

# **RELATORIO DE INVESTIMENTOS**

## **OUTUBRO 2023**

Handwritten signatures in blue ink, including a large stylized signature and a smaller one to its right.



## **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 OUT/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 outubro de 2023, em reunião realizada em 28 de novembro de 2023.

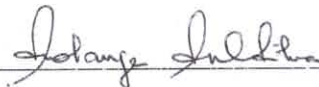
Rosana Teixeira de Carvalho



Lisete de Fátima Oliveira



Solange Siqueira Duarte Silva



Mauracy Moraes de Oliveira

















CRÉDITO  
& MERCADO

# Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2023



CRÉDITO  
& MERCADO

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			265.530.796,35	57,51%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	15.422.016,74	3,34%	785	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.920.654,61	1,28%	640	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FIC RENDA FIXA P...	D+0	49444	21.142.025,50	4,58%	44	3,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	516.804,04	0,11%	791	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.940.268,39	0,64%	214	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.830.335,82	2,13%	109	2,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.005.976,99	1,08%	26	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	260.167,68	0,06%	1.000	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	40.332.123,64	8,74%	1.125	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.424.048,40	0,74%	99	0,68%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.072.088,04	2,40%	418	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	931.683,17	0,20%	119	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	12.363.236,05	2,68%	386	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
NOVUS INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA LP	D+4 du	Não há	5.422.931,47	1,17%	95	1,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não se aplica	7.786.602,35	1,69%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.697.931,61	1,02%	58	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.727.389,37	0,59%	10.542	0,45%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.777.225,47	0,60%	473	0,14%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.943.022,35	0,42%	1.833	2,11%	Artigo 9º, Inciso III

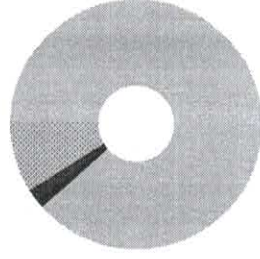


Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	600.930,07	0,13%	2.785	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	304.020,84	0,07%	5.335	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERC...	D+32	Não há	3.981.816,97	0,86%	713	1,33%	Artigo 10º, Inciso I
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	36.739.464,35	7,96%	15.283	9,78%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>461.673.560,27</b>				

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

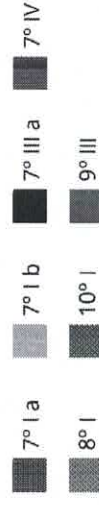
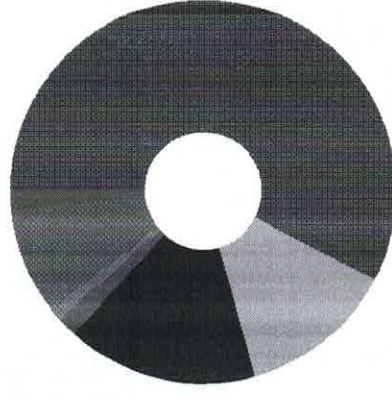
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a'	100,00%	265.530.796,35	57,51%	20,00%	37,00%	60,00%	11.473.339,81
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	100,00%	60.778.082,09	13,16%	5,00%	10,00%	60,00%	216.226.054,07
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	46.167.356,03
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	60,00%	73.806.278,45	15,99%	0,00%	18,00%	60,00%	203.197.857,71
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	9.233.471,21
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	7.786.602,35	1,69%	20,00%	20,00%	20,00%	84.548.109,70
Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	23.083.678,01
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>407.901.759,24</b>	<b>88,35%</b>	<b>45,00%</b>	<b>86,00%</b>	<b>217,00%</b>	



