

RELATORIO DE INVESTIMENTOS

JUNHO 2023

2º. Trimestre – 1º. Semestre



SUMÁRIO

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

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.

1. 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 jun/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.

2. 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 junho de 2023, em reunião realizada em 25 de julho de 2022.

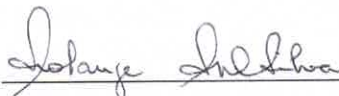
Rosana Teixeira de Carvalho



Lisete de Fátima Oliveira



Solange Siqueira Duarte Silva



Mauracy Moraes de Oliveira



**CRÉDITO
& MERCADO**

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2023

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



Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			175.857.600,24	39,57%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	15.221.087,09	3,43%	783	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.999.400,60	1,35%	572	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IFR-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	10.742.111,24	2,42%	1.136	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P...	D+0	49444	21.722.303,34	4,89%	42	3,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	505.674,13	0,11%	773	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.245.323,03	0,73%	901	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.259.374,71	1,86%	980	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.468.816,18	0,78%	82	0,91%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.581.907,56	2,38%	360	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	909.510,40	0,20%	118	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	35.257.236,20	7,93%	416	0,58%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.918.129,78	0,66%	208	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.814.698,21	2,66%	379	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	D+4 du	Não há	5.192.696,11	1,17%	42	1,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info	Não possui	88.854.375,34	20,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	D+5	Não há	2.735.718,89	0,62%	11.624	0,42%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	D+4	Não há	2.779.818,52	0,63%	491	0,14%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NIVEL I	D+3	Não há	1.903.709,03	0,43%	2.070	1,90%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	579.758,09	0,13%	3.078	0,04%	Artigo 10º, Inciso I



CRÉDITO & MERCADO

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/06/2023

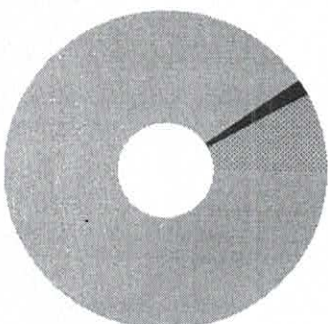
Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	298.677,36	0,07%	5.795	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	35.533.687,73	8,00%	15.619	8,75%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			444.381.613,78				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	175.857.600,24	39,57%	20,00%	37,00%	60,00%	90.771.368,03
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	57.435.899,43	12,92%	5,00%	10,00%	60,00%	209.193.068,84
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	44.438.161,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	78.402.369,15	17,64%	0,00%	18,00%	60,00%	188.226.599,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	8.887.632,28
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	88.854.375,34	20,00%	20,00%	20,00%	20,00%	21.947,42
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	22.219.080,69
Total Renda Fixa	100,00%	400.550.244,16	90,14%	45,00%	86,00%	217,00%	



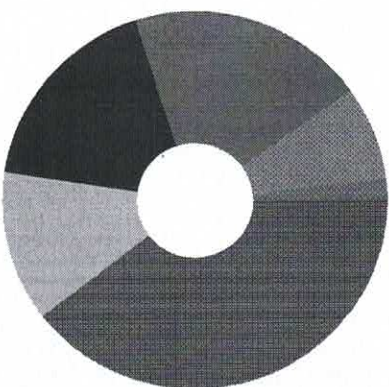
RENDA FIXA 400.550.244,16 EXTERIOR 7.419,246
 ESTRUTURADOS 36.412.123,18



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 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%	133.314.484,13
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	44.438.161,38
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	36.412.123,18	8,19%	0,00%	2,00%	10,00%	8.026.038,20
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	22.219.080,69
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	22.219.080,69
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	36.412.123,18	8,19%	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%	0,50%		10,00%	44.438.161,38
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	7.419.246,44	1,67%	0,00%	2,00%	10,00%	37.018.914,94
Total Exterior	10,00%	7.419.246,44	1,67%	0,00%	2,50%	20,00%	



- 7º Ia
- 7º Ib
- 7º III a
- 7º IV
- 10º I
- 9º III

(Handwritten signatures)



