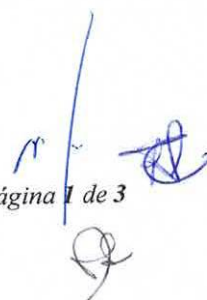


RELATORIO DE INVESTIMENTOS

MAIO 2023



Handwritten signature and initials in blue ink, including a vertical line and a circular mark.

SUMÁRIO

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


r. 
Página 2 de 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.

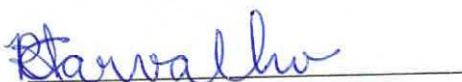
2. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos do São Roque Prev analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês maio/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 maio de 2023, em reunião realizada em 21 de junho de 2023.

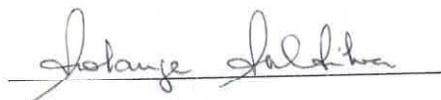
Rosana Teixeira de Carvalho



Lisete de Fátima Oliveira



Solange Siqueira Duarte Silva



Mauracy Moraes de Oliveira





CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2023

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



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|---------|----------|----------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | | | 176.230.149,35 | 39,95% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a' |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | D+1 | Não há | 15.065.771,95 | 3,42% | 784 | 0,26% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1 | Não há | 5.860.388,76 | 1,33% | 536 | 0,10% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0 | Não há | 10.619.080,73 | 2,41% | 1.127 | 0,16% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA P... | D+0 | 49444 | 21.061.435,43 | 4,77% | 37 | 3,99% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | D+0 | Não há | 495.250,20 | 0,11% | 775 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 3.211.815,23 | 0,73% | 921 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 22.873.732,70 | 5,19% | 971 | 0,59% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 3.388.218,56 | 0,77% | 82 | 0,96% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 10.463.414,19 | 2,37% | 357 | 0,12% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | D+1 | Não há | 894.433,12 | 0,20% | 120 | 0,12% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 34.853.965,42 | 7,90% | 412 | 0,55% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F... | D+1 | Não há | 2.854.640,00 | 0,65% | 210 | 0,14% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 11.678.360,37 | 2,65% | 377 | 0,24% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| NC RED INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP | D+4 du | Não há | 5.064.706,07 | 1,15% | 23 | 1,80% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' |
| LETRA FINANCEIRA BTG | S/Info | | 88.101.600,50 | 19,97% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I | D+5 | Não há | 2.698.377,54 | 0,61% | 11.912 | 0,41% | Artigo 9º, Inciso III |
| CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I | D+4 | Não há | 2.766.867,07 | 0,63% | 494 | 0,13% | Artigo 9º, Inciso III |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NIVEL I | D+3 | Não há | 1.925.056,66 | 0,44% | 2.155 | 1,86% | Artigo 9º, Inciso III |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP | D+0 | Não há | 572.757,20 | 0,13% | 3.125 | 0,03% | Artigo 10º, Inciso I |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2023)

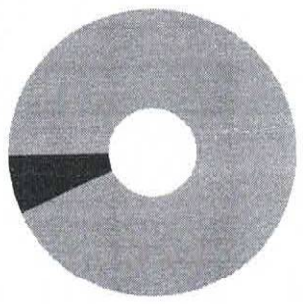
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|--|---------|----------|-----------------------|--------------------|----------|------------------|----------------------|
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP | D+4 | Não há | 291.003,86 | 0,07% | 5.944 | 0,05% | Artigo 10º, Inciso I |
| NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 20.174.311,68 | 4,57% | 15.150 | 5,39% | Artigo 10º, Inciso I |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 441.145.336,59 | | | | |



CRÉDITO & MERCADO

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

| Artigos - Renda Fixa | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2023 | | | GAP Superior |
|-----------------------------------|----------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a' | 100,00% | 176.230.149,35 | 39,95% | 20,00% | 37,00% | 60,00% | 88.457.052,60 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' | 100,00% | 56.313.742,30 | 12,77% | 5,00% | 10,00% | 60,00% | 208.373.459,65 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 44.114.533,66 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 60,00% | 92.071.470,43 | 20,87% | 0,00% | 18,00% | 60,00% | 172.615.731,52 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b' | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 2,00% | 8.822.906,73 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 88.101.600,50 | 19,97% | 20,00% | 20,00% | 20,00% | 127.466,82 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 22.057.266,83 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 412.716.962,58 | 93,56% | 45,00% | 86,00% | 217,00% | |



