

1 **ATA DE REUNIÃO (nº 206)**

2 Aos vinte e quatro dias do mês de abril do ano de dois mil e vinte e quatro, às quatorze  
3 horas e trinta minutos, em cumprimento ao que estabelece a Lei Complementar nº 566, de  
4 28 de junho de 2018 e alterações, reuniu-se extraordinariamente o Comitê de  
5 Investimentos, através de videoconferência, composto pelos membros: Adriano Antônio  
6 Pazianoto (CPA-10 Anbima e CP RPPS DIRIG III), Daniel Henrique Martins Biot (CEA  
7 Anbima e CP RPPS CGINV III), Mário José Piccarelli de Castro (CPA-20 Anbima) e  
8 Patrícia Nato Toninato Bartolomei (CPA-20 Anbima). A reunião teve como pauta: **I-**  
9 **Abertura dos Trabalhos; II- Diligências para verificação de emissão de relatórios**  
10 **via plataforma web em atendimento ao item 3.4 do termo de referência da**  
11 **dispensa/contratação direta nº 04/2024.** A Sra. Patrícia Nato Toninato Bartolomei,  
12 coordenadora do Comitê de Investimentos, dá abertura aos trabalhos e recebe o Sr. Marcos  
13 Almeida, representante da LDB Consultoria empresa habilitada na dispensa/contratação  
14 direta nº 04/2024 e já adentrando ao item II da pauta, em atendimento ao item 3.4 do  
15 termo de referência da referida dispensa/contratação informa que, serão realizadas,  
16 diligências para verificação de emissão de relatórios via plataforma web. Assim, o Sr.  
17 Marcos Almeida passou a apresentação dos itens relatórios e/ou documentos previstos nos  
18 itens “c”, “d”, “e”, “g”, “n”, “o” e “bb” do item 4.1 do termo de referência, cujos *prints*  
19 seguirão anexos à presente ata. Após a apresentação, **o Comitê de Investimentos declara**  
20 **que a empresa comprovou a emissão dos documentos e relatórios previstos no**  
21 **termo de referência, determinando o encaminhamento da ata da reunião ao setor de**  
22 **licitações da RIOPRETOPREV.** Finalizados os assuntos previstos em pauta, a presente  
23 reunião foi finalizada. Para constar, eu, Patrícia Nato Toninato Bartolomei, lavro a presente  
24 ata, que depois de lida e achada conforme, vai por mim assinada e por todos os presentes.  
25 **Ata aprovada, por unanimidade, ao final da reunião virtual de 24/04/2024** (reunião  
26 extraordinária de abril de 2024).

ADRIANO ANTÔNIO PAZIANOTO  
ASSINADO DIGITALMENTE

DANIEL HENRIQUE MARTINS BIOT  
ASSINADO DIGITALMENTE

MÁRIO JOSÉ PICCARELLI DE CASTRO  
ASSINADO DIGITALMENTE

PATRÍCIA NATO TONINATO  
BARTOLOMEI  
ASSINADO DIGITALMENTE

27

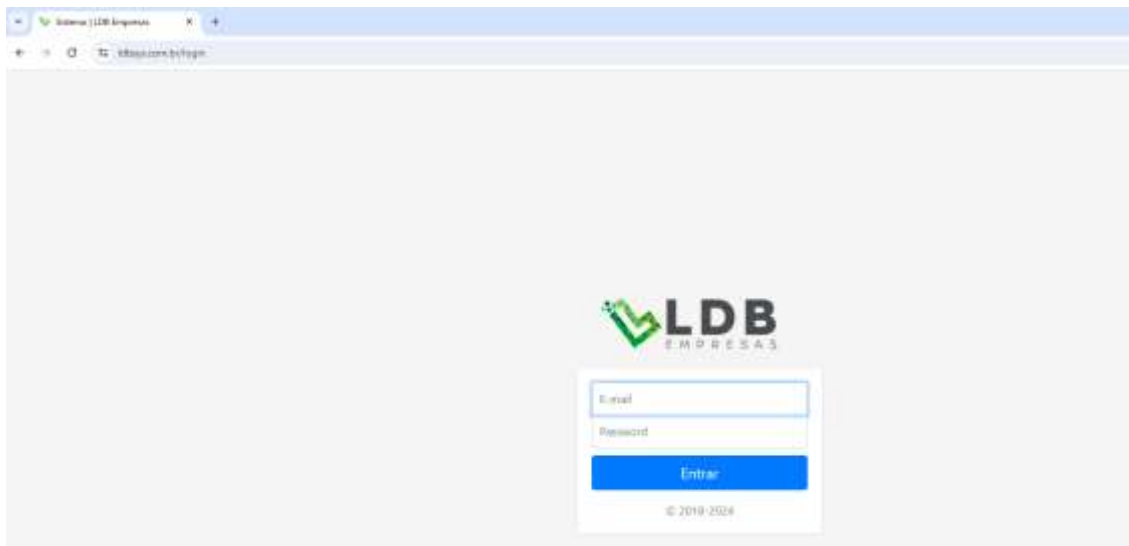
1

**RIOPRETOPREV – Regime Próprio de Previdência Social do Município de São José do Rio Preto**

Rua General Glicério, 3553 – Centro - CEP 15015-400 - São José do Rio Preto - SP  
Telefones (17) 3222 7445 - [riopretoprev@riopreto.sp.gov.br](mailto:riopretoprev@riopreto.sp.gov.br) - [www.riopreto.sp.gov.br](http://www.riopreto.sp.gov.br)

## ANEXO DA ATA DE REUNIÃO n° 206

### Plataforma web



c) A elaboração/geração de relatórios gerenciais mensais que demonstrem, no mínimo, em plataforma WEB própria, as seguintes informações:

- ✓ Relatório de performance e desempenho dos fundos de investimentos da carteira no qual conste, no mínimo, os saldos do mês anterior, as aplicações e resgates realizados no mês, os saldos do mês, a rentabilidade dos fundos em valores e percentuais, além da totalização da carteira e do comparativo dos retornos – por mês e acumulado do ano – que oponha a rentabilidade e a meta atuarial;

Artigo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês (R\$)	Rentabilidade Desemp. (%)	No Ano (R\$)
Artigo 1º - Ativos	1,00	5,07	3,87	5,54	16,21	1.000.700,00	1,14	1.640.274,50
Artigo 1º - Ativos B	5,23	0,01	0,01	4,36	10,20	212.048,33	0,05	190.672,42
Artigo 1º - Ativos C	34,40	10,06	30,08	30,19	30,31			
Artigo 1º - Ativos D	0,54	1,01	1,00	5,03	11,40	336.044,04	0,06	1.220.870,41
Artigo 1º - Ativos E	40,85	38,38	39,28	32,71	30,80			
Artigo 1º - Ativos F	1,44	0,83	3,30	0,70	11,00	36.440,38	0,00	223.230,34
Artigo 1º - Ativos G	173,38	146,43	143,40	123,34	105,42			
Artigo 1º - Ativos H	0,77	2,39	2,39	0,71	10,16	-23.689,30	0,00	72.057,11
Artigo 1º - Ativos I	0,20	0,01	0,01	0,10	0,10			
Artigo 1º - Ativos J	4,59	-4,27	-4,27	0,16	21,06	-108.271,24	-0,09	-337.936,17
Artigo 1º - Ativos K	0,12	0,00	0,00	-1,70	-4,46			
Artigo 1º - Ativos L	2,19	12,23	12,23	24,63	26,27	548.011,78	0,10	2.097.777,83
Artigo 1º - Ativos M	253,20	471,30	471,30	444,38	237,60			
Artigo 1º - Ativos N	2,28	15,37	15,37	27,04	34,73	462.705,05	0,09	1.774.678,71
Artigo 1º - Ativos O	274,00	391,20	391,20	406,27	280,14			
Artigo 1º - Ativos P	2,42	10,00	10,00	23,24	32,30	1.025.431,38	0,19	3.194.230,10
Artigo 1º - Ativos Q	411,21	412,00	412,00	402,10	280,24			



LDB Carteira \* Movimentações \* Posições Relativas \* Cadastros \* Ferramentas \* SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

Carteira | Ativa Atualizada | Rentabilidade por Artigo | Análise de Qualidade | Alocação | Limites dos Fundos | Movimentações | Análise de Risco | Indicações | Observações | PDF

Sub-total Artigo 7º I, Alínea a **0,46 0,85 1,00 3,97 108.458.588,81 34,41**

Artigo 7º I, Alínea B (Fundo 100% Titulos Públicos)

Banco	Adm.	Ativo	Valor (R\$)				% Carteira	PL do Fundo	% Fundo	
			Valor	De	Má	Trim.				
BB	BB	BB PREV RP ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO XOMA RIC FI	0,01	0,01	0,77	2,41	13.703.340,61	2,32	6.702.421.294,44	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RP LP	0,11	0,04	0,79	2,94	3.207.956,27	0,88	15.231.140.496,04	0,04
CAIXA DTVM	CEF	CDOR FI BRASIL 2004 VI TP RL	0,00	0,04	0,81	3,70	1.004.703,48	0,10	226.788.000,00	0,43
BB	BB	BB PREV RP TÍTULOS PÚBLICOS IPCA BFI	0,00	0,04	0,01	2,77	979.846,22	0,11	192.188.037,64	0,03
BB	BB	BB PREV RP RAA S TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	<0,01	0,09	0,11	15.788.946,17	0,06	5.134.805.917,52	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RAA S TÍTULOS PÚBLICOS RP LP	3,08	<0,01	0,04	0,12	3.602.570,54	0,06	3.009.024.391,86	0,07
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET RAA S ARIEL FI BF	4,73	<0,01	<0,01	<0,01	55.780.006,40	1,02	184.944.602,01	0,07
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RP RAA S S PREMIUM RIC FI	1,00	0,00	0,75	1,00	9.951.800,61	1,32	1.205.573.003,69	0,70
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RAA S S TÍTULOS PÚBLICOS RP LP	0,00	<0,01	<0,01	1,30	16.439.936,14	0,03	1.388.494.031,06	1,04
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET RAA S S BEATRO FI BF	2,02	0,00	0,03	1,50	11.021.037,47	2,01	406.070.075,04	2,71
CAIXA DTVM	CEF	RIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA BF	1,10	0,01	0,34	1,00	10.844.113,83	1,00	5.417.277.427,01	0,03
Sub-total Artigo 7º I, Alínea B			<b>2,84</b>	<b>0,07</b>	<b>0,29</b>	<b>0,81</b>	<b>96.775.283,74</b>	<b>11,49</b>		

Artigo 7º II, Alínea a (Fundo 100% Renda Fixa)

Gestor	Adm.	Ativo	Valor (R\$)				% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
			Valor	De	Má	Trim.			