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...)	175.857.600,24	39,57	-
BANCO BTG PACTUAL	88.854.375,34	20,00	0,06
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	64.679.995,87	14,56	-
CAIXA DTVM	43.575.997,73	9,81	-
NOVUS CAPITAL	40.726.383,84	9,16	1,22
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	14.050.723,74	3,16	0,00
ITAU UNIBANCO	13.718.407,24	3,09	0,00
ITAU ASSET MANAGEMENT	2.918.129,78	0,66	-

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, Alínea 'a'	175.857.600,24	39,57	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	57.435.899,43	12,92	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	78.402.369,15	17,64	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea '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	7.419.246,44	1,67	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	36.412.123,18	8,19	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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)								
	0,97%	6,79%	1,99%	6,79%	9,28%	20,32%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP								
	1,04%	6,60%	2,14%	6,60%	9,23%	19,78%	0,83%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)								
	1,19%	6,68%	3,22%	6,68%	13,82%	22,00%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO								
	1,16%	6,49%	3,14%	6,49%	13,48%	21,33%	0,10%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)								
	1,05%	7,04%	2,55%	7,04%	10,23%	21,32%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP								
	1,03%	6,99%	2,56%	6,99%	10,05%	20,76%	0,90%	0,02%
IMA-B (Benchmark)								
	2,39%	11,37%	7,10%	11,37%	13,52%	17,81%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO								
	2,37%	11,28%	7,11%	11,28%	13,29%	17,23%	2,15%	0,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA								
	2,38%	11,47%	7,19%	11,47%	13,33%	16,94%	2,19%	0,05%
CDI (Benchmark)								
	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP								
	2,53%	7,74%	4,56%	7,74%	15,30%	-	0,98%	0,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA								
	1,16%	6,50%	3,32%	6,50%	13,62%	24,11%	0,03%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO								
	1,00%	5,98%	2,90%	5,98%	12,44%	20,85%	0,01%	0,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI								
	1,13%	6,53%	3,22%	6,53%	13,88%	24,53%	0,02%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI								
	1,17%	6,46%	3,25%	6,46%	13,73%	24,70%	0,03%	0,00%



Retorno dos Investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	-0,08%	2,87%	0,76%	2,87%	3,16%	15,42%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,14%	-	-	-	-	-	2,85%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,69%	7,76%	4,31%	7,76%	13,75%	19,35%	0,56%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,11%	8,26%	4,86%	8,26%	14,59%	18,86%	0,90%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,22%	10,28%	5,91%	10,28%	12,95%	23,06%	1,33%	0,04%



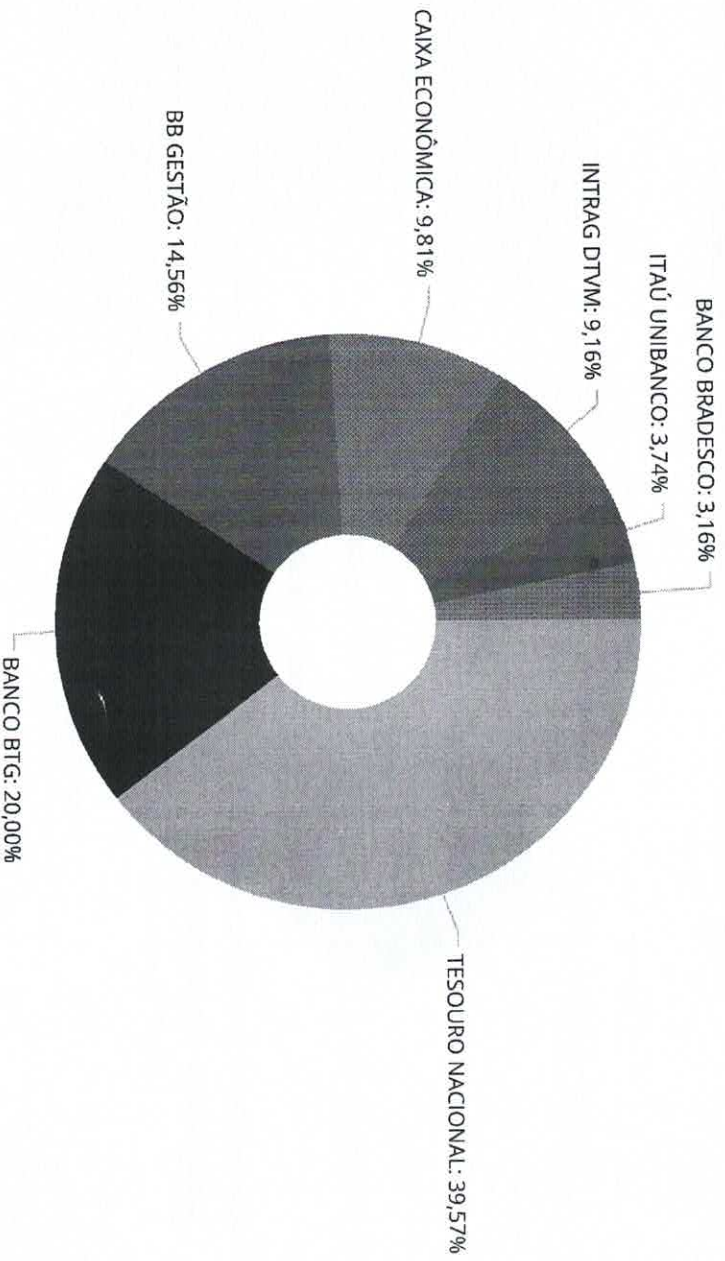
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,07%	6,50%	3,15%	6,50%	13,54%	23,37%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,64%	6,01%	5,71%	6,01%	14,89%	15,14%	2,12%	0,05%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,22%	6,56%	3,37%	6,56%	13,54%	24,64%	0,21%	0,01%
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1,38%	6,48%	3,27%	6,48%	12,89%	22,44%	0,61%	0,02%
Global BDRX (Benchmark)	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	0,47%	14,53%	5,60%	14,53%	13,40%	-1,43%	6,60%	0,17%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	0,56%	6,31%	2,18%	6,31%	7,04%	-4,52%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIAÇÕES BDR NIVEL I	1,38%	7,15%	3,82%	7,15%	9,33%	-2,81%	6,71%	0,15%