RENDA FIXA 412.716.962,58
 EXTERIOR 7.390.301,27
 ESTRUTURADOS 21.038.072,74

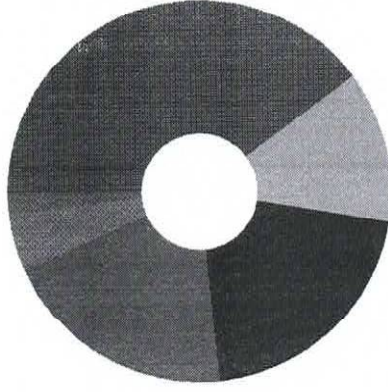
[Handwritten signatures and initials]



**CRÉDITO
& MERCADO**

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 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% | 132.343.600,98 |
| Artigo 8º, Inciso II | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,50% | 10,00% | 44.114.533,66 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 21.038.072,74 | 4,77% | 0,00% | 2,00% | 10,00% | 23.076.460,92 |
| Artigo 10º, Inciso II | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,50% | 5,00% | 22.057.266,83 |
| Artigo 11º | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,50% | 5,00% | 22.057.266,83 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 30,00% | 21.038.072,74 | 4,77% | 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% | 44.114.533,66 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 7.390.301,27 | 1,68% | 0,00% | 2,00% | 10,00% | 36.724.232,39 |
| Total Exterior | 10,00% | 7.390.301,27 | 1,68% | 0,00% | 2,50% | 20,00% | |

(Handwritten signatures and initials)



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|------------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI... | 176.230.149,35 | 39,95 | - |
| BE GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 78.178.787,11 | 17,72 | - |
| CAIXA DTVM | 43.086.092,10 | 9,77 | - |
| NOVUS CAPITAL | 25.239.017,75 | 5,72 | 0,81 |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT | 13.851.632,75 | 3,14 | 0,00 |
| ITAÚ UNIBANCO | 13.603.417,03 | 3,08 | 0,00 |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT | 2.854.640,00 | 0,65 | - |

| Artigos | Estratégia de Alocação - 2023 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-----------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira \$ | Carteira % | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a' | 176.230.149,35 | 39,95 | 20,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b' | 56.313.742,30 | 12,77 | 5,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'c' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a' | 92.071.470,43 | 20,87 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'b' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2,00 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 30,00 |
| Artigo 8º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 7.390.301,27 | 1,68 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 21.038.072,74 | 4,77 | 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 |

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)



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 0,29% | 5,76% | 2,60% | 7,07% | 8,74% | 18,79% | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,36% | 5,50% | 2,49% | 6,80% | 8,35% | 18,22% | 0,75% | 0,03% |
| IRF-M 1 (Benchmark) | 1,14% | 5,42% | 3,26% | 6,67% | 13,53% | 20,82% | - | - |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,12% | 5,27% | 3,18% | 6,49% | 13,21% | 20,16% | 0,09% | 0,00% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 0,57% | 5,93% | 3,02% | 6,92% | 9,45% | 19,90% | - | - |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 0,61% | 5,90% | 3,02% | 6,87% | 9,27% | 19,31% | 0,68% | 0,02% |
| IMA-B (Benchmark) | 2,53% | 8,76% | 7,39% | 8,55% | 10,47% | 15,54% | - | - |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,58% | 8,70% | 7,35% | 8,46% | 10,27% | 14,95% | 1,51% | 0,04% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 2,66% | 8,88% | 7,53% | 8,59% | 10,24% | 14,73% | 1,55% | 0,04% |
| CDI (Benchmark) | 1,12% | 5,37% | 3,25% | 6,55% | 13,48% | 22,43% | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,16% | 5,23% | 3,20% | 6,42% | 13,65% | 23,76% | 0,03% | 0,00% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,16% | 5,34% | 3,26% | 6,57% | 13,81% | 23,57% | 0,03% | 0,00% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 1,04% | 4,93% | 2,98% | 6,02% | 12,37% | 19,93% | 0,01% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 1,24% | 5,29% | 3,32% | 6,47% | 13,49% | 23,07% | 0,04% | 0,00% |
| NC RED INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP | 1,90% | 5,08% | 2,24% | 5,59% | 14,20% | - | 1,15% | 0,03% |