RENDA FIXA 407.901.759,24  
 RENDA VARIÁVEL 4.697.931,61  
 EXTERIOR 7.447.637,19  
 ESTRUTURADOS 41.626.232,23

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	4.697.931,61	1,02%	0,00%	8,00%	30,00%	133.804.136,47
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	46.167.356,03
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	41.626.232,23	9,02%	0,00%	2,00%	10,00%	4.541.123,80
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	23.083.678,01
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	23.083.678,01
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	46.324.163,84	10,03%	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%	46.167.356,03
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	7.447.637,19	1,61%	0,00%	2,00%	10,00%	38.719.718,84
Total Exterior	10,00%	7.447.637,19	1,61%	0,00%	2,50%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	265.530.796,35	57,51	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	85.804.377,54	18,59	-
NOVUS CAPITAL	42.162.395,82	9,13	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	17.246.526,79	3,74	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	14.836.312,81	3,21	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	14.496.136,44	3,14	-
BANCO BTG PACTUAL	7.786.602,35	1,69	-
CAIXA DTVM	5.130.663,59	1,11	-
TARPON INVESTIMENTOS	4.697.931,61	1,02	-
ICATU VANGUARDA	3.981.816,97	0,86	-

**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, Alinea 'a'	265.530.796,35	57,51	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	60.778.082,09	13,16	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	73.806.278,45	15,99	0,00	60,00

*[Handwritten signature]*



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/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	-0,31%	8,55%	0,43%	3,06%	9,21%	23,11%	-	-
	-0,32%	8,40%	0,37%	2,99%	8,99%	22,58%	1,43%	0,02%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>								
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,66%	10,06%	-1,97%	3,75%	8,97%	21,40%	-	-
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,68%	9,83%	-2,03%	3,63%	8,69%	20,81%	3,01%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,56%	10,03%	-2,07%	3,74%	8,77%	20,74%	3,05%	0,05%
	-0,67%	9,82%	-2,03%	3,63%	8,70%	20,76%	3,00%	0,05%

<b>IRF-M (Benchmark)</b>								
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,37%	12,04%	1,31%	6,68%	12,95%	26,45%	-	-
	0,36%	11,80%	1,23%	6,52%	12,66%	25,69%	1,78%	0,03%

<b>CDI (Benchmark)</b>								
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,70%	12,51%	3,01%	9,11%	13,01%	35,00%	1,20%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	10,95%	3,15%	6,60%	13,35%	26,71%	0,01%	0,00%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,90%	10,10%	2,88%	6,02%	12,28%	23,94%	0,01%	0,00%
ITAJÁ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	11,47%	3,41%	7,05%	13,96%	27,79%	0,02%	0,00%
	1,06%	11,40%	3,45%	7,09%	13,86%	27,84%	0,04%	0,00%

<b>IPCA (Benchmark)</b>								
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	3,75%	0,73%	1,00%	4,82%	11,60%	-	-
	-0,79%	-	-3,01%	-	-	-	3,93%	-



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASILEIRA FIC RENDA FIXA LP	0,35%	10,39%	1,43%	5,91%	11,49%	24,07%	0,82%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,26%	10,64%	1,30%	6,24%	12,00%	24,61%	0,90%	0,02%
ITÁÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,21%	11,12%	-0,14%	5,42%	9,56%	22,83%	2,29%	0,04%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,00%	11,02%	3,14%	6,55%	13,42%	26,45%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,87%	10,09%	2,38%	6,33%	10,79%	27,64%	0,63%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,14%	7,91%	0,15%	6,53%	7,12%	22,57%	2,27%	0,05%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,85%	10,45%	2,63%	6,34%	12,57%	26,96%	0,14%	0,00%

Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	0,21%

Ibovespa (Benchmark)	-2,94%	3,11%	-7,22%	8,34%	-2,49%	9,32%	-	-
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-6,04%	30,87%	-1,01%	30,79%	11,88%	52,69%	9,41%	0,21%

IMA-B 5 (Benchmark)	-0,31%	8,55%	0,43%	3,06%	9,21%	23,11%	-	-
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCADO	-1,32%	11,93%	-2,39%	6,11%	12,93%	31,77%	3,47%	0,06%

MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-1,47%	4,89%	-2,99%	1,32%	3,00%	-21,94%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,66%	6,83%	-2,37%	4,15%	8,05%	-19,65%	7,88%	0,19%



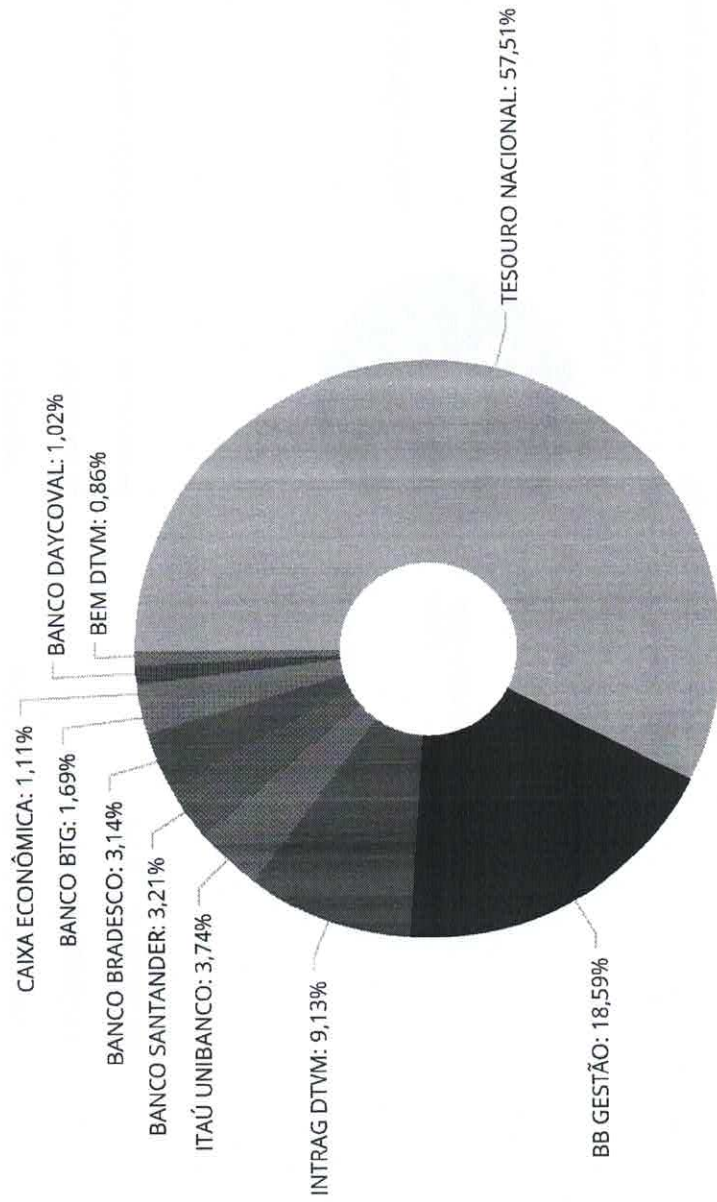
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-1,47%	4,89%	-2,99%	1,32%	3,00%	-21,94%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,66%	6,83%	-2,37%	4,15%	8,05%	-19,65%	7,88%	19,091%

Global BDRX (Benchmark)	-1,57%	15,39%	-1,87%	6,65%	18,36%	-16,13%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,32%	1,37%	0,25%	2,48%	1,65%	-15,01%	6,94%	17,719%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-1,40%	14,42%	-2,16%	6,20%	16,47%	-17,58%	7,82%	20,681%