✓ Relatórios de mesmo teor do item anterior com agregados trimestrais, semestrais e anual;

LDB Carteira \* Movimentações \* Posições Relativas \* Cadastros \* Ferramentas \* SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

Carteira | Ativa Atualizada | Rentabilidade por Artigo | Análise de Qualidade | Alocação | Limites dos Fundos | Movimentações | Análise de Risco | Indicações | Observações | PDF

Data de Referência: 28/09/2024

Data	Carteira	PL Informado	Funcionalidade
28/09/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	347.820.251,67	Relatório
30/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PROVISIONÁRIO	342.098.317,49	Relatório
28/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	4.911.093,10	Relatório

LDB Carteira \* Movimentações \* Posições Relativas \* Cadastros \* Ferramentas \* SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

Carteira | Ativa Atualizada | Rentabilidade por Artigo | Análise de Qualidade | Alocação | Limites dos Fundos | Movimentações | Análise de Risco | Indicações | Observações | PDF

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO 28/09/2024

POSIÇÃO DE ATIVOS E ENQUADRAMENTO

RENTA FIXA 72,30%

Artigo 7º I, Alínea a (Fundo 100% Titulos Públicos)

Emissor	Título Público	Valor (R\$)				% Carteira	
		Valor	De	Má	Trim.		
TIOQURO NACIONAL	NTN-8 1505/25 (A8220000)	0,49	0,03	0,03	0,05	0.733.677,37	1,05
TIOQURO NACIONAL	NTN-8 1505/25 (A8750000)	0,43	0,03	0,03	0,06	5.194.238,20	1,08
TIOQURO NACIONAL	NTN-8 1505/25 (A2000000)	0,40	0,03	0,04	0,06	6.015.975,03	1,04
TIOQURO NACIONAL	NTN-8 1505/25 (L2000000)	0,41	0,03	0,03	0,09	5.096.639,52	1,04
TIOQURO NACIONAL	NTN-8 1505/25 (L13000000)	0,44	0,03	1,00	3,15	3.460.573,06	1,00
TIOQURO NACIONAL	NTN-8 1505/40 (L63000000)	0,25	0,03	0,09	0,06	5.650.079,40	1,04
TIOQURO NACIONAL	NTN-8 1305/45 (L13000000)	6,86	0,03	1,00	3,07	2.234.948,05	0,41
TIOQURO NACIONAL	NTN-8 1505/45 (L63400000)	0,36	0,03	1,00	0,10	5.562.717,69	1,00

✓ Relatório de enquadramento dos fundos de investimentos e sua conformidade com os limites impostos pela Resolução CMN 4.963/2021 e alterações, com alerta em casos de desenquadramento, no qual conste, além do item da resolução em que o investimento se enquadra (artigo, inciso, alínea), o saldo do mês, a participação do fundo no total da

carteira e o percentual do valor investido em relação ao PL do fundo.  
Aba carteira

**LDB** Carteira \* Movimentações \* Posições \* Relatórios \* Custódios \* Ferramentas \* SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

---

**SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO** 26/11/2024

**POSICIONAMENTO DE ATIVOS E ENQUADRAMENTO**

ATIVO	RENTAL	RENTAL	RENTAL	RENTAL	VALOR	PL
<b>RENTA FIXA</b>					395.242.864,49	72,36%
Renda Fixa	5,87	5,85	5,86	5,88		
<b>RENTA VARIÁVEL</b>					64.780.921,88	12,20%
Renda Variável	10,36	-0,26	-0,28	-0,27		
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>					38.855.988,38	7,11%
Investimentos no Exterior	11,34	0,34	2,87	14,04		
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>					45.426.824,89	8,73%
Investimentos Estruturados	11,36	-0,29	0,07	0,42		
<b>Total</b>	8,28	-0,16	0,79	0,29	547.805.555,07	100,00%

**DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS**

Ativo	Valor (R\$)
Disponibilidades Financeiras	2.118.778,18

---

**LDB** Carteira \* Movimentações \* Posições \* Relatórios \* Custódios \* Ferramentas \* SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

---

**Sub-total Artigo 7º L. Alínea a**

Valor (R\$)	RENTAL	RENTAL	RENTAL	RENTAL	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
0,46	8,83	1,88	0,87		186.438.558,85	34,41%		

**Artigo 7º L. Alínea b** Parágrafo Único - Títulos Públicos

Gener	Adesão	Ativo	Valor (R\$)	RENTAL	RENTAL	RENTAL	RENTAL	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
99	99	99 PREV RP ALOCAÇÃO ATIVA REFORMA TOTAL RP II	0,07	0,83	0,77	2,41		11.793.340,81	2,32%	9.783.470.564,44	0,20%
CAIXA OTIM	OTF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RP LP	0,11	0,34	0,79	2,05		3.207.898,27	0,61%	13.231.180.496,68	0,04%
CAIXA OTIM	OTF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI RP RL	0,00	0,36	0,91	2,78		1.204.763,43	0,23%	3.362.700.048,08	0,01%
99	99	99 PREV RP TÍTULOS PÚBLICOS PCA RP II	0,88	0,88	0,91	2,77		579.888,23	0,11%	784.105.819,84	0,00%
99	99	99 PREV RP RAA E TÍTULOS PÚBLICOS RP	0,09	0,00	0,00	0,11		13.704.346,17	2,60%	9.244.829.607,32	0,00%
CAIXA OTIM	OTF	FI CAIXA BRASIL RAA E TÍTULOS PÚBLICOS RP LP	3,08	0,00	0,00	0,12		3.402.570,04	0,66%	8.029.824.393,68	0,02%
WESTERN	BNF PARAB	WESTERN ASSET RAA & REND RP II RP	0,73	0,00	0,00	0,29		3.379.000,42	0,65%	169.346.602,31	0,00%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RP RAA & S. PREMIA RP II	1,08	0,00	0,75	1,00		6.051.160,81	1,12%	1.283.573.888,08	0,01%
CAIXA OTIM	OTF	FI CAIXA BRASIL RAA E TÍTULOS PÚBLICOS RP LP	0,03	0,00	0,00	1,00		16.263.588,14	3,15%	5.186.454.511,96	0,01%
WESTERN	BNF PARAB	WESTERN ASSET RAA RP ATIVO RP RP	0,40	0,00	0,00	1,39		7.152.127,47	1,38%	489.970.873,04	0,00%
CAIXA OTIM	OTF	FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RP	1,28	0,00	0,56	1,00		16.894.017,23	3,25%	3.431.213.407,31	0,01%
<b>Sub-total Artigo 7º L. Alínea b</b>			2,04	0,81	0,29	0,81		85.270.280,74	15,48%		

**Artigo 7º II, Alínea a** Parágrafo Único - Títulos Públicos

Gener	Adesão	Ativo	Valor (R\$)	RENTAL	RENTAL	RENTAL	RENTAL	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CAIXA OTIM	OTF	FI CAIXA BRASIL RAA E TÍTULOS PÚBLICOS RP LP	0,11	0,34	0,79	2,05		3.207.898,27	0,61%	13.231.180.496,68	0,04%



**LDB** Carteira • Monitorações • Posições • Relatórios • Cadastros • Parametros

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

Carteira | Histórico | Rentabilidade por Artigo | Análise de Liquidez | Alocação | Demanda dos Fundos | Monitoramento | Análise de Risco | Investimentos | Classificações | RPT

EMPRESAMENTO DE UM CARTEIRA

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Público de Investimentos			RPT	Fonte Legal
				Mês	Objetivo	Mês		
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos de Dívida Nacional	188.458.948,65	34,41	0,00	22,00	40,00	16,30	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	85.773.283,74	17,40	40,00	13,50	10,00	22,38	100,00
Artigo 7º II, Alínea c	Fundo Renda Fixa	102.844.961,15	18,75	0,00	11,50	40,00	15,80	80,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (out. Financeira)	6.073.578,11	1,11	0,00	1,40	10,00	1,10	20,00
Artigo 7º V, Alínea II	FI FII - Crédito Privado	2.088.540,26	0,38	0,00	0,00	0,00	0,40	20,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>380.245.302,81</b>	<b>72,94</b>					<b>100,00</b>
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Vendas de Ações	66.790.921,80	12,60	0,00	14,00	30,00	4,91	90,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>66.790.921,80</b>	<b>12,60</b>					<b>90,00</b>
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º I	Fundo de Investimento no Exterior	16.237.472,18	3,11	0,00	5,00	10,00	3,00	10,00
Artigo 9º II	Fundo de Ações - EER Brasil	30.723.024,30	5,78	0,00	4,00	10,00	5,90	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>46.960.496,48</b>	<b>8,89</b>					<b>10,00</b>
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Vendas Multilaterais	11.889.843,31	2,26	0,00	7,50	15,00	2,50	15,00

- ✓ Relatório de análise de rentabilidade que demonstre separadamente os ativos de renda fixa e renda variável identificando o benchmark e rentabilidade do mês, do ano, dos últimos 3 meses, dos últimos 6 meses, dos últimos 12 meses, dos últimos 24 meses.

**LDB** Carteira • Monitorações • Posições • Relatórios • Cadastros • Parametros

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

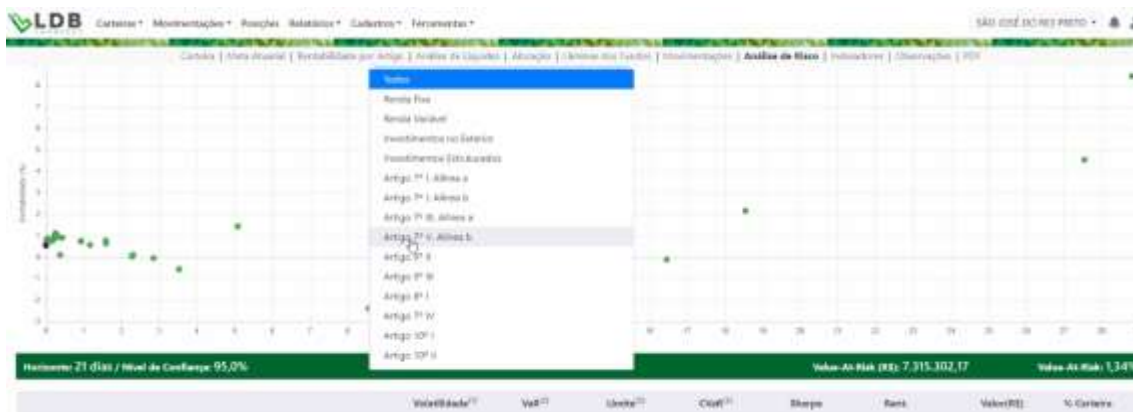
Carteira | Histórico | Rentabilidade por Artigo | Análise de Liquidez | Alocação | Demanda dos Fundos | Monitoramento | Análise de Risco | Investimentos | Classificações | RPT

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO

28/03/2024

RENTABILIDADES POR ARTIGO

Identificação	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Volatilidade (Desvio. %)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a	1,00	3,87	3,87	5,56	10,21	1.886.706,30	0,34	5.683.018,38
% do DDI	5,00	11,10	11,71	13,01	10,57			
Artigo 7º I, Alínea b	0,23	0,81	0,81	4,86	10,20	272.846,23	0,00	766.672,42
% do DDI	14,30	10,26	10,36	16,51	10,51			
Artigo 7º II, Alínea c	1,34	1,03	1,00	5,13	11,80	118.894,94	0,00	1.023.078,81
% do DDI	49,00	20,28	20,20	10,71	16,89			
Artigo 7º IV	1,44	1,83	1,82	4,72	11,83	96.446,38	0,00	313.362,54
% do DDI	176,19	146,83	146,80	121,26	116,52			
Artigo 7º V, Alínea II	0,77	2,28	2,20	5,11	10,18	23.803,00	0,00	72.007,11
% do DDI	50,56	91,01	91,06	90,64	82,14			
Artigo 8º I	-0,58	-4,27	-4,27	6,50	21,28	-88.575,20	-0,00	-3.507.196,17
% do DDI	0,12	0,24	0,26	1,23	4,46			
Artigo 9º I	0,78	12,07	10,40	24,45	29,37	548.011,78	0,10	2.080.777,88
% do DDI	172,25	471,10	471,52	484,58	217,68			
Artigo 9º II	2,28	11,07	11,07	27,64	34,73	462.700,80	0,00	1.774.074,71
% do DDI	174,61	188,30	188,30	468,37	289,94			
Artigo 10º I	0,43	10,05	10,05	25,24	35,88	1.205.451,29	0,10	1.194.355,15
% do DDI	411,25	413,20	413,20	405,75	393,38			



SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO 28/11/2024

PERFORMANCE DOS FUNDOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITBI FINANÇAS - INC - 302 RIO FICTUAL 34.8-RIN-14	1.44	3.82	3.82	6.72	13.03		
EX PREV-10 (100% PREVID) PCA 10-11	0.13	-0.21	-0.41	-0.53	0.12	21.03	81.72
NTN 4 100% (4.0000%)	0.89	3.56	3.56	5.12	15.14	22.64	35.39
NTN 6 100% (6.0000%)	1.20	3.87	3.87	5.04	6.28		
NTN 8 100% (8.0000%)	0.96	3.46	3.46	5.14	6.55	21.47	61.51
NTN 8 100% (8.0000%)	0.80	3.59	3.59	5.03	5.83	12.72	16.47
NTN 8 100% (8.0000%)	0.88	3.06	3.06	3.39	18.16	22.67	35.46
NTN 8 100% (8.0000%)	0.87	1.44	1.44	1.01	6.41	13.02	14.81
NTN 8 100% (8.0000%)	1.08	3.21	3.21	5.91	16.91	24.23	37.39
NTN 8 100% (8.0000%)	0.88	3.80	3.80	5.39	6.84	15.49	18.34
NTN 9 100% (9.0000%)	1.36	3.26	3.26	3.81	13.03	20.88	
NTN 9 100% (9.0000%)	0.90	1.85	1.85	3.30	1.86	12.14	
NTN 9 100% (9.0000%)	0.90	2.85	2.85	5.07	6.27	20.71	36.46
NTN 9 100% (9.0000%)	0.77	1.42	1.42	3.30	3.30	11.00	15.41

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO 28/11/2024

PERFORMANCE DOS FUNDOS

Fundo	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	-0.08	-0.27	-0.27	-1.67			
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	-0.16	-0.13	-0.13	-0.68			
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	4.58	2.20	3.30	6.45			
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	3.05	-0.87	-0.87	-2.59			
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	2.16	15.24	15.24	20.17	37.06	27.99	-12.24
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	1.54	12.39	12.39	23.61	37.06	1.60	-36.89
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	5.37	16.45	16.45	20.43	27.79	28.86	12.84
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	3.27	10.04	10.04	10.53	12.05	21.21	4.01
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	5.44	11.29	11.29	23.03	36.17	41.02	71.75
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	-0.07	-2.43	-2.43	2.60	15.08	16.71	51.17
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	1.36	0.81	0.81	1.88	14.06	23.66	34.70
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	0.07	3.05	3.05	5.81	15.51	15.21	49.39
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	5.36	11.12	11.12	25.54	36.04	34.42	62.89
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	0.93	2.95	2.95	5.21	15.29	12.71	46.31
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	3.48	14.88	14.88	22.77	32.44	27.89	16.84
IFBI FICTUAL ECONOMIA REAL E FP - FUNDOSIMPLIS	-0.57	-0.90	-0.90	-1.71	-2.21	-2.89	-9.80

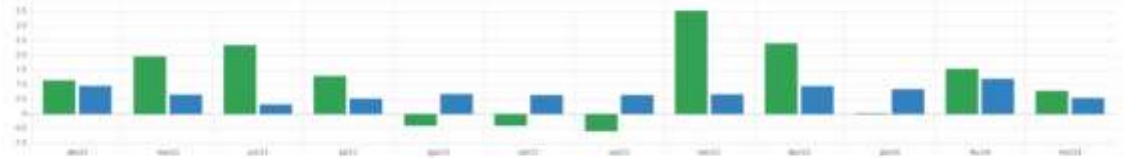
- ✓ Relatório de acompanhamento do cumprimento da meta atuarial do mês, do ano, e em diversas janelas de tempo como dos últimos 3 meses, dos últimos 6 meses, dos últimos 12 meses, dos últimos 24 meses



RENTABILIDADES DA CARTEIRA VERSUS META ATUARIAL

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ret. Anual
2024	0,00	1,34	0,79										2,93
ICPA + 3,00%	0,00	1,20	0,00										2,80
p.p. Intermédio	-0,00	0,14	0,79										0,13
2023	1,67	0,01	1,05	0,13	1,87	2,25	1,38	-0,40	-0,40	-0,28	3,33	2,41	14,62
ICPA + 5,00%	0,96	1,10	1,16	0,06	0,66	0,33	0,53	0,60	0,05	0,00	0,07	0,00	0,87
p.p. Intermédio	0,71	-1,09	-0,11	0,07	1,21	1,92	0,85	-1,00	-0,45	-0,28	3,26	2,41	13,75
2022	-0,10	0,40	2,58	-1,00	0,00	-2,40	5,00	0,98	-0,20	-2,18	-0,00	-0,01	3,80
ICPA + 4,80%	0,04	1,17	2,04	-0,40	0,00	-1,82	4,28	0,05	0,10	0,00	0,19	1,00	0,58
p.p. Intermédio	-0,28	0,23	0,54	-0,39	-0,00	-0,90	0,72	0,93	-0,30	-2,18	-0,00	-1,01	3,22
2021	-0,08	-0,44	1,07	1,57	1,10	0,27	-0,44	-0,47	-1,20	-0,00	1,19	1,00	1,80
ICPA + 5,41%	0,00	1,23	1,02	0,10	0,10	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
p.p. Intermédio	-1,08	-1,73	0,04	1,47	1,00	0,27	-0,44	-0,47	-1,20	-0,00	1,19	1,00	1,80
2020	0,63	-1,11	-0,01	0,40	0,00	0,00	0,00	-0,44	-1,17	-0,00	0,00	0,00	0,00
ICPA + 5,00%	0,71	0,46	0,17	0,14	0,00	0,74	0,00	0,12	1,10	1,14	1,10	1,00	3,00
p.p. Intermédio	-0,08	-1,57	-0,18	0,26	0,00	0,13	0,00	-1,56	-0,00	0,00	0,00	0,00	-0,00
2019	2,19	0,44	0,00	1,23	1,10	2,00	1,00	0,00	1,00	2,00	0,00	2,00	10,10
ICPA + 5,00%	0,00	0,00	1,10	1,10	0,00	0,40	0,70	0,00	0,00	0,00	0,00	1,00	0,00
p.p. Intermédio	2,19	0,44	-1,10	0,10	1,10	1,60	0,30	0,00	1,00	2,00	0,00	1,00	10,10
2018	0,14	0,19	0,00	0,30	-0,00	-0,00	1,10	0,10	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
ICPA + 6,00%	0,00	0,14	0,00	0,10	0,10	0,10	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
p.p. Intermédio	0,14	0,05	0,00	0,20	-0,10	-0,10	1,10	0,10	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

RENTABILIDADES MENSIS - 12 ÚLTIMOS MESES

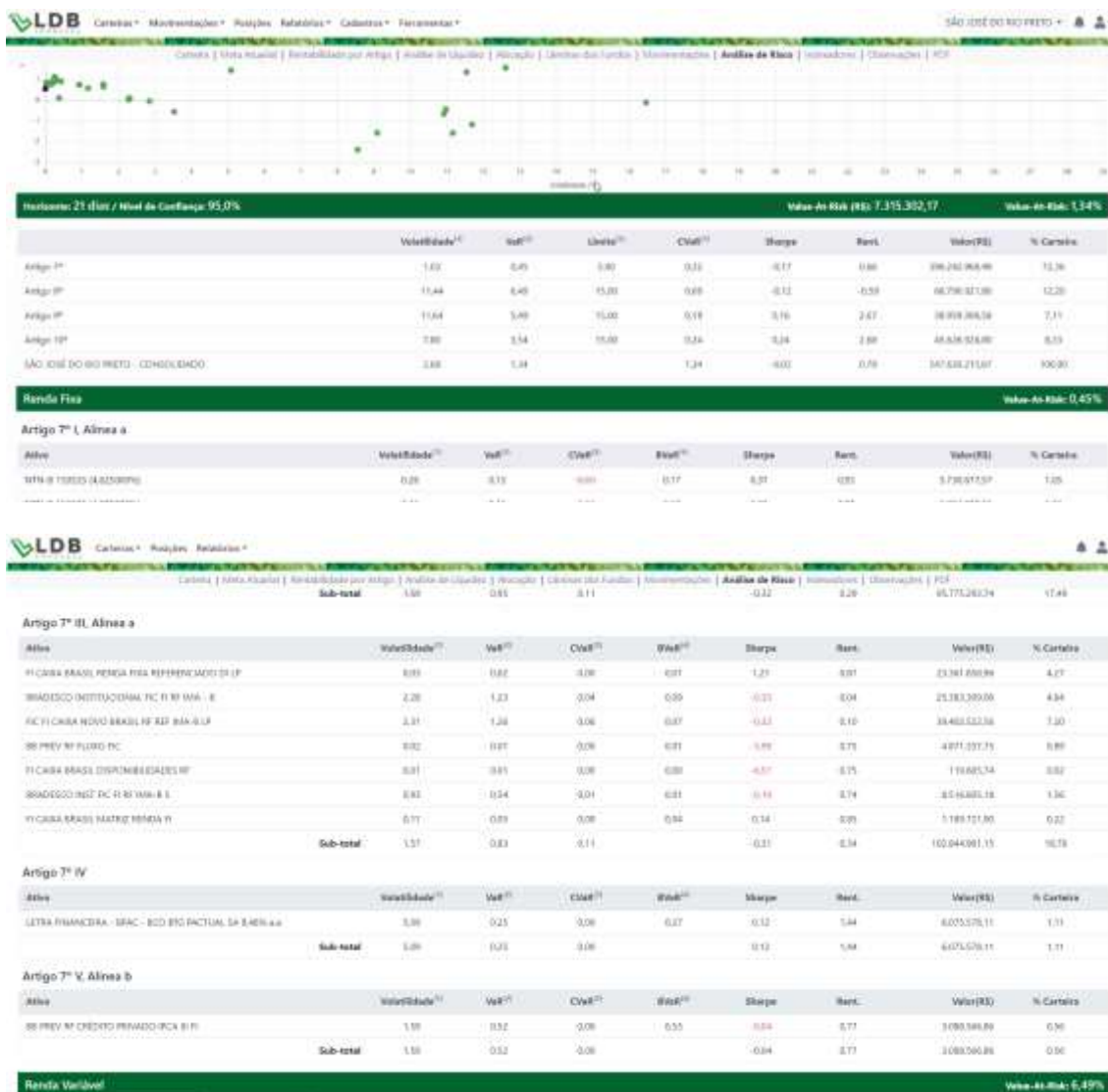


PERFORMANCE SOBRE O BENCHMARK

Quantidade	Perf. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Info.	Utilidade Anual	
Menor ativo - Meta Atuarial	35	06/07	03 meses	1,06	2,00	-0,94	2,07
Menor ativo - Meta Atuarial	40	12/12	06 meses	1,00	4,07	3,07	3,24
			12 meses	14,41	0,04	14,37	1,39
			24 meses	17,71	10,00	7,71	4,27
			36 meses	21,81	0,24	21,57	4,76
			48 meses	40,00	0,31	39,69	5,64
			60 meses	40,00	12,20	27,80	7,41
			Desde 29/10/2011	04,00	04,00	0,00	0,00

- ✓ Relatório de Gestão de Risco, que conste, de maneira individualizada por fundo, a volatilidade anualizada do ativo no período (%), o VaR (Value-at-Risk)(%), o Component VaR (%), o BVaR (Benchmark-Value at Risk)(%) e o índice Sharpe. Permitir, mediante solicitação, a alteração dos parâmetros das medidas de risco. Demonstrar, nos relatórios, informações sobre os parâmetros utilizados para a apuração das medidas de risco, contendo conceituação, modelagem, critério de escolha da amostra dos valores e memória de cálculo.