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IPCA (Benchmark) | 0,23% | 2,95% | 1,56% | 3,59% | 3,94% | 16,13% | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 2,35% | 7,88% | 6,13% | 7,48% | 11,36% | 20,73% | 1,00% | 0,03% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 1,81% | 6,03% | 3,94% | 7,24% | 12,48% | 16,41% | 0,56% | 0,02% |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 1,67% | 5,98% | 3,91% | 7,25% | 11,96% | 17,50% | 0,44% | 0,02% |
| LETRA FINANCEIRA BTG | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | - | - | - | - | - | - | - | - |



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| CDI (Benchmark) | 1,12% | 5,37% | 3,25% | 6,55% | 13,48% | 22,43% | - | - |
| CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP | 1,36% | 5,28% | 3,28% | 6,50% | 13,45% | 23,47% | 0,18% | 0,01% |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP | 1,97% | 3,29% | 3,50% | 3,43% | 9,35% | 12,63% | 2,08% | 0,06% |
| NOVUS INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO | 1,44% | 5,03% | 2,60% | 5,69% | 13,33% | 21,29% | 0,53% | 0,02% |

| | | | | | | | | |
|-------------------------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|---|---|
| Global BDRX (Benchmark) | 5,90% | 14,58% | 8,54% | 9,75% | 14,79% | -0,17% | - | - |
|-------------------------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|---|---|

| | | | | | | | | |
|---|-------|-------|-------|--------|-------|--------|---|---|
| MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark) | 2,12% | 5,72% | 2,36% | -2,22% | 7,87% | -6,83% | - | - |
|---|-------|-------|-------|--------|-------|--------|---|---|



**CRÉDITO
& MERCADO**

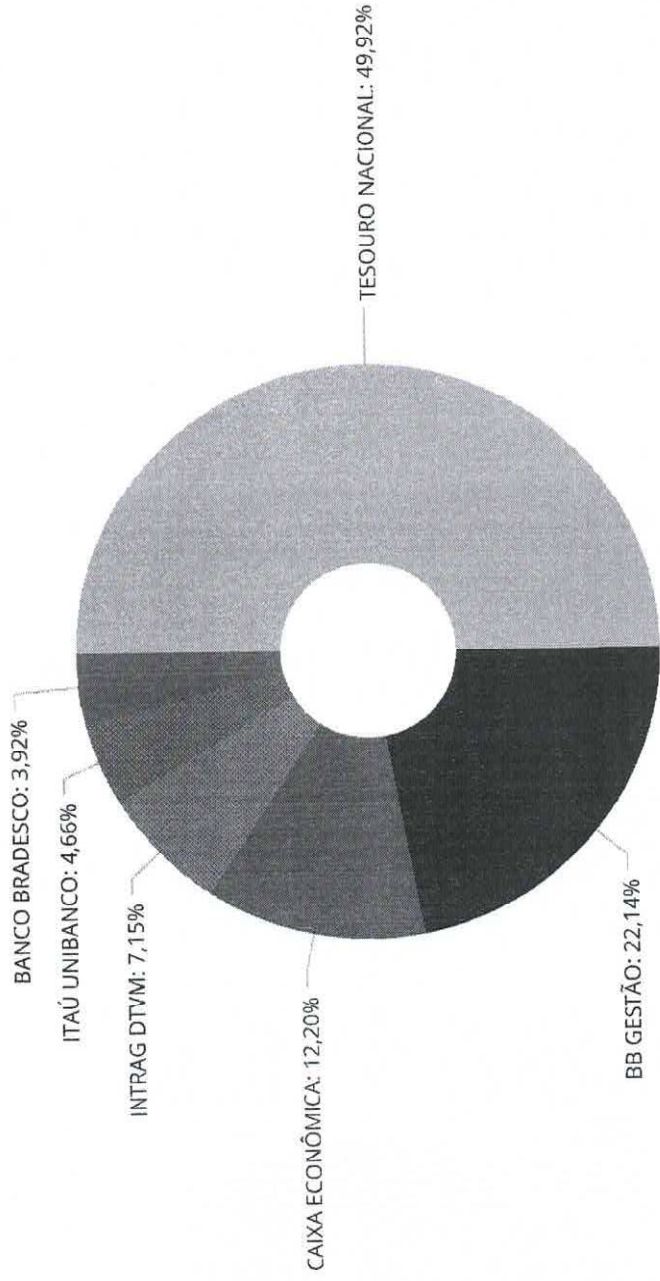
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|--------|-------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark) | 2,12% | 5,72% | 2,36% | -2,22% | 7,87% | -6,83% | - | - |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 3,04% | 5,69% | 3,42% | 0,54% | 7,86% | -6,37% | 6,35% | 15,073% |
| Global BDRX (Benchmark) | 5,90% | 14,58% | 8,54% | 9,75% | 14,79% | -0,17% | - | - |
| ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 1,54% | 0,43% | 1,27% | -3,40% | 2,44% | -3,51% | 6,43% | 13,073% |
| CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 5,80% | 14,00% | 8,47% | 8,53% | 13,81% | -3,05% | 8,28% | 16,769% |