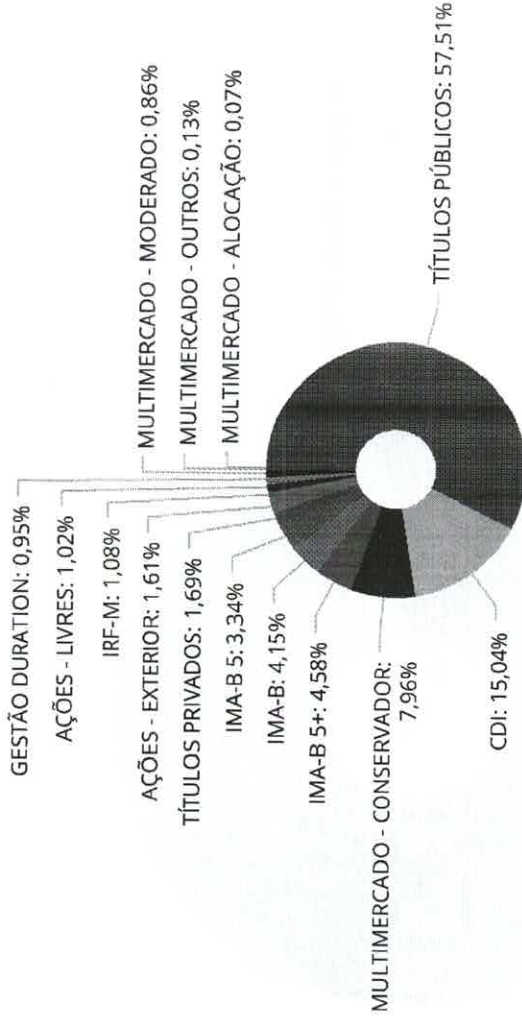
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Outubro / 2023)



Administrador	Valor
TESOIRO NACIONAL	265.530.796,35
BB GESTÃO	85.804.377,54
INTRAG DTVM	42.162.395,82
ITAÚ UNIBANCO	17.246.526,79
BANCO SANTANDER	14.836.312,81
BANCO BRADESCO	14.496.136,44
BANCO BTG	7.786.602,35
CAIXA ECONÔMICA	5.130.663,59
BANCO DAYCOVAL	4.697.931,61
BEM DTVM	3.981.816,97



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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	265.530.796,35	■ CDI	69.450.546,88	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	36.739.464,35
■ IMA-B 5+	21.142.025,50	■ IMA-B	19.175.038,83	■ IMA-B 5	15.422.016,74
■ TÍTULOS PRIVADOS	7.786.602,35	■ AÇÕES - EXTERIOR	7.447.637,19	■ IRF-M	5.005.976,99
■ AÇÕES - LIVRES	4.697.931,61	■ GESTÃO DURATION	4.388.755,60	■ MULTIMERCADO - MODERADO	3.981.816,97
■ MULTIMERCADO - OUTROS	600.930,07	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	304.020,84		



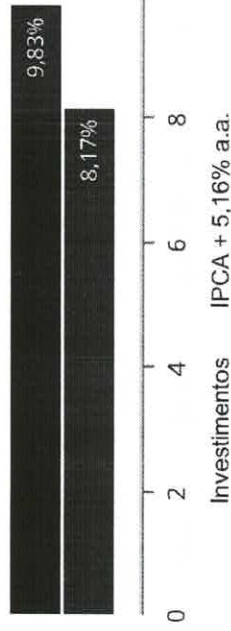
**CRÉDITO  
& MERCADO**

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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
LFT - Letra Financeira do Tesouro	01/09/2029	31/10/2023	1.404	13.876,26892500	13.873,858488	19.482.281,57	19.478.897,32	Mercado
LFT - Letra Financeira do Tesouro	01/09/2029	27/10/2023	5.000	13.862,97508900	13.873,858488	69.314.875,45	69.369.292,44	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	30/06/2022	19.713	4058,06717400	4.201,347469	79.996.678,20	82.821.162,65	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	04/11/2022	12.236	4.086,264032100	4.282,324352	49.999.526,70	52.398.520,77	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	03/03/2023	10.032	3.987,19898800	4.138,153501	39.999.580,25	41.513.955,92	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%	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	0,97%	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%	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%	111,58%	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%	31.554.919,75	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%	33.630.500,87	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%	40.930.472,94	0,66%	8,17%	120,38%	1,73%