**LDB** Carteira\* | Posições | Atualizações\*

Carteira | Meta Alçada | Rentabilidade por Artigo | Análise de Usados | Abatido | Líquido dos Rendimentos | Monetização | Análise de Risco | Indicadores | Observações | PDE

MISIA FUNDI EQUITY Y FUNDING (FUNDOS DE INVESTIMENTO)	28,00	0,25	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	12,441.048	0,00
MISIA FUNDI EQUITY Y FUNDING (FUNDOS DE INVESTIMENTO)	0,37	0,20	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	11,079.848,84	2,11
<b>Sub-total</b>	<b>5,51</b>	<b>0,16</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>13.777.083,49</b>	<b>2,12</b>

**Investimentos no Exterior** Valor At. Risco: 5,49%

**Artigo 9º II**

Ativo	Valoridade <sup>(1)</sup>	Val <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Risk <sup>(4)</sup>	Sharpe	Ret.	Valor(R\$)	% Carteira
ISSAÇÕES NOROCCIDENTAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTMENT NO ESTERNO (I)	12,11	5,30	0,00	5,71	0,32	4,75	2.057.711,25	0,49
ISSAÇÕES GLOBAL SELECT EQUITY INVESTMENT NO ESTERNO (I)	1,68	6,92	0,00	5,47	0,31	3,84	303.084,27	0,15
ISSAÇÕES GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC NO INVESTIMENTO NO ESTERNO (I)	18,22	50,00	0,04	30,00	0,07	2,19	7.000.083,56	5,28
SANFANDER GO GLOBAL EQUITY ESG-REAS MULTIFUND (I)	0,54	4,70	0,00	4,10	0,26	3,33	2.715.167,01	1,42
<b>Sub-total</b>	<b>15,52</b>	<b>6,91</b>	<b>0,00</b>	<b>5,21</b>	<b>0,10</b>	<b>3,10</b>	<b>18.075.045,10</b>	<b>5,13</b>

**Artigo 9º III**

Ativo	Valoridade <sup>(1)</sup>	Val <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Risk <sup>(4)</sup>	Sharpe	Ret.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	12,38	5,51	0,00	0,56	0,21	3,48	2.023.273,53	1,28
WESTERN ASSET FIA BDR NIVEL I	1,01	6,40	0,00	0,44	0,06	3,57	11.037.861,45	0,01
ISSAÇÕES ESG GLOBAL FIC FIA - BDR NIVEL I	12,20	5,50	0,01	7,44	0,11	2,19	2.004.783,43	0,46
<b>Sub-total</b>	<b>12,58</b>	<b>5,80</b>	<b>0,01</b>	<b>8,12</b>	<b>0,12</b>	<b>3,28</b>	<b>26.121.000,18</b>	<b>3,78</b>

(1) Investimento declarado de acordo com o contrato (R\$)  
 (2) Valor de mercado (R\$) (3) Valor de mercado (R\$) (4) Valor de mercado (R\$)  
 (5) Valor de mercado (R\$) (6) Valor de mercado (R\$) (7) Valor de mercado (R\$)  
 (8) Valor de mercado (R\$) (9) Valor de mercado (R\$) (10) Valor de mercado (R\$)  
 (11) Valor de mercado (R\$) (12) Valor de mercado (R\$) (13) Valor de mercado (R\$)  
 (14) Valor de mercado (R\$) (15) Valor de mercado (R\$) (16) Valor de mercado (R\$)  
 (17) Valor de mercado (R\$) (18) Valor de mercado (R\$) (19) Valor de mercado (R\$)  
 (20) Valor de mercado (R\$) (21) Valor de mercado (R\$) (22) Valor de mercado (R\$)  
 (23) Valor de mercado (R\$) (24) Valor de mercado (R\$) (25) Valor de mercado (R\$)  
 (26) Valor de mercado (R\$) (27) Valor de mercado (R\$) (28) Valor de mercado (R\$)  
 (29) Valor de mercado (R\$) (30) Valor de mercado (R\$) (31) Valor de mercado (R\$)  
 (32) Valor de mercado (R\$) (33) Valor de mercado (R\$) (34) Valor de mercado (R\$)  
 (35) Valor de mercado (R\$) (36) Valor de mercado (R\$) (37) Valor de mercado (R\$)  
 (38) Valor de mercado (R\$) (39) Valor de mercado (R\$) (40) Valor de mercado (R\$)  
 (41) Valor de mercado (R\$) (42) Valor de mercado (R\$) (43) Valor de mercado (R\$)  
 (44) Valor de mercado (R\$) (45) Valor de mercado (R\$) (46) Valor de mercado (R\$)  
 (47) Valor de mercado (R\$) (48) Valor de mercado (R\$) (49) Valor de mercado (R\$)  
 (50) Valor de mercado (R\$) (51) Valor de mercado (R\$) (52) Valor de mercado (R\$)  
 (53) Valor de mercado (R\$) (54) Valor de mercado (R\$) (55) Valor de mercado (R\$)  
 (56) Valor de mercado (R\$) (57) Valor de mercado (R\$) (58) Valor de mercado (R\$)  
 (59) Valor de mercado (R\$) (60) Valor de mercado (R\$) (61) Valor de mercado (R\$)  
 (62) Valor de mercado (R\$) (63) Valor de mercado (R\$) (64) Valor de mercado (R\$)  
 (65) Valor de mercado (R\$) (66) Valor de mercado (R\$) (67) Valor de mercado (R\$)  
 (68) Valor de mercado (R\$) (69) Valor de mercado (R\$) (70) Valor de mercado (R\$)  
 (71) Valor de mercado (R\$) (72) Valor de mercado (R\$) (73) Valor de mercado (R\$)  
 (74) Valor de mercado (R\$) (75) Valor de mercado (R\$) (76) Valor de mercado (R\$)  
 (77) Valor de mercado (R\$) (78) Valor de mercado (R\$) (79) Valor de mercado (R\$)  
 (80) Valor de mercado (R\$) (81) Valor de mercado (R\$) (82) Valor de mercado (R\$)  
 (83) Valor de mercado (R\$) (84) Valor de mercado (R\$) (85) Valor de mercado (R\$)  
 (86) Valor de mercado (R\$) (87) Valor de mercado (R\$) (88) Valor de mercado (R\$)  
 (89) Valor de mercado (R\$) (90) Valor de mercado (R\$) (91) Valor de mercado (R\$)  
 (92) Valor de mercado (R\$) (93) Valor de mercado (R\$) (94) Valor de mercado (R\$)  
 (95) Valor de mercado (R\$) (96) Valor de mercado (R\$) (97) Valor de mercado (R\$)  
 (98) Valor de mercado (R\$) (99) Valor de mercado (R\$) (100) Valor de mercado (R\$)

**LDB** Carteira\* | Posições | Atualizações\*

**SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO** 30/01/2024

**VAR POR SEMESTRO**

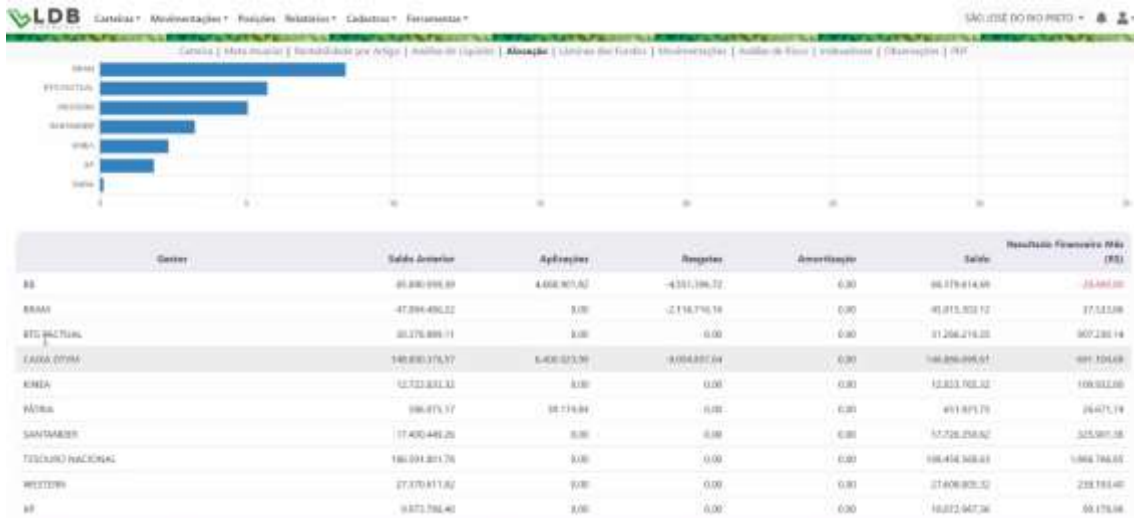
Segmento	Mar/24	Jun/24	Set/23	Dez/23	Mar/23	Jun/23
Renda Fixa	0,45	0,46	0,79	0,80	0,77	0,74
Renda Variável	0,40	0,18	0,22	0,39	0,34	0,33
Investimentos Estruturados	0,34	0,51	0,39	0,21	0,19	0,80
Investimentos no Exterior	0,89	0,86	0,23	0,24	0,52	0,79

**CVAR POR SEGMENTO**

Segmento	Mar/24	Jun/24	Set/23	Dez/23	Mar/23	Jun/23
Renda Fixa	0,22	0,22	0,43	0,43	0,40	0,30
Renda Variável	0,09	0,06	0,09	0,06	0,09	0,09
Investimentos Estruturados	0,24	0,29	0,29	0,26	0,24	0,30
Investimentos no Exterior	0,19	0,17	0,15	0,14	0,14	0,08
<b>Carteira</b>	<b>1,14</b>	<b>1,14</b>	<b>1,17</b>	<b>1,11</b>	<b>1,19</b>	<b>1,42</b>

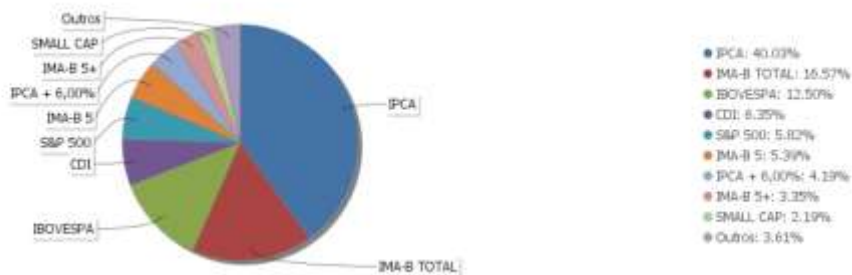
- ✓ Relatório de acompanhamento das aplicações com agregados por instituição financeira, com dados em valores e percentuais, para controle do cumprimento de itens da Política de Investimentos;





✓ Relatório de acompanhamento das aplicações com agregados por benchmark, com dados em valores e percentuais;

Alocação Por Estratégia



Nome do Fundo	12/17	12/18	12/19	12/20	12/21	12/22	12/23
BB FUND GLOBAL SELECT (2027) (ANUAL) (R\$) (R\$) (R\$)	2,07	15,55	11,58	22,89	25,66	28,77	21,74
BANAM FUNDOS	0,32	2,27	2,37	1,81	6,32	12,35	16,75
BTD FUNDOS (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$)	2,44	11,36	11,26	25,89	36,73	43,68	71,19
CAIXA FUNDOS	0,07	-2,42	-2,42	1,80	30,98	18,71	32,17
CAIXA FUNDOS AMERICANA (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$)	2,39	15,11	11,13	26,34	36,04	34,42	62,28
CDI	0,00	-2,35	-2,35	1,81	12,29	12,71	46,72
DANTANER DO GLOBAL SELECT (2027) (ANUAL) (R\$) (R\$) (R\$)	1,25	16,46	16,46	23,17	30,44	38,35	45,52
GLOBAL SELECT (2027) (ANUAL) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$)	0,00	-6,12	-6,12	1,81	11,33	11,39	46,81
GLOBAL SELECT (2027) (ANUAL) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$)	4,75	16,25	16,25	16,89	5,49	9,88	1,27
GLOBAL SELECT (2027) (ANUAL) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$)	1,80	-6,78	-6,78	2,21	5,46	6,24	9,27
KINIA PRIVATE BONDY Y FUNDOS INSTITUCIONAIS (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$) (R\$)	6,45	7,00	7,00	6,88	12,13	12,13	12,13
IPCA + 6,00%	7,53	6,11	6,11	-5,44	2,09	2,09	2,09
IBOVESPA	1,44	1,82	1,82	4,73	11,23	11,23	11,23
IPCA	1,39	2,89	2,89	4,20	6,11	6,11	6,11
IPCA + 6,00%	1,32	2,48	2,48	6,17	11,73	11,73	11,73