CRÉDITO & MERCADO

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



| | |
|------------------|----------------|
| TESOURO NACIONAL | 176.230.149,35 |
| BB GESTÃO | 78.178.787,11 |
| CAIXA ECONÔMICA | 43.086.092,10 |
| INTRAG DTVM | 25.239.017,75 |
| ITAÚ UNIBANCO | 16.458.057,03 |
| BANCO BRADESCO | 13.851.632,75 |

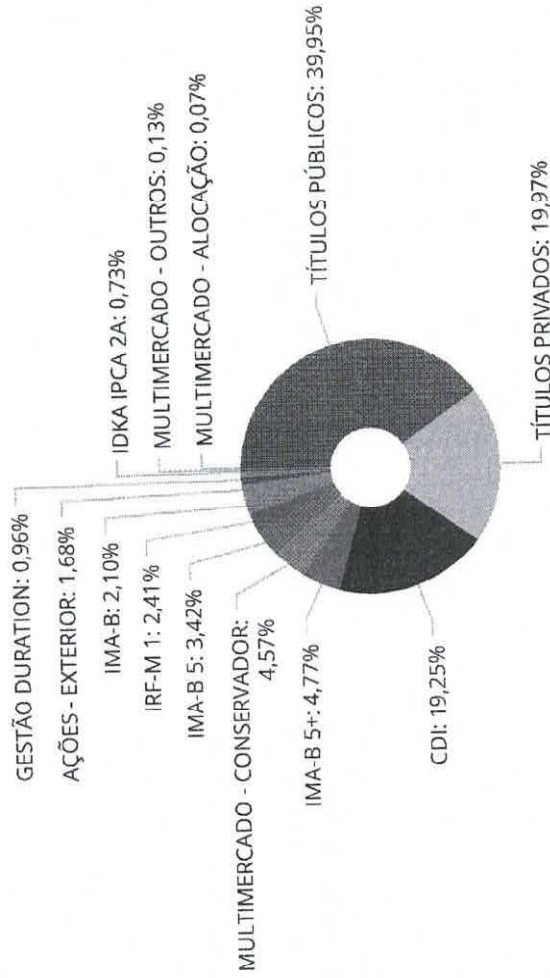
[Handwritten mark]

[Handwritten signature]



CRÉDITO & MERCADO

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



| | | | | | |
|---------------------------|----------------|------------------------------|---------------|-------------------------|---------------|
| ■ TÍTULOS PÚBLICOS | 176.230.149,35 | ■ TÍTULOS PRIVADOS | 88.101.600,50 | ■ CDI | 84.934.178,75 |
| ■ IMA-B 5+ | 21.061.435,43 | ■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR | 20.174.311,68 | ■ IMA-B 5 | 15.065.771,95 |
| ■ IRF-M 1 | 10.619.080,73 | ■ IMA-B | 9.248.607,32 | ■ AÇÕES - EXTERIOR | 7.390.301,27 |
| ■ GESTÃO DURATION | 4.244.323,32 | ■ IDKA IPCA 2A | 3.211.815,23 | ■ MULTIMERCADO - OUTROS | 572.757,20 |
| ■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO | 291.003,86 | | | | |

Handwritten signatures and initials in blue ink.