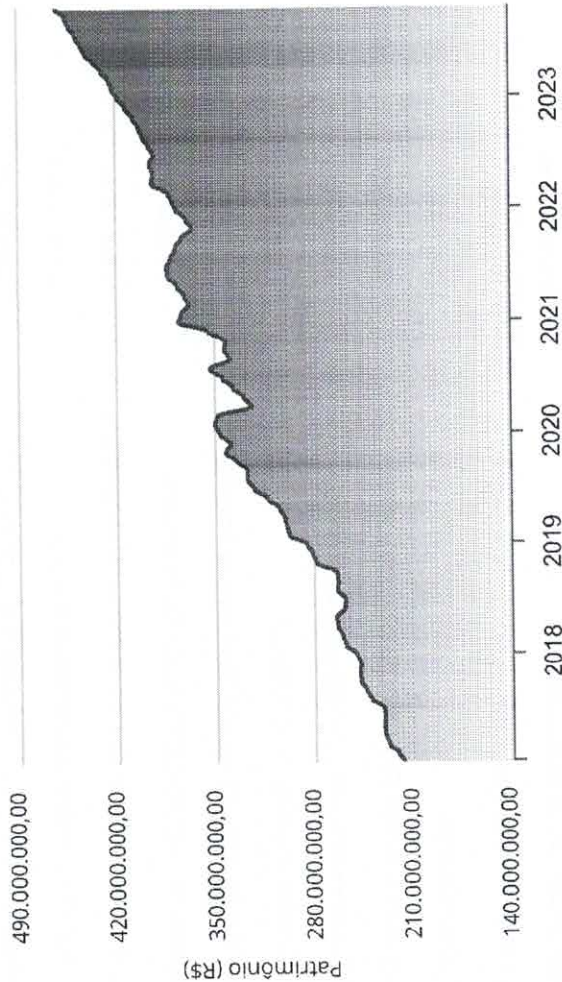
**Investimentos x Meta de Rentabilidade**





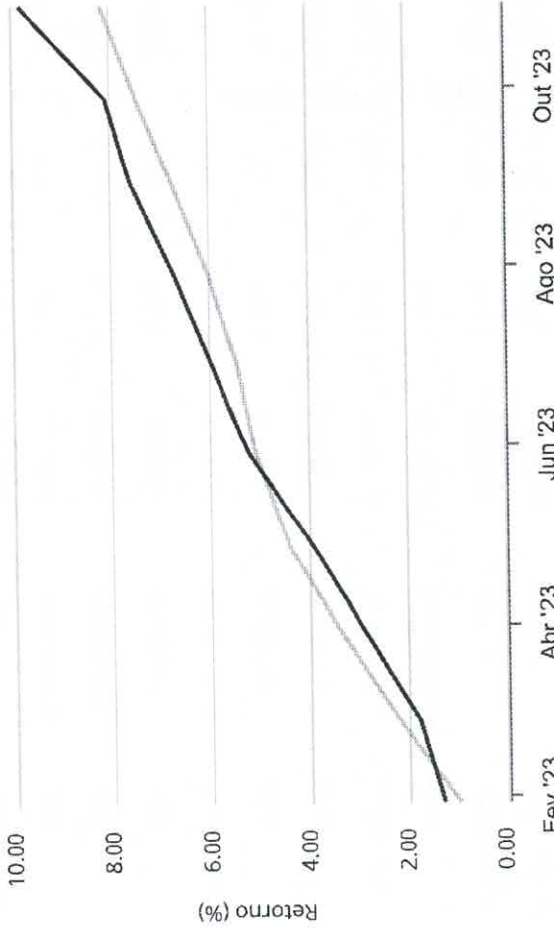
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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



