05%	1,32%	7,00%	20,13%	-7,28%	4,97%	22,223%



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

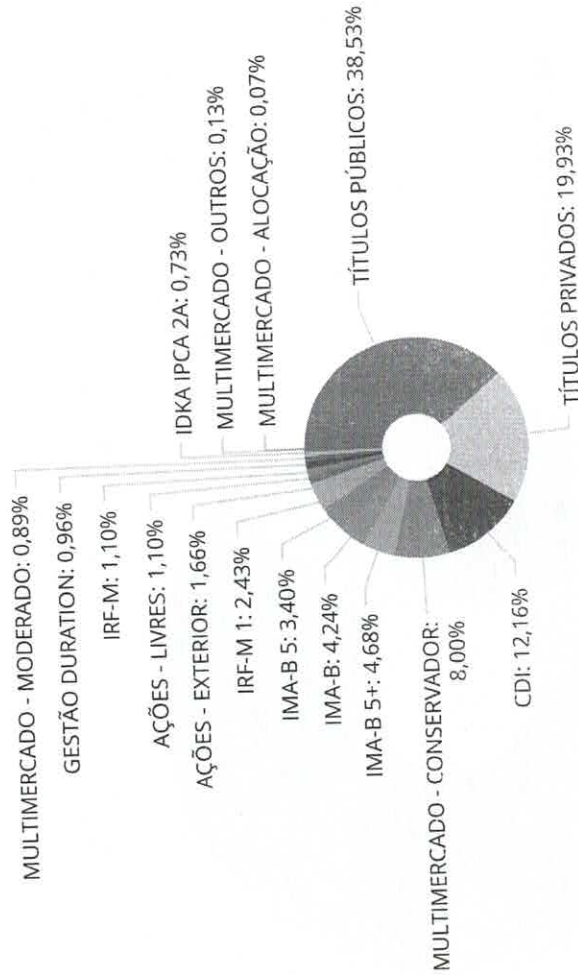


Administrador	Valor
TESOURO NACIONAL	175.436.425,87
BANCO BTG	90.726.365,19
BB GESTÃO	62.024.089,35
INTRAG DTVM	41.807.789,39
CAIXA ECONÔMICA	29.836.637,95
ITAÚ UNIBANCO	17.148.644,53
BANCO SANTANDER	14.885.549,70
BANCO BRADESCO	14.399.837,67
BANCO DAYCOVAL	5.000.000,00
BEM DTVM	4.035.182,72

(Handwritten signatures and initials)



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	175.436.425,87	■ TÍTULOS PRIVADOS	90.726.365,19	■ CDI	55.370.060,61
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	36.422.564,75	■ IMA-B 5+	21.310.150,29	■ IMA-B	19.301.465,06
■ IMA-B 5	15.472.144,03	■ IRF-M 1	11.076.193,74	■ AÇÕES - EXTERIOR	7.558.996,76
■ AÇÕES - LIVRES	5.000.000,00	■ IRF-M	4.988.182,63	■ GESTÃO DURATION	4.390.330,64
■ MULTIMERCADO - MODERADO	4.035.182,72	■ IDKA IPCA 2A	3.312.163,90	■ MULTIMERCADO - OUTROS	595.849,66
■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	304.446,52				

[Handwritten signature]



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/09/2023

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 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	4.170,197974	79.996.678,20	82.207.112,66	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	04/11/2022	12.236	4.086,264032100	4.252,177918	49.999.526,70	52.029.649,00	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	03/03/2023	10.032	3.987,19898800	4.106,824583	39.999.580,25	41.199.664,21	Curva

[Handwritten signature]

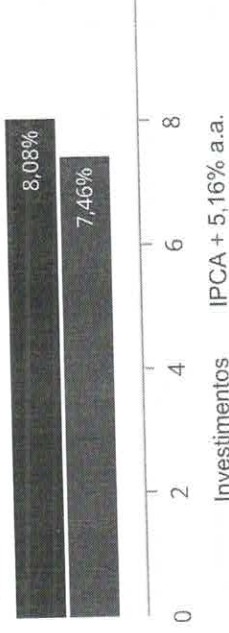


**CRÉDITO
& MERCADO**

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	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	19.523.274,38	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%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