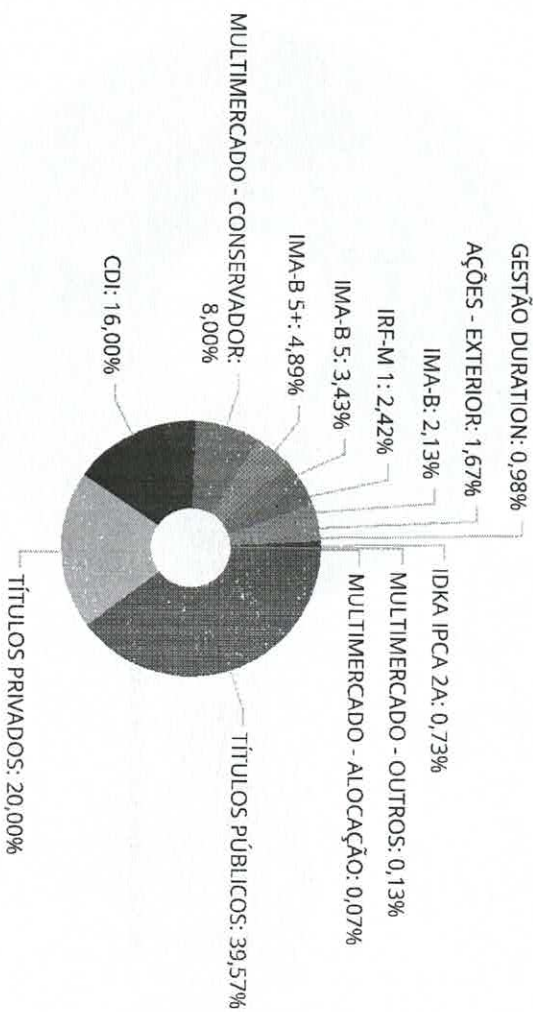


Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)								
	0,56%	6,31%	2,18%	6,31%	7,04%	-4,52%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I								
	1,38%	7,15%	3,82%	7,15%	9,33%	-2,81%	6,71%	15,065%
Global BDRX (Benchmark)								
	0,48%	15,14%	5,90%	15,14%	14,44%	0,60%	-	-
ITAU FIC AÇÕES BDR NÍVEL I								
	-1,11%	-0,68%	1,94%	-0,68%	1,21%	-0,16%	5,44%	13,146%
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I								
	0,47%	14,53%	5,60%	14,53%	13,40%	-1,43%	6,60%	16,781%