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 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 | 4.187,745187 | 79.996.678,20 | 82.553.020,87 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 04/11/2022 | 12.236 | 4.086,264032100 | 4.274,145712 | 49.999.526,70 | 52.298.446,93 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 03/03/2023 | 10.032 | 3.987,19898800 | 4.002,910706 | 39.999.580,25 | 40.157.200,20 | Curva |

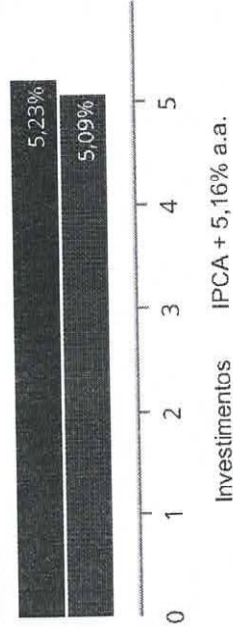
23



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 | 5.537.868,20 | 21.753.672,49 | 1,28% | 5,23% | 0,67% | 5,09% | 102,80% | 0,66% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



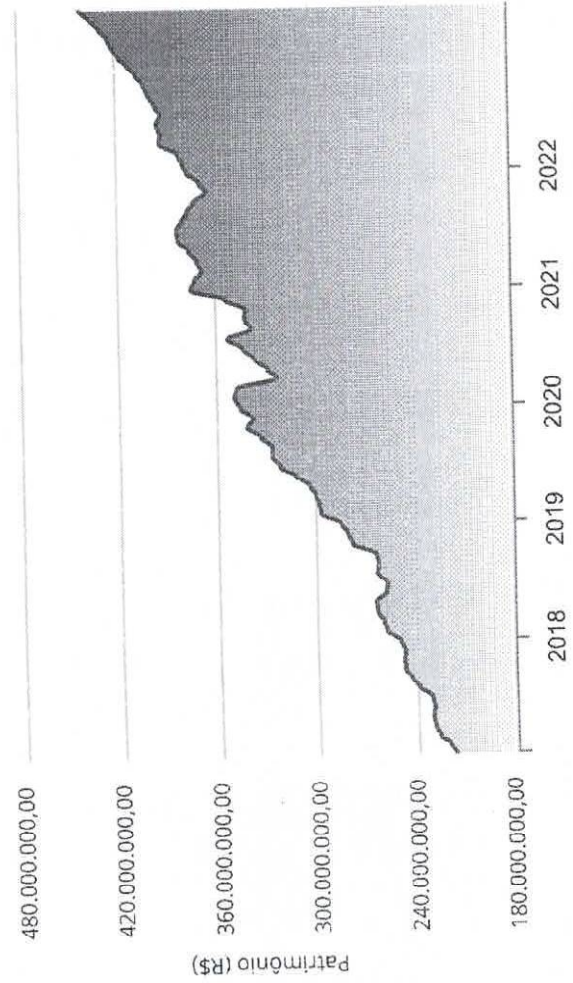


CRÉDITO & MERCADO

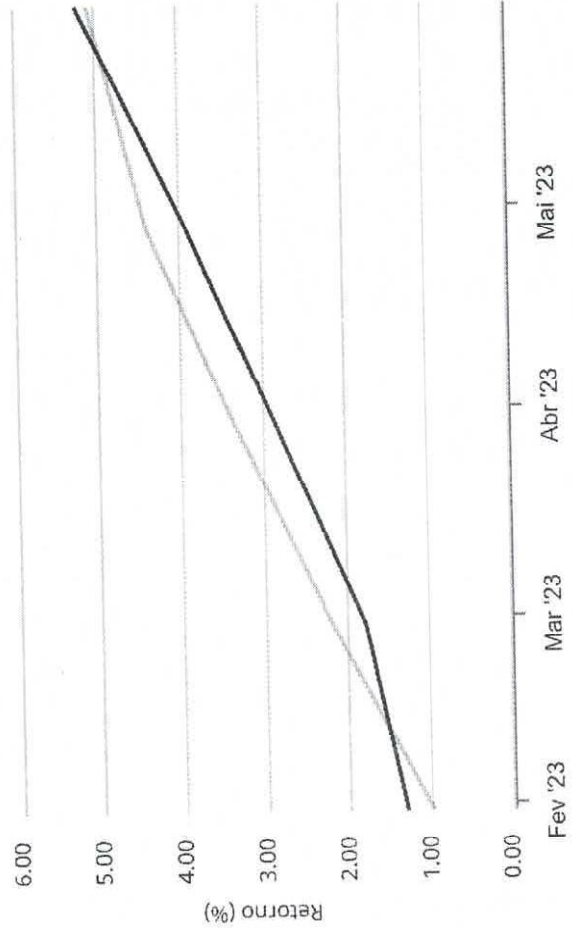
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|-----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 3.300.528,18 | 0,00 | 0,00 | 3.388.218,56 | 87.690,38 | 2,66% | 2,66% | 1,55% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 5.713.214,82 | 0,00 | 0,00 | 5.860.388,76 | 147.173,94 | 2,58% | 2,58% | 1,51% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 2.789.042,71 | 0,00 | 0,00 | 2.854.640,00 | 65.597,29 | 2,35% | 2,35% | 1,00% |
| LETRA FINANCEIRA BTG | 86.881.244,36 | 0,00 | 0,00 | 88.101.600,50 | 1.220.356,14 | 1,40% | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2035 FI RENDA FIXA PRE... | 0,00 | 20.778.323,71 | 0,00 | 21.061.435,43 | 283.111,72 | 1,36% | - | - |
| NC RED INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA LP | 0,00 | 5.002.539,40 | 0,00 | 5.064.706,07 | 62.166,67 | 1,24% | 1,90% | 1,15% |
| CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA | 34.426.658,88 | 0,00 | 0,00 | 34.853.965,42 | 427.306,54 | 1,24% | 1,24% | 0,04% |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 10.343.337,00 | 0,00 | 0,00 | 10.463.414,19 | 120.077,19 | 1,16% | 1,16% | 0,03% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 11.544.402,99 | 0,00 | 0,00 | 11.678.360,37 | 133.957,38 | 1,16% | 1,16% | 0,03% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 