**LDB** Carteira • Monitorações • Posições • Relatórios • Cadastros • Ferramentas • SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

Carteira | Informações | Rentabilidades por Anos | Análise de Equilíbrio | Alocação | Limites das Títulos | Monitorações | Análise de Risco | Indicadores | Observações | PDF

Aplicação Carteira	Aplicação Liquidável	Regime Carteira	Regime Liquidável
0+0	0+0	0+0	0+0
Taxa Performance	Taxa Administração (%)	Artigo	Empadronado
	0,00	Artigo 7º do Anexo 2	Sim
Número de Cotas			
200			

**Rentabilidades**

Indicador: 031

Ano	Jan	Feb	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Sep	Out	Nov	Dez	Ret. Ano
2024	1,00	0,82	0,87										2,72

**LDB** Carteira • Monitorações • Posições • Relatórios • Cadastros • Ferramentas • SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

Carteira | Indicadores | Anos | PDF

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO 28/02/2024

**ALOCÇÃO POR INDICADOR**

Indicador	Mar/24	Fev/24	Jan/24	Dez/23	Nov/23	Out/23
CDI	6,79	6,00	6,09	6,93	5,97	5,27
Global BDR	1,29	1,24	1,18			
RENTOVIA	12,50	13,39	13,39	13,68	13,43	13,46
IMA-BL	5,29	5,35	5,37	5,31	5,41	5,43
IMA-B 3+	5,75	5,87	5,89	5,87	5,80	5,87
IMA-B TOTAL	76,07	76,42	76,24	76,23	76,29	76,08
IPCA	40,03	39,84	40,19	39,55	40,51	41,19
IPCA + 4,85%	4,19	4,31	4,00	3,94	4,02	3,96
MST-ACR	2,89	3,96	3,98	3,86	3,84	3,75
Dólar	0,85	0,85	0,98	0,99	0,96	0,98
ISF 900	5,82	5,82	5,38	5,25	5,19	4,82
SMALL CAP	2,79	2,59	2,56	2,71	2,67	2,47

- ✓ Relatórios de diligências de verificação dos lastros relativos aos títulos ou a papéis incluídos em operações estruturadas adquiridas por meio de veículos de investimento, e de acompanhamento sistemático da situação patrimonial, fiscal, comercial e jurídica das instituições investidas e do desempenho dos papéis por elas emitidos.

**LDB** Carteira • Monitorações • Posições • Relatórios • Cadastros • Ferramentas • SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

Filtrar por nome... Filtrar por info... Carteira

Papel	PL Informado	PL Alvo	Data	Funcionalidades
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	247.711.013,14		23/02/2024	
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	342.081.053,15		21/01/2024	
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	945.884.376,00		29/12/2023	
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	527.726.681,00		30/11/2023	

**LDB** Carteira • Monitorações • Posições • Relatórios • Cadastros • Ferramentas • SÃO JOSÉ DO RIO PRETO

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO 28/02/2024

- SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO
  - BRASILIA UNIO INC N 01 IMA-BL
  - SPRINT FI BY IMA-BL
  - SANTANDER DO GLOBAL EQUITY ESG READ INAT 20
  - FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP
  - WESTERN ASSET IMA-B 3+ ARRO FI RP
  - BE MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTMENT NO EXTERIO FI
  - FI CAIXA BRASIL IMA-B 3+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP
  - BE PREV FI IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI
  - CAIXA FI BRASIL 2024 VI 707 FI
  - IC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI
  - SANTANDER FI IMA-B 3+ PREMIUM FI FI
  - FI CAIXA BRASIL EST BONDEIRA
  - FI ENISA BRASIL RENDA FRA REFERENCIADO BI LP



**SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO**  
Data: 26/02/2024 PL 307.71101314

Títulos Públicos	330.105.243,63	60,27 %
Títulos Privados	26.201.841,15	4,78 %
Ações	49.665.069,58	9,07 %
Opções	0,00	0,00 %
Caixa	-154.634,96	-0,08 %
Cotas	146.056.054,90	26,67 %

CD	Descrição	Letra	Valor	Data	Valor	Valor
BDO DWDONV SA	LETRA FINANCEIRA	BDDWV0P037	DT	21/03/2024	17.021,21	6,07
BDO DWDONV SA	LETRA FINANCEIRA	BDDWV0P037	DT	05/03/2025	13.347,77	5,05
BDO DWDONV SA	LETRA FINANCEIRA	BDDWV0P032	DT	04/03/2024	2.377,33	0,91
BDO DWDONV SA	LETRA FINANCEIRA 1ª EMISSÃO SÉRIE 4	BDDWV0P023	DT	15/03/2024	14.790,01	5,06
BDO FIBSA SA	LETRA FINANCEIRA COM GARANTIA ESPECIAL DO FISC	BDFBDF0084	DT	06/03/2025	11.582,27	3,94
BDO GMAC SA	LETRA FINANCEIRA	BBDGVAL027	DT	13/03/2024	15.857,96	5,13
BDO GMAC SA	LETRA FINANCEIRA	BBDGVAL003	DT	05/03/2025	27.079,32	8,16
BDO GMAC SA	LETRA FINANCEIRA	BBDGVAL047	DT	06/07/2024	35.330,07	10,71
BDO GMAC SA	LETRA FINANCEIRA 1ª EMISSÃO SÉRIE 1	BBDGVAL002	DT	28/03/2025	1.927,84	0,61
BDO GMAC SA	LETRA FINANCEIRA 1ª EMISSÃO 1ª SÉRIE	BBDGVAL003	DT	07/03/2024	25.197,14	7,61
BDO ITAL SA	LETRA FINANCEIRA	BBDITVAL036	DT	01/03/2024	3.403,81	1,03

CD	Descrição	Letra	Valor	Data	Valor	Valor						
62220097	DT	0,81	300,00	N	12/09/2022	02/05/2024	BDO FAZISA	106.301,35	128.078,19	0,90	0,00	8.107,26
62220097	DT	0,99	300,00	N	12/09/2022	04/03/2024	BDO BRADISCO SA	110.942,25	129.124,83	0,47	0,00	81.097,17
62220097	DT	0,90	314,00	N	03/11/2018	23/12/2024	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	300.000,00	307.942,77	0,95	0,00	48.244,15
62220097	DT	1,17	300,00	N	27/05/2021	24/05/2024	ES SA - SPAN, BOLSA, SAUCAO	1.000,00	1.023,32	0,96	0,00	82.966,27
62220097	DT	0,81	300,00	N	27/09/2025	23/05/2027	UBINAS SUPERPRODUTAS MINAS GERANIS SA USIMIN	1.000,51	1.034,27	7,26	0,00	7.396,58
62220097	DT	0,69	300,00	N	29/11/2022	23/10/2024	BDO BRADISCO SA	101.396,66	116.189,88	0,10	0,00	18.861,87
62220097	DT	1,60	300,00	N	13/03/2022	25/02/2027	LOGAN DA REI A CIA SA	1.000,00	1.081,71	18,87	0,00	18.801,76
62220097	DT	1,79	300,00	N	18/03/2025	15/03/2028	BDO DATONVA SA	83.341,19	72.345,85	0,19	0,00	13.147,77
62220097	DT	0,00	300,00	N	27/12/2022	05/09/2028	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	12.862,50	14.528,77	0,79	0,00	11.488,69
62220097	DT	1,00	300,00	N	28/06/2022	23/12/2025	BDO BRADISCO SA	99.252,41	95.683,48	2,32	0,00	311.105,04
62220097	DT	1,80	300,00	N	29/11/2022	24/10/2024	BDO BEM SA	101.322,20	118.739,64	0,88	0,00	9.474,34
62220097	DT	0,90	300,00	N	29/11/2022	23/10/2024	BDO DATONVA SA	101.422,82	118.581,89	0,14	0,00	17.021,21
62220097	DT	1,80	300,00	N	12/09/2022	12/09/2024	BDO MERCANTIL BRASUL SA	10.900.000,00	12.282.258,57	0,80	0,00	19.436,25
62220097	DT	0,90	306,21	N	28/02/2022	15/05/2024	BDO DATONVA SA	262.323,60	301.640,54	0,92	0,00	7.637,99
62220097	DT	0,50	300,00	N	18/02/2024	17/02/2025	BDO ARDINASS SA	1.000,00	1.063,98	20,57	0,00	20.694,22
62220097	DT	0,90	300,00	N	28/08/2022	08/10/2024	BDO CNH CARRAL SA	30.000,00	66.167,28	0,72	0,00	43.022,05
62220097	DT	0,12	300,00	N	05/12/2023	01/03/2027	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	14.106,34	14.477,41	31,43	0,00	436.206,82
62220097	DT	0,17	300,00	N	01/06/2023	01/03/2027	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	11.628,24	14.477,41	0,96	0,00	916,41
62220097	DT	0,08	300,00	N	01/06/2023	01/03/2024	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	11.732,92	14.503,81	0,18	0,00	2.298,25
62220097	DT	0,01	300,00	N	25/04/2018	01/03/2024	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	8.488,78	14.523,61	3,90	0,00	90.414,23
62220097	DT	0,01	300,00	N	01/09/2023	01/09/2024	SECRETARIA TESOURO NACIONAL	12.096,30	14.523,33	0,53	0,00	7.769,34



Salvamento Automático | sao-jose-do-rio-preto | Você está visualizando a tela de Marcos | Visualizar Opções

Arquivo | Página Inicial | Inserir | Layout da Página | Fórmulas | Dados | Revisão | Exibir | Automate | Ajuda

Área de Transferência | Ferras | Alinhamento | Número | Estilos

A04 | NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS

	A	B	C	D	E	F	G	H
7	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	1.229.966,00	0,22					
8	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	1.068.399,90	0,20					
9	BCO DAYCOVAL SA	1.061.337,15	0,19					
10	BCO ABC BRASIL SA	1.012.412,88	0,18					
11	BCO SAFRA SA	748.277,42	0,14					
12	PARANA BCO SA	742.321,56	0,14					
13	COSAN SA	649.927,16	0,12					
14	VAMOS LOCAÇÃO DE CAMINHÕES, MAQUINAS E EQUIPAMEN	618.705,35	0,11					
15	BCO BTG PACTUAL SA	356.076,82	0,07					
16	BCO CITIBANK SA	337.908,17	0,06					
17	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS	254.257,28	0,05					
18	BCO VOLKSWAGEN SA	243.946,03	0,04					
19	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	235.474,72	0,04					
20	BCO VOTORANTIM SA	198.876,56	0,04					
21	MOVIDA PARTICIPACOES	194.617,56	0,04					
22	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG	157.936,61	0,03					
23	3R PETROLEUM ÓLEO E GÁS S.A.	137.306,65	0,03					
24	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	126.248,95	0,02					
25	BCO GMAC SA	127.361,06	0,02					
26	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI	124.301,11	0,02					
27	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA	123.392,91	0,02					
28	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D	121.833,56	0,02					
29	TIM BRASILEIRAS TELECOMUNICACOES SA	119.148,23	0,02					

Salvamento Automático | sao-jose-do-rio-preto | Você está visualizando a tela de Marcos | Visualizar Opções

Arquivo | Página Inicial | Inserir | Layout da Página | Fórmulas | Dados | Revisão | Exibir | Automate | Ajuda