TESOURO NACIONAL	175.857.600,24
BANCO BTG	88.854.375,34
BB GESTÃO	64.679.995,87
CAIXA ECONÔMICA	43.575.997,73
INTRAG DTVM	40.726.383,84
ITAÚ UNIBANCO	16.636.537,02
BANCO BRADESCO	14.050.723,74



Sub-Segmento	Valor	Sub-Segmento	Valor	Sub-Segmento	Valor
■ TÍTULOS PÚBLICOS	175.857.600,24	■ TÍTULOS PRIVADOS	88.854.375,34	■ CDI	71.105.912,79
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	35.533.687,73	■ IM-A-B 5+	21.722.303,34	■ IM-A-B 5	15.221.087,09
■ IRE-M 1	10.742.111,24	■ IM-A-B	9.468.216,78	■ AÇÕES - EXTERIOR	7.419.246,44
■ GESTÃO DURATION	4.333.314,31	■ IDKA IPCA 2A	3.245.323,03	■ MULTIMERCADO - OUTROS	579.758,09
■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	298.677,36				



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

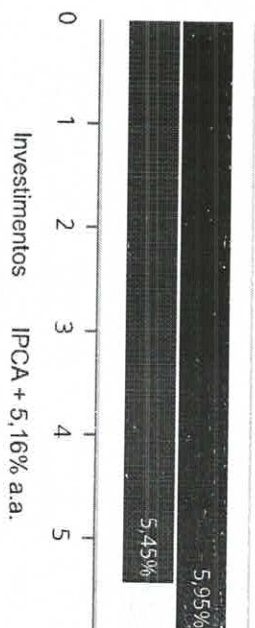
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	30/06/2022	19.713	4058,06717400	4.208,378814	79.996,678,20	82.959,771,56	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	04/11/2022	12.236	4.086,264032100	4.293,589417	49.999,526,70	52.536,360,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	03/03/2023	10.032	3.987,19898800	4.023,272386	39.999,580,25	40.361,468,57	Curva



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

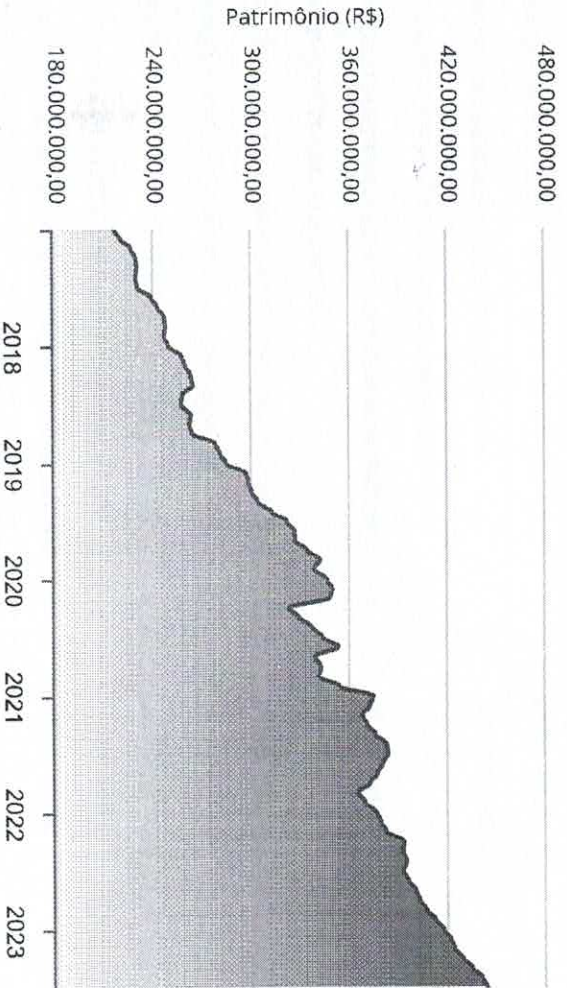
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VAR
Janeiro	415.684.852,33	516.807,90	2.125.592,86	419.457.860,72	5.381.793,35	5.381.793,35	1,29%	1,29%	0,97%	0,97%	133,12%	2,36%
Fevereiro	419.457.860,72	6.973.832,76	6.244.425,99	422.199.303,38	2.012.035,89	7.393.829,24	0,48%	1,78%	1,20%	2,19%	81,37%	1,97%
Março	422.199.303,38	100.645.059,58	100.069.417,00	427.389.027,57	4.614.081,61	12.007.910,85	1,09%	2,89%	1,17%	3,39%	85,35%	0,59%
Abril	427.389.027,57	3.349.467,29	3.231.633,53	431.714.954,77	4.208.093,44	16.216.004,29	0,98%	3,90%	0,97%	4,39%	88,88%	0,54%
Maior	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%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