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

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insttit	Var - Mês
LETRA FINANCEIRA BTG	90.726.365,19	0,00	88.806.903,36	7.786.602,35	5.867.140,52	6,47%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.233.301,87	0,00	0,00	12.363.236,05	129.934,18	1,06%	1,06%	0,04%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.956.564,89	0,00	0,00	11.072.088,04	115.523,15	1,05%	1,05%	0,02%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	5.385.224,64	0,00	0,00	5.422.931,47	37.706,83	0,70%	0,70%	1,20%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	21.363.610,15	0,00	21.501.170,69	0,00	137.560,54	0,64%	0,99%	0,03%
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%	0,92%	0,12%
TÍTULOS PÚBLICOS	175.436.425,87	88.797.157,01	0,00	265.530.796,35	1.297.213,47	0,49%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.431.359,06	2.359.199,33	7.565.956,77	260.167,68	35.566,06	0,46%	0,90%	0,01%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.988.182,63	0,00	0,00	5.005.976,99	17.794,36	0,36%	0,36%	1,78%
CAIXA BRASILATIVA FIC RENDA FIXA LP	928.452,19	0,00	0,00	931.683,17	3.230,98	0,35%	0,35%	0,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	41.840.743,01	1.644.963,60	40.332.123,64	136.344,23	0,33%	0,99%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	515.481,07	0,00	0,00	516.804,04	1.322,97	0,26%	0,26%	0,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.946.397,38	0,00	0,00	2.940.268,39	-6.128,99	-0,21%	-0,21%	2,29%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.472.144,03	0,00	0,00	15.422.016,74	-50.127,29	-0,32%	-0,32%	1,43%
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%	-0,29%	1,24%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.443.272,78	0,00	0,00	3.424.048,40	-19.224,38	-0,56%	-0,56%	3,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.960.825,21	0,00	0,00	5.920.654,61	-40.170,60	-0,67%	-0,67%	3,00%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	9.897.367,07	0,00	0,00	9.830.335,82	-67.031,25	-0,68%	-0,68%	3,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	21.310.150,29	0,00	0,00	21.142.025,50	-168.124,79	-0,79%	-0,79%	3,93%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>401.383.481,96</b>	<b>132.997.099,35</b>	<b>133.963.038,42</b>	<b>407.901.759,24</b>	<b>7.484.216,35</b>	<b>1,86%</b>		<b>1,39%</b>



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insitit	Var - Mês
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	36.422.564,75	0,00	0,00	36.739.464,35	316.899,60	0,87%	0,87%	0,63%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	595.849,66	0,00	0,00	600.930,07	5.080,41	0,85%	0,85%	0,14%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	304.446,52	0,00	0,00	304.020,84	-425,68	-0,14%	-0,14%	2,27%
ICATU VANGUARDA IGARATÉ LONG BIASED FI MULTIMERCAD...	4.035.182,72	0,00	0,00	3.981.816,97	-53.365,75	-1,32%	-1,32%	3,47%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	5.000.000,00	0,00	0,00	4.697.931,61	-302.068,39	-6,04%	-6,04%	9,41%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>46.358.043,65</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>46.324.163,84</b>	<b>-33.879,81</b>	<b>-0,07%</b>		<b>1,77%</b>



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

**FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.968.945,28	0,00	0,00	1.943.022,35	-25.922,93	-1,32%	-1,32%	6,94%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.816.634,46	0,00	0,00	2.777.225,47	-39.408,99	-1,40%	-1,40%	7,82%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.773.417,02	0,00	0,00	2.727.389,37	-46.027,65	-1,66%	-1,66%	7,88%
<b>Total Exterior</b>	<b>7.558.996,76</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>7.447.637,19</b>	<b>-111.359,57</b>	<b>-1,47%</b>		<b>7,61%</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.