Área de Transferência | Ferras | Alinhamento | Número | Estilos

A36 | BRTUPY085003

	A	B	C	D	E	F	G	H
18	BRTUPY085003	DEBENTURE	TUPY SA	S&P	AAA	601,54		
19	BRSANBLF026	LETRA FINANCEIRA	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	MOODY'S	AAA	282.019,09		
21	BRNTSD065063	DEBENTURE	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS			31.783,04		
22	BRBITALFND06	LETRA FINANCEIRA	BCO ITAU SA	FITCH	AAA	28.968,94		
23	BRQPAD085086	DEBENTURE	EQUATORIAL PARÁ DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	S&P	AAA	5.442,77		
24	BRBPACLFNK62	LETRA FINANCEIRA	BCO BTG PACTUAL SA	MOODY'S	AAA	26.881,88		
25	BRIDELFL067	LETRA FINANCEIRA	BCO JOHN DEERE SA	FITCH	AAA	13.000,94		
26	BRBCOMLF18U3	LETRA FINANCEIRA	BCO GMAC SA	FITCH	AAA	27.079,32		
27	BRMBE0P1540	DPCE - Garantia FCC	BCO MERCANTIL BRASIL SA			17.560,66		
28	BRNTSD065030	DEBENTURE	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	FITCH	AAA	22.899,23		
29	BRBCOMLF1883	LETRA FINANCEIRA	BCO GMAC SA	FITCH	AAA	23.853,63		
30	BRASAD065051	DEBENTURE	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	FITCH	AAA	51.887,24		
31	BRPETRINC0001	NOTA COMERCIAL ESCRITURAL 1ª EMISSÃO 1ª SE	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS			176.163,64		
32	BRCPGTINC0008	NOTA COMERCIAL ESCRITURAL 1ª EMISSÃO SERIE COPEL	GERACAO TRANSMISSAO SA			31.405,54		
33	BRBCEFC04H17	CDI	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF			173.382,86		
34	BRCCRO0850M3	DEBENTURE	CCR SA	S&P	AAA	70.851,12		
35	BRCCRO0850I9	DEBENTURE	CCR SA	MOODY'S	AA	24.228,50		
36	BRTUPY085003	DEBENTURE	TUPY SA	S&P	AAA	4.603,29		
37	BRDCLSC00326	CDI	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA			17.473,31		
38	BRSANBLFN013	LETRA FINANCEIRA	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	MOODY'S	AAA	214.979,15		
39	BRBBDCLFC290	LETRA FINANCEIRA	BCO BRADESCO SA	S&P	AAA	184.306,43		
40	BRBTOYLF2J5	LETRA FINANCEIRA	BCO TOYOTA BRASIL SA	S&P	AAA	56.341,42		



- BB TOP ESPELHO AÇÕES TRIGONO PARTHENON FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA
- BB TOP ESPELHO AÇÕES TRIGONO FLAGSHIP 60 SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
- BB TOP ACOES IBOVESPA ATIVO FUNDO INVEST
- FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I
  - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER CONSERVADOR REN
- BB PREV RF FLUXO FIC
  - BB TOP RF TPF FI
- CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP
- KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA
  - KINEA PRIVATE EQUITY V MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES
- BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO
- BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B
  - BRAM FI RF IMA B
- **BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI**
  - **BB TOP RENDA FIXA JUROS BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO LONGO PRAZO**
- EL CAIXA BRASL MATRIZ RENDA FI



- ✓ Relatório de acompanhamento da implementação das estratégias de carteiras específicas

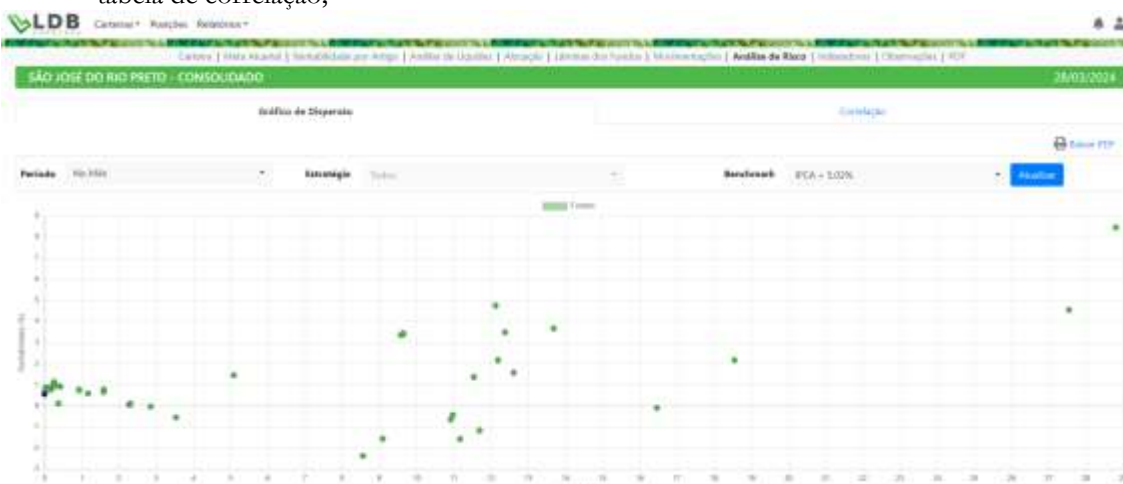
para os compromissos do plano com seus segurados e beneficiários;

**LDB** Carteira - Resgates - Relatório

Carteira | Histórico | Rentabilidade por Artigo | Análise de Usúrios | Alocação | Últimos 100 Fundos | Monitoramento | Análise de Risco | Indicadores | Observações | PDF

Artigo	Tipo de Ativo	Valor (R\$)	% Carteira	Público de Investimentos			ALM	Linha Legal
				Médios	Objetivo	Mistos		
<b>Bando Fixo</b>								
Artigo 1º I, Alínea a	Título de Seguro Nacional	186.458.508,81	34,41	-0,00	22,00	40,00	36,00	700,00
Artigo 1º I, Alínea b	Fundo UBS Titulo Público	30.775.293,74	5,74	10,00	10,00	10,00	22,33	100,00
Artigo 1º II, Alínea a	Fundo RendiaFixa	102.804,46	0,19	-0,00	15,50	60,00	16,40	80,00
Artigo 1º II	Ativos de Renda Fixa Exce Financeira	6.073.378,11	1,11	0,00	1,40	10,00	1,10	20,00
Artigo 1º V, Alínea II	FI-FI - Crédito Privado	3.888.506,86	0,72	-0,00	0,00	3,00	0,00	20,00
<b>Total Bando Fixo</b>		<b>299.220.891,98</b>	<b>52,08</b>					
<b>Bando Variável</b>								
Artigo 1º I	Fundo de Ações	66.790.821,00	12,20	-0,00	12,00	30,00	4,92	20,00
<b>Total Bando Variável</b>		<b>66.790.821,00</b>	<b>12,20</b>					
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 1º II	Fundo de Investimento no Exterior	18.237.472,59	3,33	-0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 1º III	Fundo de Ações - RDR Nivel 1	20.771.926,39	3,79	-0,00	4,00	10,00	3,00	10,00
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		<b>39.009.398,98</b>	<b>7,12</b>					
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 1º I F	Fundo Multimercado	71.889.803,01	13,22	-0,00	7,50	13,00	1,50	15,00
Artigo 1º I F	Fundo de Participação	13.771.001,40	2,52	-0,00	1,00	0,00	2,50	15,00
<b>Total Investimentos Estruturados</b>		<b>85.660.804,41</b>	<b>15,74</b>					

✓ Relatório de dispersão Risco-Retorno dos fundos de investimentos, gráfico de dispersão e tabela de correlação;



**LDB** Carteira • Posições • Relatórios

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO 28/03/2024

Ativo

Ativo	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	
1 - LETRA FINANÇEIRA - BANC - BDO BDO FUNDAL SA-8476-44	1,00	0,15	0,37	0,08	0,19	0,27	0,38	0,28	0,23	0,29	0,23	0,32	0,33	0,17	0,26	0,27	0,28	0,28	0,28	0,32	0,30	0,27	0,27
2 - FII PREV FII CREDITO PRIVADO PGB II FII	0,15	1,00	0,07	-0,08	-0,09	0,07	0,08	-0,01	0,05	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,08	0,07	0,09	0,08	0,08	0,08	-0,09	0,07	0,07
3 - NTN-B 150443 (3.800000%)	0,27	0,07	1,00	0,28	0,28	1,00	1,00	0,90	0,99	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,99	0,99	1,00
4 - NTN-B 150545 (3.750000%)	0,08	-0,08	0,28	1,00	0,17	0,28	0,30	0,21	0,21	0,20	0,20	0,22	0,22	0,20	0,21	0,20	0,20	0,20	0,20	0,19	0,17	0,17	0,20
5 - NTN-B 150624 (3.270000%)	0,10	-0,09	0,55	0,17	1,00	0,91	0,98	0,96	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94
6 - NTN-B 150545 (3.800000%)	0,27	0,07	1,00	0,29	0,21	1,00	1,00	0,90	0,99	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,99	0,99	1,00
7 - NTN-B 150533 (3.210000%)	0,28	0,08	1,00	0,29	0,48	1,00	1,00	0,90	0,99	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,99	0,99	1,00
8 - NTN-B 150525 (3.600000%)	0,08	-0,07	0,99	0,21	0,98	0,98	0,96	1,00	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94	0,94
9 - NTN-B 150545 (3.870000%)	0,25	0,05	0,39	0,21	0,64	0,98	0,98	0,94	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,99	0,94	0,94	0,99
10 - NTN-B 150630 (3.617000%)	0,28	0,08	1,00	0,29	0,48	1,00	1,00	0,90	0,99	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,99	0,99	1,00
11 - NTN-B 150533 (3.427000%)	0,28	0,08	0,99	0,21	0,64	0,98	0,98	0,94	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,99	0,94	0,94	0,99
12 - NTN-B 150533 (3.100000%)	0,28	0,08	1,00	0,29	0,48	1,00	0,99	0,92	1,00	0,99	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	1,00	0,99	0,99	0,99	1,00

- ✓ Relatório de liquidez com os prazos de emissão, carência e resgate de cotas de todos os Fundos de Investimentos e ativos que compõem a carteira de investimentos da RIOPRETOPREV, identificados um a um e também com no mínimo três agrupamentos sendo eles “disponíveis de 0 até 30 dias”, outro de “31 a 365 dias” e “acima de 365 dias”, para fins de atendimento de item da Política de Investimentos.

**LDB** Carteira • Investimentos • Posições • Relatórios • Cálculos • Ferramentas

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO 28/03/2024

ANÁLISE DE LIQUIDEZ

Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo (%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Alínea	(%) Limite Mínimo Alínea
de 0 a 30 dias	118.228.760,14	58,08	40,00	118.228.760,14	58,08	40,00
de 31 dias a 365 dias	54.528.706,34	27,04	40,00	164.568.296,48	85,12	40,00
acima de 365 dias	19.021.948,15	9,88	40,00	347.627.215,67	100,00	40,00

DE 0 A 30 DIAS

Ativo	Liquidez	Valor (R\$)
BB PREV FII FUND FII	D+E	4.871.217,75
FII CASA BRASIL DISPONIBILIDADES FII	D+E	119.805,14
FII CASA BRASIL SA E FII TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+E	62.238.614,14
FII CASA BRASIL SA E FII TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+E	1.803.170,94
FII CASA BRASIL MATRIZ MENSA FII	D+E	1.100.711,50
FII CASA BRASIL VENDA DEB-INTERMEDIÁRIO DI LP	D+E	21.261.812,06
FII CASA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+E	3.071.978,27
FIC DE FII CASA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+E	10.824.817,51
FIC FII CASA BRASIL BRASIL RF REF INAV-B LP	D+E	39.402.522,36
BB PREV FII BALK TÍTULOS PÚBLICOS FII	D+E	45.796.548,37

**LDB** Carteira • Investimentos • Posições • Relatórios • Cálculos • Ferramentas

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO 28/03/2024

COTIZAÇÃO E LIQUIDAÇÃO

Fundo	CNPJ	Aplicação Cotação	Aplicação Liquidação	Resgate Cotação	Resgate Liquidação
LETRA FINANÇEIRA - BANC - BDO BDO FUNDAL SA-8476-44					
BB PREV FII CREDITO PRIVADO PGB II FII	14.091.448/0001-81	D+E	D+E	D+E	D+E
NTN-B 150443 (3.800000%)					
NTN-B 150545 (3.750000%)					
NTN-B 150624 (3.270000%)					
NTN-B 150545 (3.800000%)					
NTN-B 150533 (3.210000%)					
NTN-B 150525 (3.600000%)					
NTN-B 150545 (3.870000%)					
NTN-B 150630 (3.617000%)					
NTN-B 150533 (3.427000%)					