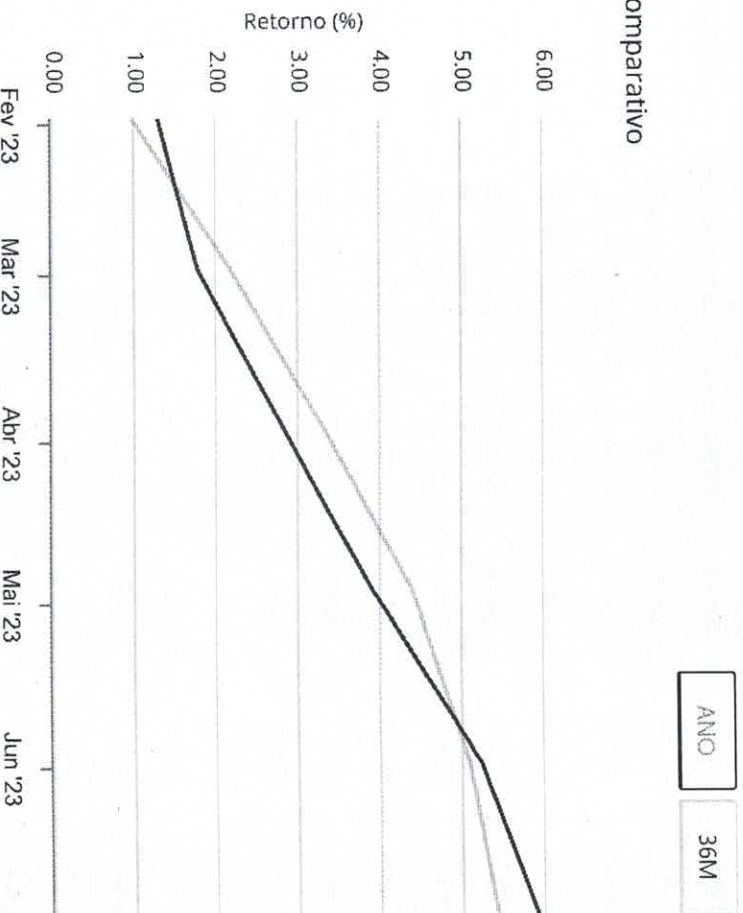




Evolução do Patrimônio



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



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/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...	21.061.435,43	0,00	0,00	21.722.303,34	660.867,91	3,14%	3,14%	2,85%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	5.064.706,07	0,00	0,00	5.192.696,11	127.990,04	2,53%	2,53%	0,98%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.388.218,56	0,00	0,00	3.468.816,18	80.597,62	2,38%	2,38%	2,19%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.860.388,76	0,00	0,00	5.999.400,60	139.011,84	2,37%	2,37%	2,15%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.854.640,00	0,00	0,00	2.918.129,78	63.489,78	2,22%	2,22%	1,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	495.250,20	0,00	0,00	505.674,13	10.423,93	2,10%	2,10%	0,50%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	894.433,12	0,00	0,00	909.510,40	15.077,28	1,69%	1,59%	0,53%
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.678.360,37	0,00	0,00	11.814.698,21	135.337,84	1,17%	1,17%	0,03%
BB IFR-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	10.619.080,73	0,00	0,00	10.742.111,24	123.030,51	1,16%	1,16%	0,10%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	34.853.965,42	0,00	0,00	35.257.236,20	403.270,78	1,16%	1,16%	0,03%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.463.414,19	0,00	0,00	10.581.907,56	118.493,37	1,13%	1,13%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.211.815,23	0,00	0,00	3.245.323,03	33.507,80	1,04%	1,04%	0,93%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.065.771,95	0,00	0,00	15.221.087,09	155.315,14	1,03%	1,03%	0,90%
LETRA FINANCEIRA BTG	88.101.600,50	0,00	0,00	88.854.375,34	752.774,84	0,85%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	22.873.732,70	4.682.324,80	19.469.365,48	8.259.374,71	-172.682,69	0,63%	1,00%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	176.230.149,35	0,00	0,00	175.857.600,24	-372.549,11	-0,21%	-	-
Total Renda Fixa	412.716.962,58	4.682.324,80	19.469.365,48	400.550.244,16	2.620.322,26	0,63%		0,82%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instt	Var - Mês
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	291.003,86	0,00	0,00	298.677,36	7.673,50	2,64%	2,64%	2,12%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	572.757,20	0,00	0,00	579.758,09	7.000,89	1,22%	1,22%	0,21%
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	20.174.311,68	15.000.000,00	0,00	35.533.687,73	359.376,05	1,02%	1,38%	0,61%
Total Renda Variável	21.038.072,74	15.000.000,00	0,00	36.412.123,18	374.050,44	1,04%		0,61%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	2.698.377,54	0,00	0,00	2.735.718,89	37.341,35	1,38%	1,38%	6,71%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	2.766.867,07	0,00	0,00	2.779.818,52	12.951,45	0,47%	0,47%	6,60%