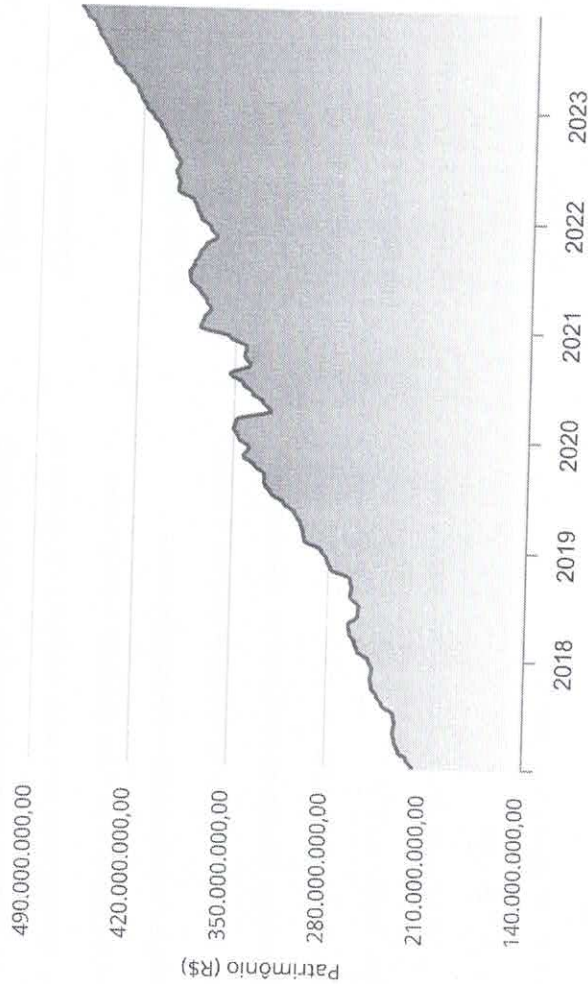
[Handwritten signatures and initials]



**CRÉDITO
& MERCADO**

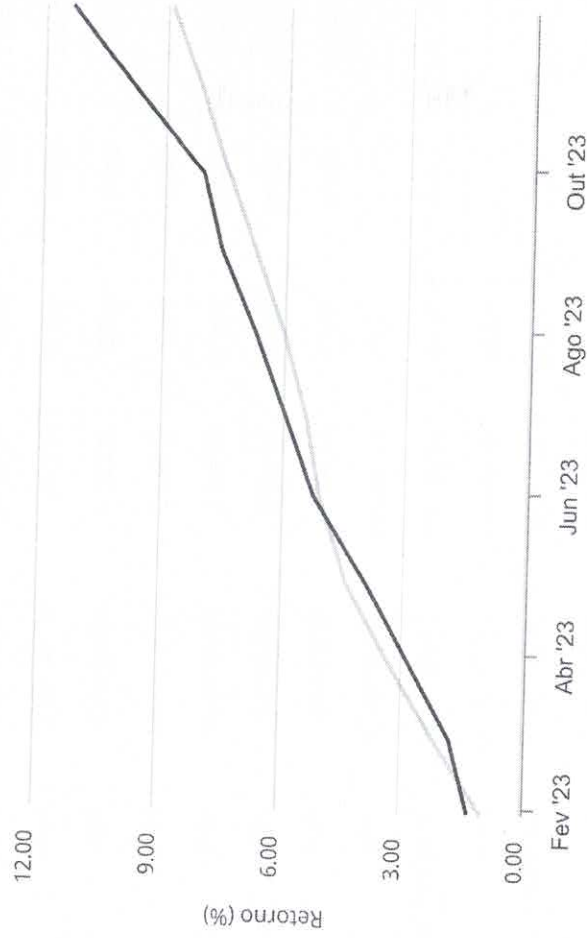
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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







**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.105.980,11	0,00	0,00	12.233.301,87	127.321,76	1,05%	1,05%	0,03%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.842.781,15	0,00	0,00	10.956.564,89	113.783,74	1,05%	1,05%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	10.976.947,17	0,00	0,00	11.076.193,74	99.246,57	0,90%	0,90%	0,06%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	5.345.227,81	0,00	0,00	5.385.224,64	39.996,83	0,75%	0,75%	0,30%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	36.095.799,64	0,00	15.000.000,00	21.363.610,15	267.810,51	0,74%	1,02%	0,02%
TÍTULOS PÚBLICOS	174.178.267,07	0,00	0,00	175.436.425,87	1.258.158,80	0,72%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	13.738.414,75	3.947.197,18	12.381.438,29	5.431.359,06	127.185,42	0,72%	0,90%	0,01%
LETRA FINANCEIRA BTG	90.139.334,71	0,00	0,00	90.726.365,19	587.030,48	0,65%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	924.272,06	0,00	0,00	928.452,19	4.180,13	0,45%	0,45%	0,54%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	513.407,77	0,00	0,00	515.481,07	2.073,30	0,40%	0,40%	0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.300.418,93	0,00	0,00	3.312.163,90	11.744,97	0,36%	0,36%	0,74%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.454.965,59	0,00	0,00	15.472.144,03	17.178,44	0,11%	0,11%	0,99%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	4.988.182,63	-11.817,37	-0,24%	0,14%	1,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.955.239,75	0,00	0,00	2.946.397,38	-8.842,37	-0,30%	-0,30%	1,61%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.019.144,57	0,00	0,00	5.960.825,21	-58.319,36	-0,97%	-0,97%	2,52%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	0,00	10.000.000,00	0,00	9.897.367,07	-102.632,93	-1,03%	-0,96%	2,53%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.482.746,69	0,00	0,00	3.443.272,78	-39.473,91	-1,13%	-1,13%	2,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	21.652.836,50	0,00	0,00	21.310.150,29	-342.686,21	-1,58%	-1,58%	3,59%
Total Renda Fixa	407.725.784,27	18.947.197,18	27.381.438,29	401.383.481,96	2.091.938,80	0,51%		1,17%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	301.721,86	0,00	0,00	304.446,52	2.724,66	0,90%	0,90%	2,15%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.035.182,72	35.182,72	0,88%	-0,07%	3,11%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	590.793,72	0,00	0,00	595.849,66	5.055,94	0,86%	0,86%	0,12%
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	36.225.681,84	0,00	0,00	36.422.564,75	196.882,91	0,54%	0,54%	0,39%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00%	7,65%	8,10%
Total Renda Variável	37.118.197,42	9.000.000,00	0,00	46.358.043,65	239.846,23	0,52%		1,46%