- ✓ Relatório da Análise de Stress Histórico, para determinada data inicial e data final escolhida, apresentando para cada um dos fundos de investimentos que compõe a carteira do RPPS, os respectivos valores de Perda (em R\$ e em %) e de Ganho (em R\$ e em %), apresentando a consolidação não só por artigo como também por segmento da Resolução CMN n° 4.963/2021, e, ainda, para a carteira consolidada do RPPS;



**SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO**

**ANÁLISE DE STRESS**

Carteira: [ ] Data Inicial: 20/11/2021 Data Final: 28/11/2021

Perda/Ganho Líquido (R\$): 547.620.215,67 Perda/Ganho (R\$): 28.074.528,35 (5,13%)

**Renda Fixa** Perda/Ganho (R\$): 14.191.191,79 (2,30%)

Artigo 7º | Alínea a

Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
NTN-8 (10015) (4,82000%)	1.730.611,97	1,01	1,74	274.366,91	0,04
NTN-8 (10025) (4,87000%)	1.794.218,83	1,06	1,76	277.210,88	0,04
NTN-8 (10025) (4,86000%)	2.091.275,63	1,26	1,70	275.616,86	0,04

**SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO**

**ANÁLISE DE STRESS**

Carteira: [ ] Data Inicial: 27/03/2024 Data Final: 28/03/2024

Perda/Ganho Líquido (R\$): 547.620.215,67 Perda/Ganho (R\$): 5.030.533,50 (0,92%)

**Renda Fixa** Perda/Ganho (R\$): 3.257.368,51 (0,59%)

Artigo 7º | Alínea a

Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Variação (%)	Perda/Ganho (R\$)	Perda/Ganho (%)
-------	------------	------------	--------------	-------------------	-----------------

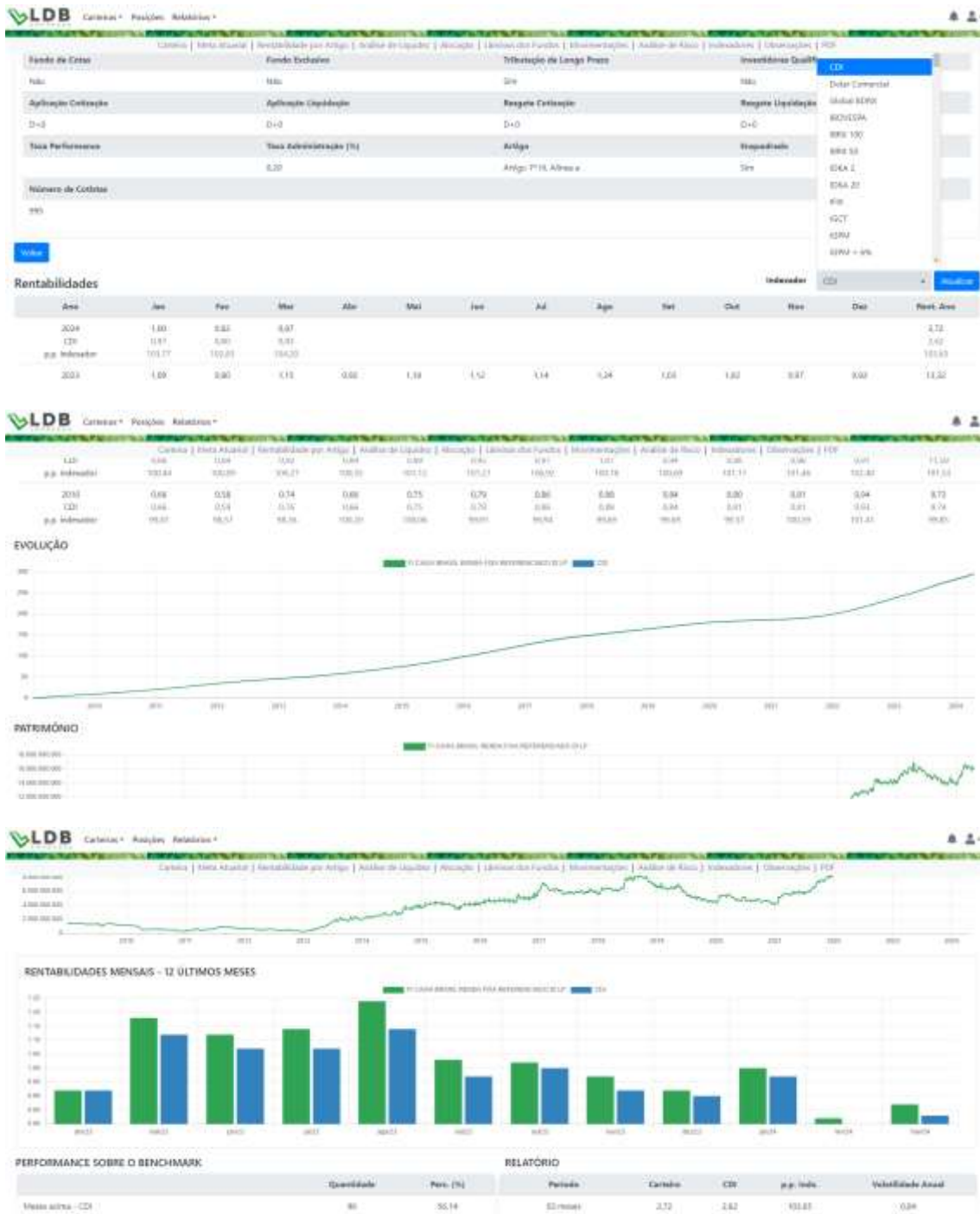
- ✓ Relatório de lâmina de cada um dos fundos de investimentos que o RPPS possui os seus recursos alocados, apresentando as informações disponíveis pela CVM, tais como: denominação social, classe CVM, CNPJ do Fundo, nome do administrador e seu respectivo CNPJ, nome do gestor e seu respectivo CNPJ, se é fundo de cotas, se é fundo exclusivo, se possui tributação de longo prazo, se é destinado a investidores qualificados, Prazo de Cotização da Aplicação, Prazo de Liquidação da Aplicação, Prazo de Cotização do Resgate, Prazo de Liquidação do Resgate, percentual da taxa de performance, percentual da taxa de administração, Artigo da Resolução CMN n° 4.963/21, Se o fundo está enquadrado ou não perante a Resolução CMN n° 4.963/21 e número de cotistas do fundo. A lâmina deve ainda apresentar, além da rentabilidade mensal do fundo comparada com o seu respectivo benchmark (parâmetro de referência) desde o primeiro dia de existência de cota do fundo até os dias atuais de análise do relatório. Deverá ainda apresentar quantos meses o fundo conseguiu superar o seu benchmark e quantos meses o fundo não conseguiu superar o seu benchmark, apresentando, por fim, um gráfico com a

evolução da rentabilidade diária do fundo de investimento vis a vis seu benchmark, consolidando desde a data da primeira cota do fundo, sendo que o sistema deverá propiciar a escolha de vários benchmarks distintos que não seja apenas o benchmark do fundo, tais como a própria “Meta Atuarial” do RPPS, ou os demais parâmetros de mercado do segmento de renda fixa (Selic, CDI e benchmarks da Anbima), do segmento de renda variável (Ibovespa, IBrX 100, IBrX 50, SMLL e Dividendos) e do segmento de investimentos no exterior (MSCI AC, S&P500). Apresentar um gráfico da evolução diária do Patrimônio Líquido do Fundo desde a data de sua criação. A lâmina deve ainda, por fim, apresentar a consolidação da rentabilidade do fundo comparada com o benchmark escolhido, para as seguintes janelas de tempo: 3 meses, 6 meses, 12 meses, 24 meses, 36 meses, 48 meses e 60 meses;

DADOS DO FUNDO			
<b>Denominação Social</b>	<b>Classe CVM</b>	<b>CMV</b>	
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI (LÍQUIDO PAÍSO)	Fundo de Renda Fixa	05.217.058/0001-97	
<b>Administrador</b>	<b>CNPJ</b>	<b>Gerente</b>	<b>CMV</b>
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	08.040.535/0001-04	CAIXA INSTITUCIONAL DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A.	42.000.618/0001-40
<b>Fundo de Cotas</b>	<b>Fundo Substituto</b>	<b>Tributação de Longo Prazo</b>	<b>Investimentos Qualificados</b>
Não	Não	Sim	Não
<b>Aplicação Corretiva</b>	<b>Aplicação Liquidatória</b>	<b>Resgate Corretiva</b>	<b>Resgate Liquidatória</b>
D+0	D+0	D+0	D+0
<b>Taxa Performance</b>	<b>Taxa Administração (%)</b>	<b>Artigo</b>	<b>Inquilinato</b>
	0,23	Artigo 7º do Anexo e	Sim
<b>Número de Cotas</b>	99		

Rentabilidades													
	Jan	Feb	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Ret. Anu
2024	1,00	0,82	0,97										3,72
CDI	0,97	0,80	0,91										3,32
p.p. Indexador	100,77	100,03	100,23										100,00
2023	1,09	0,80	1,19	0,50	1,14	0,12	1,14	1,24	1,05	1,01	0,97	0,92	10,52
CDI	1,12	0,82	1,11	0,50	1,12	1,09	1,07	1,14	1,09	1,00	0,92	0,90	10,05
p.p. Indexador	97,47	97,07	97,37	100,00	100,00	104,30	106,45	108,80	102,36	101,04	100,00	100,11	100,00
2022	0,79	0,32	0,91	0,86	1,09	1,06	1,01	1,19	1,11	1,03	1,00	1,10	12,07
CDI	0,75	0,75	0,92	0,80	1,03	0,91	1,01	1,17	1,07	1,00	1,00	1,10	10,20
p.p. Indexador	107,46	104,17	101,44	99,97	104,47	104,44	107,36	101,96	101,00	99,11	100,00	100,00	100,00
2021	0,46	0,00	0,10	0,26	0,14	0,31	0,49	0,49	0,93	0,50	0,82	0,75	4,80
CDI	0,10	0,10	0,20	0,21	0,27	0,39	0,18	0,42	0,44	0,40	0,20	0,70	4,40
p.p. Indexador	100,14	11,30	46,83	100,00	99,90	99,00	107,00	110,70	100,00	99,00	100,00	100,00	100,00





- ✓ Relatório de Análise da Abertura de Carteira através do Arquivo XML da ANBIMA, para realização de relatórios de diligências.