ITAU FIC AÇÕES BDR NIVEL I	1.925.056,66	0,00	0,00	1.903.709,03	-21.347,63	-1,11%	-1,11%	5,44%
Total Exterior	7.390.301,27	0,00	0,00	7.419.246,44	28.945,17	0,39%		6,34%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	172.673.101,49	0,00	0,00	175.857.600,24	3.184.498,75	1,84%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	85.874.931,50	0,00	0,00	88.854.375,34	2.979.443,84	3,47%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	34.125.177,48	0,00	0,00	35.257.236,20	1.132.058,72	3,32%	3,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	20.778.323,71	0,00	21.722.303,34	943.979,63	4,54%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	45.225.410,05	13.422.299,37	51.280.862,28	8.259.374,71	892.527,57	1,52%	2,90%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.601.067,42	0,00	0,00	5.999.400,60	398.333,18	7,11%	7,11%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.841.605,76	0,00	0,00	15.221.087,09	379.481,33	2,56%	2,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.442.904,79	0,00	0,00	11.814.698,21	371.793,42	3,25%	3,25%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.251.437,58	0,00	0,00	10.581.907,56	330.469,98	3,22%	3,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	20.452.297,15	0,00	20.778.323,71	0,00	326.026,56	1,59%	3,22%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.236.204,71	0,00	0,00	3.468.816,18	232.611,47	7,19%	7,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	545.828,30	10.000.000,00	0,00	10.742.111,24	196.282,94	1,86%	3,14%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,00	5.002.539,40	0,00	5.192.696,11	190.156,71	3,80%	4,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.755.265,13	0,00	0,00	2.918.129,78	162.864,65	5,91%	5,91%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	5.807.471,82	0,00	5.000.000,00	909.510,40	102.038,58	1,76%	4,31%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.420.155,22	0,00	5.000.000,00	505.674,13	85.518,91	1,58%	4,86%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.177.461,67	0,00	0,00	3.245.323,03	67.861,36	2,14%	2,14%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Fixa	421.430.320,07	49.203.162,48	82.059.185,99	400.550.244,16	11.975.947,60	2,54%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,00	35.005.078,80	0,00	35.533.687,73	528.608,93	1,51%	3,27%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	560.854,84	0,00	0,00	579.758,09	18.903,25	3,37%	3,37%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	282.534,86	0,00	0,00	298.677,36	16.142,50	5,71%	5,71%
Total Renda Variável	843.389,70	35.005.078,80	0,00	36.412.123,18	563.654,68	1,57%	