174.343.999,58 | 0,00 | 0,00 | 176.230.149,35 | 1.886.149,77 | 1,08% | - | - |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 550.350,42 | 10.000.000,00 | 0,00 | 10.619.080,73 | 68.730,31 | 0,65% | 1,12% | 0,09% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 46.649.672,35 | 4.438.709,93 | 28.542.941,98 | 22.873.732,70 | 328.292,40 | 0,64% | 1,04% | 0,01% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ... | 20.646.749,18 | 0,00 | 20.778.323,71 | 0,00 | 131.574,53 | 0,64% | 1,19% | 0,13% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 14.974.288,67 | 0,00 | 0,00 | 15.065.771,95 | 91.483,28 | 0,61% | 0,61% | 0,68% |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 5.858.998,40 | 0,00 | 5.000.000,00 | 894.433,12 | 35.434,72 | 0,60% | 1,67% | 0,44% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 5.467.473,90 | 0,00 | 5.000.000,00 | 495.250,20 | 27.776,30 | 0,51% | 1,81% | 0,56% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 3.200.280,58 | 0,00 | 0,00 | 3.211.815,23 | 11.534,65 | 0,36% | 0,36% | 0,75% |
| Total Renda Fixa | 426.690.242,02 | 40.219.573,04 | 59.321.265,69 | 412.716.962,58 | 5.128.413,21 | 1,20% | | 0,31% |

23



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/05/2023

FUNDOS EXTERIOR

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

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|---------------------|-------------|-------------|---------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I | 2.615.054,36 | 0,00 | 0,00 | 2.766.867,07 | 151.802,71 | 5,80% | 5,80% | 8,28% |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIAÇÕES BDR NÍVEL I | 2.618.818,61 | 0,00 | 0,00 | 2.698.377,54 | 79.558,93 | 3,04% | 3,04% | 6,35% |
| ITAÚ FIAÇÕES BDR NÍVEL I | 1.895.915,73 | 0,00 | 0,00 | 1.925.056,66 | 29.140,93 | 1,54% | 1,54% | 6,43% |
| Total Exterior | 7.129.798,70 | 0,00 | 0,00 | 7.390.301,27 | 260.502,57 | 3,65% | | 7,09% |



**CRÉDITO
& MERCADO**

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO & 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 dá outras providências.