2



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/09/2023

FUNDOS EXTERIOR

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

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAU FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.988.869,74	0,00	0,00	1.968.945,28	-19.924,46	-1,00%	-1,00%	4,96%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.869.928,13	0,00	0,00	2.773.417,02	-96.511,11	-3,36%	-3,36%	5,58%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.921.058,96	0,00	0,00	2.816.634,46	-104.424,50	-3,57%	-3,57%	4,97%
Total Exterior	7.779.856,83	0,00	0,00	7.558.996,76	-220.860,07	-2,84%		5,19%



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/09/2023

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2023

Ativos Renda Fixa		Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS		175.857.600,24	0,00	3.900.562,79	175.436.425,87	3.479.388,42	1,98%	-
LETRA FINANCEIRA BTG		88.854.375,34	0,00	0,00	90.726.365,19	1.871.989,85	2,11%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA		35.257.236,20	0,00	15.000.000,00	21.363.610,15	1.106.373,95	3,14%	3,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI		11.814.698,21	0,00	0,00	12.233.301,87	418.603,66	3,54%	3,54%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI		10.581.907,56	0,00	0,00	10.956.564,89	374.657,33	3,54%	3,54%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO		8.259.374,71	14.743.866,90	17.922.760,14	5.431.359,06	350.877,59	1,53%	2,96%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...		10.742.111,24	0,00	0,00	11.076.193,74	334.082,50	3,11%	3,11%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		15.221.087,09	0,00	0,00	15.472.144,03	251.056,94	1,65%	1,65%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP		5.192.696,11	0,00	0,00	5.385.224,64	192.528,53	3,71%	3,71%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...		3.245.323,03	0,00	0,00	3.312.163,90	66.840,87	2,06%	2,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...		2.918.129,78	0,00	0,00	2.946.397,38	28.267,60	0,97%	0,97%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP		909.510,40	0,00	0,00	928.452,19	18.941,79	2,08%	2,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA		505.674,13	0,00	0,00	515.481,07	9.806,94	1,94%	1,94%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		0,00	5.000.000,00	0,00	4.988.182,63	-11.817,37	-0,24%	1,75%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA		3.468.816,18	0,00	0,00	3.443.272,78	-25.543,40	-0,74%	-0,74%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...		5.999.400,60	0,00	0,00	5.960.825,21	-38.575,39	-0,64%	-0,64%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP		0,00	10.000.000,00	0,00	9.897.367,07	-102.632,93	-1,03%	-0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...		21.722.303,34	0,00	0,00	21.310.150,29	-412.153,05	-1,90%	-1,90%
Total Renda Fixa		400.550.244,16	29.743.866,90	36.823.322,93	401.383.481,96	7.912.693,83	1,84%	

22



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	35.533.687,73	0,00	0,00	36.422.564,75	888.877,02	2,50%	2,50%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	0,00	4.000.000,00	0,00	4.035.182,72	35.182,72	0,88%	0,89%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	579.758,09	0,00	0,00	595.849,66	16.091,57	2,78%	2,78%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	298.677,36	0,00	0,00	304.446,52	5.769,16	1,93%	1,93%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00%	11,58%
Total Renda Variável	36.412.123,18	9.000.000,00	0,00	46.358.043,65	945.920,47	2,08%	

m.



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2023

		FUNDOS EXTERIOR						
	Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insfit
	ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.903.709,03	0,00	0,00	1.968.945,28	65.236,25	3,43%	3,43%
	BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.735.718,89	0,00	0,00	2.773.417,02	37.698,13	1,38%	1,38%
	CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.779.818,52	0,00	0,00	2.816.634,46	36.815,94	1,32%	1,32%
	Total Exterior	7.419.246,44	0,00	0,00	7.558.996,76	139.750,32	1,88%	

[Handwritten signature]



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.