CRÉDITO & MERCADO

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.632.328,49	0,00	0,00	2.779.818,52	147.490,03	5,60%	5,60%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2.635.130,85	0,00	0,00	2.735.718,89	100.588,04	3,82%	3,82%
ITAÚ FIAÇÕES BDR NÍVEL I	1.867.388,62	0,00	0,00	1.903.709,03	36.320,41	1,94%	1,94%
Total Exterior	7.134.847,96	0,00	0,00	7.419.246,44	284.398,48	3,99%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	131.154.367,36	39.999.580,24	3.807.236,25	175.857.600,24	8.510.888,89	4,97%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	82.473.700,26	0,00	0,00	88.854.375,34	6.380.675,08	7,74%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	33.104.421,89	0,00	0,00	35.257.236,20	2.152.814,31	6,50%	6,50%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	15.478.070,47	67.503.160,66	76.196.278,50	8.259.374,71	1.474.422,08	1,78%	5,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	19.733.529,07	0,00	20.778.323,71	0,00	1.044.794,64	5,29%	6,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2036 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	20.778.323,71	0,00	21.722.303,34	943.979,63	4,54%	-
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	37.145.131,52	0,00	35.000.000,00	2.918.129,78	772.998,26	2,08%	10,28%
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.098.007,96	0,00	0,00	11.814.698,21	716.690,25	6,46%	6,46%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.933.007,10	0,00	0,00	10.581.907,56	648.900,46	6,53%	6,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.164.349,41	11.509.504,93	0,00	15.221.087,09	547.232,75	3,73%	6,99%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.675.146,04	2.795.922,83	0,00	5.999.400,60	528.331,73	9,66%	11,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.065.820,45	0,00	11.512.842,30	0,00	447.021,85	4,04%	7,00%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	10.521.611,36	0,00	10.000.000,00	909.510,40	387.899,04	3,69%	7,76%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.111.960,13	0,00	0,00	3.468.816,18	356.856,05	11,47%	11,47%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.249.668,15	0,00	5.000.000,00	505.674,13	256.005,98	4,88%	8,26%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	528.644,99	10.000.000,00	0,00	10.742.111,24	213.466,25	2,03%	6,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.044.457,64	0,00	0,00	3.245.323,03	200.865,39	6,60%	6,60%
NOVUS INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP	0,00	5.002.539,40	0,00	5.192.696,11	190.156,71	3,80%	7,74%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.439.826,32	0,00	1.482.784,91	0,00	42.958,59	2,98%	11,24%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	1.277.428,72	0,00	1.314.638,19	0,00	37.209,47	2,91%	11,29%



CRÉDITO & MERCADO

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2023

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Insit
Total Renda Fixa	382.199.148,84	157.589.031,77	165.092.103,86	400.550.244,16	25.854.167,41	4,79%	

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023****FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,00	35.005.078,80	0,00	35.533.687,73	528.608,93	1,51%	6,48%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	544.054,07	0,00	0,00	579.758,09	35.704,02	6,56%	6,56%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	281.740,61	0,00	0,00	298.677,36	16.936,75	6,01%	6,01%
ITAU FOF RPI BOVESPAATIVO FIC AÇÕES	6.342.672,16	0,00	5.798.618,96	0,00	-544.053,20	-8,58%	7,26%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	21.327.713,60	0,00	19.806.012,55	0,00	-1.521.701,05	-7,13%	6,56%
Total Renda Variável	28.496.180,44	35.005.078,80	25.604.631,51	36.412.123,18	-1.484.504,55	-3,92%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2023

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	2.427.153,63	0,00	0,00	2.779.818,52	352.664,89	14,53%	14,53%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	2.553.120,33	0,00	0,00	2.735.718,89	182.598,56	7,15%	7,15%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NIVEL I	1.916.745,10	0,00	0,00	1.903.709,03	-13.036,07	-0,68%	-0,68%
Total Exterior	6.897.019,06	0,00	0,00	7.419.246,44	522.227,38	7,57%	



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 & MERCADO. 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 das outras providências.

Recadastramento dos Aposentados 2023

Data	Aposentados/Pensionistas	Recadastramento	
Janeiro	58	57	98,28%
Fevereiro	66	58	87,88%
Março	60	55	91,67%
Abril	52	47	90,38%
Maior	56	45	80,36%
Junho	38	28	73,68%
Julho	48	20	41,67%
Agosto	68	1	1,47%
Setembro	69		0,00%
Outubro	49		0,00%
Novembro	55		0,00%
Dezembro	64		0,00%
Total	683	311	
JANEIRO a ABRIL	330	290	

Aposentados/Pensionistas
Recadastramento
Não Recadastrou

Aposentados/Pensionistas
Fez o Recadastramento
Não fez o Recadastramento