Emprego	Classe	Salário	Plano	Regime	Data Início	Data Fim	Empresa	Valor	Outros	Total
02220097	DI	0,61	300,00	N	12/09/2022	02/05/2024	BCO FAZSA	106.001,35	128.078,49	0,00
02220078	DI	0,59	300,00	N	12/12/2022	04/02/2024	BCO BRASCO SA	110.642,29	129.124,83	0,47
02220082	NE	0,80	114,00	N	03/11/2019	23/12/2024	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF	300.000,00	307.542,77	0,16
02220081	DI	1,17	300,00	N	27/05/2021	24/05/2024	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO	1.000,00	1.033,23	80,96
02220083	DI	2,81	300,00	N	27/05/2022	23/05/2027	UBISA SIDERURGICAS MINAS GERAIS S A USIMIN	1.033,51	1.038,27	7,26
02220084	DI	0,65	300,00	N	29/11/2022	23/10/2024	BCO BRADCO SA	101.396,66	116.189,88	0,10
02220085	DI	1,40	300,00	N	11/03/2022	25/02/2027	UDISA SIDERURGICAS A C S A	1.000,00	1.001,31	18,87
02220086	DI	1,29	300,00	N	18/02/2022	05/02/2027	BCO DAYCOVAL SA	62.241,19	72.245,89	0,18
02220087	DI	0,80	300,00	N	27/12/2022	01/09/2027	SECRETARIA TESOUREIRO NACIONAL	12.862,50	14.528,77	0,29
02220088	DI	1,90	300,00	N	28/06/2022	23/12/2027	BCO BRADCO SA	99.252,21	99.583,48	2,32
02220089	DI	1,80	300,00	N	29/11/2022	24/10/2024	BCO BEM SA	101.322,50	118.738,64	0,04
02220090	DI	0,90	300,00	N	29/11/2022	23/10/2024	BCO DAYCOVAL SA	101.422,62	119.581,89	0,24
02220091	DI	1,80	300,00	N	12/09/2022	12/09/2024	BCO MERCANTIL BRASIL SA	10.900.000,00	12.292.598,97	0,00
02220092	DI	0,90	306,21	N	28/02/2022	15/02/2024	BCO DAYCOVAL SA	265.522,60	300.466,54	0,00
02220093	DI	0,50	300,00	N	16/02/2024	17/02/2025	COOPAR BRASIL SA	1.000,00	1.000,00	20,17
02220094	DI	0,90	300,00	N	28/09/2022	08/10/2024	BCO CRI CARRAL SA	50.000,00	66.167,29	0,72
02220095	DI	0,12	300,00	N	05/12/2022	01/02/2027	SECRETARIA TESOUREIRO NACIONAL	14.106,26	14.477,41	31,43
02220096	NE	0,17	300,00	N	01/09/2022	05/09/2027	SECRETARIA TESOUREIRO NACIONAL	11.639,24	14.477,41	0,00
02220097	DI	0,80	300,00	N	01/09/2022	05/09/2024	SECRETARIA TESOUREIRO NACIONAL	11.792,92	14.823,81	0,18
02220098	DI	0,81	300,00	N	25/02/2018	01/02/2024	SECRETARIA TESOUREIRO NACIONAL	8.488,78	11.222,51	1,80
02220099	DI	0,00	300,00	N	01/09/2022	01/09/2024	SECRETARIA TESOUREIRO NACIONAL	12.066,28	14.329,23	0,53

Emprego	Classe	Salário	Plano	Regime	Data Início	Data Fim	Empresa	Valor	Outros	Total
7	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF							1.229.966,00	0,22	
8	BCO SANTANDER (BRASIL) SA							1.058.399,90	0,20	
9	BCO DAYCOVAL SA							1.061.337,15	0,19	
10	BCO ABC BRASIL SA							1.012.412,88	0,18	
11	BCO SAFRA SA							746.277,42	0,14	
12	PARANA BCO SA							742.321,56	0,14	
13	COSAN SA							649.927,16	0,12	
14	VAMOS LOCACAO DE CAMINHÕES, MAQUINAS E EQUIPAMEN							618.705,35	0,11	
15	BCO BTG PACTUAL SA							356.076,82	0,07	
16	BCO CITIBANK SA							337.908,17	0,06	
17	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS							254.257,28	0,05	
18	BCO VOLKSWAGEN SA							243.946,03	0,04	
19	B3 SA - BRASIL, BOLSA, BALCAO							235.474,72	0,04	
20	BCO VOTORANTIM SA							198.876,56	0,04	
21	MOVIDA PARTICIPACOES							194.617,56	0,04	
22	CIA SANEAMENTO MINAS GERAIS COPASA MG							157.938,61	0,03	
23	3R PETROLEUM OLEO E GAS S.A.							137.306,65	0,03	
24	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS							126.248,95	0,02	
25	BCO GMAC SA							127.361,06	0,02	
26	BCO COOPERATIVO SICREDI SA BANSICREDI							124.301,11	0,02	
27	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA							123.392,91	0,02	
28	CELG DISTRIBUICAO SA CELG D							121.833,56	0,02	
29	TIM BRASIL SERVICOS E PARTICIPACOES SA							121.348,00	0,02	

Seu navegador está atualizado automaticamente. Você está visualizando a tela de Marcas

Arquivo Página Inicial Inserir Layout da Página Fórmulas Dados Revisão Exibir Automate Ajuda

Área de Trabalho: BRUFUPY085003

	A	B	C	D	E	F
19	BRUFUPY085003	DEBENTURE	TUPY SA	S&P	AAA	601,94
20	BRSANBLF0298	LETRA FINANCEIRA	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	MOODY'S	AAA	282.019,09
21	BRINTSD085063	DEBENTURE	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS			31.783,04
22	BRBTLFND096	LETRA FINANCEIRA	BCO ITAU SA	FITCH	AAA	28.358,94
23	BRQCPAD085086	DEBENTURE	EQUATORIAL PARA DISTRIBUIDORA DE ENERGIA S.A.	S&P	AAA	9.442,77
24	BRBPACL7NA62	LETRA FINANCEIRA	BCO BTG PACTUAL SA	MOODY'S	AAA	26.881,89
25	BRIDEELF0E27	LETRA FINANCEIRA	BCO JOHN DEERE SA	FITCH	AAA	13.020,94
26	BRBCOMLF1803	LETRA FINANCEIRA	BCO GMAC SA	FITCH	AAA	27.079,32
27	BRBMEBDP1548	DÍGEE - Garantia FOC	BCO MERCANTIL BRASIL SA			17.560,00
28	BRINTSD085030	DEBENTURE	NOVA TRANSPORTADORA SUDESTE SA - NTS	FITCH	AAA	22.899,23
29	BRBCOMLF1883	LETRA FINANCEIRA	BCO GMAC SA	FITCH	AAA	23.853,63
30	BRASAID085061	DEBENTURE	SENDAS DISTRIBUIDORA S.A.	FITCH	AAA	61.887,24
31	BRPETRINC0001	NOTA COMERCIAL ESCRITURAL 1ª EMISSÃO 1ª SE	PETROLEO BRASILEIRO SA PETROBRAS			176.163,64
32	BRICPGINC0008	NOTA COMERCIAL ESCRITURAL 1ª EMISSÃO SERIE	COPEL GERACAO TRANSMISSAO SA			81.405,54
33	BRBCEFC08H17	CDR	CAIXA ECONOMICA FEDERAL CEF			173.382,86
34	BRCCROD0850M3	DEBENTURE	CCR SA	S&P	AAA	70.851,12
35	BRCCROD0850B9	DEBENTURE	CCR SA	MOODY'S	AA	24.228,50
36	BRUFUPY085003	DEBENTURE	TUPY SA	S&P	AAA	4.603,29
37	BRDCLSC085026	CDR	BCO MERCEDES BENZ BRASIL SA			17.473,31
38	BRSANBL7NA13	LETRA FINANCEIRA	BCO SANTANDER (BRASIL) SA	MOODY'S	AAA	214.979,15
39	BRBBDCLFC290	LETRA FINANCEIRA	BCO BRADESCO SA	S&P	AAA	164.306,43
40	BRBTOYLF245	LETRA FINANCEIRA	BCO TOYOTA BRASIL SA	S&P	AAA	58.341,42

www.iqempresas.com.br



- BB TOP ESPELHO AÇÕES TRIGONO PARTHENON FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVESTIMENTO FINANCEIRO RESPONSABILIDADE LIMITADA
- BB TOP ESPELHO AÇÕES TRIGONO FLAGSHIP 60 SMALL CAPS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES
- BB TOP ACOES IBOVESPA ATIVO FUNDO INVEST
- FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I
  - FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA MASTER CONSERVADOR REN
- BB PREV RF FLUXO FIC
  - BB TOP RF TPF FI
- CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP
- KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA
  - KINEA PRIVATE EQUITY V MASTER FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES
- BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO
- BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B
  - BRAM FI RF IMA B
- BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI
  - BB TOP RENDA FIXA JUROS BRASIL FUNDO DE INVESTIMENTO LONGO PRAZO
- FIA CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI



d) A elaboração/geração de relatórios gerenciais diários (apenas dias úteis) que demonstrem, no mínimo, em plataforma WEB própria, as seguintes informações:

- ✓ Relatório de Enquadramento diário (para todos os dias úteis que se tenha mercado financeiro funcionando) da carteira do RPPS com relação aos cinco segmentos de investimentos permitidos pela Resolução CMN nº 4.963/21, quais sejam: Segmento de Renda Fixa, Segmento de Renda Variável, Segmento de Investimentos no Exterior, Segmento de Investimentos Estruturados e Segmento de Fundos Imobiliários, e de seus respectivos enquadramentos por artigo dentro de cada um dos cinco segmentos referidos, apresentado sinais de alerta de desenquadramentos se vier a existir;



apresentado sinais de alerta em caso de desconformidade;

Data	Carteira	PL Informado	Funcionalidades
22/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	549.943.945,48	Relatório, SGP, Outros
22/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	544.431.977,54	Relatório, SGP, Outros
22/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.411.967,94	Relatório, SGP, Outros
21/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	550.481.944,32	Relatório, SGP, Outros
21/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	545.099.118,86	Relatório, SGP, Outros
21/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.412.825,46	Relatório, SGP, Outros
20/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	550.912.499,76	Relatório, SGP, Outros
20/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	545.391.077,88	Relatório, SGP, Outros
20/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.421.421,88	Relatório, SGP, Outros
19/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	548.652.195,77	Relatório, SGP, Outros
19/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	543.297.455,71	Relatório, SGP, Outros
19/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.414.450,06	Relatório, SGP, Outros
18/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	547.770.303,80	Relatório, SGP, Outros
18/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	542.339.543,23	Relatório, SGP, Outros

Artigo	Tipo de Ativo	Valor (R\$)	% Carteira	Min	Objetivo	Max	ALM	Efeito Legal
<b>Reserva Fixa</b>								
Artigo 77 I, Alínea a	Títulos do Sistema Nacional	189.418.508,01	34,41	0,00	32,00	80,00	30,00	100,00
Artigo 77 I, Alínea b	Fundo 100% Títulos Públicos	92.715.201,74	17,43	10,00	18,00	70,00	22,20	100,00
Artigo 77 XI, Alínea a	Fundo Reserva Fixa	102.844.961,15	18,78	0,00	13,50	60,00	15,80	80,00
Artigo 77 XI	Fundo de Reserva Fixa (Out. Financeiro)	6.875.379,11	1,31	0,00	1,40	10,00	1,70	20,00
Artigo 77 V, Alínea B	DI FI - Carteira Privada	3.888.504,86	0,72	0,00	0,00	1,00	0,80	20,00
<b>Total Reserva Fixa</b>		<b>396.232.954,87</b>	<b>72,65</b>					100,00
<b>Reserva Variável</b>								
Artigo 87 I	Fundo de Ações	66.746.821,00	12,43	0,00	11,00	20,80	4,92	50,00
<b>Total Reserva Variável</b>		<b>66.746.821,00</b>	<b>12,43</b>					50,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 87 B	Fundo de Investimento no Exterior	16.207.472,18	3,02	0,00	3,00	10,00	3,00	90,00
Artigo 87 C	Fundo de Ações - BDR (New)	20.721.916,39	3,87	0,00	4,00	10,00	3,00	90,00
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		<b>36.929.388,57</b>	<b>7,11</b>					90,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 107 I	Fundo Multimercado	31.889.443,31	5,98	0,00	7,50	14,00	3,50	10,00
Artigo 107 B	Fundo de Participação	13.717.003,40	2,52	0,00	2,50	6,00	2,30	10,00

- ✓ Relatório de Compliance diário (para todos os dias úteis que se tenha mercado financeiro funcionando) da carteira do RPPS tendo em vista a alocação objetivo definida pelo Estudo de ALM (Asset Liability Management), apresentado sinais de alerta em caso de desconformidade;



← → 🏠 | @biçacoma@riopretosp.gov.br |

**LDB** Carteiras • Posições • Relatórios •

Data	Carteira	PL Informada	Funcionalidades
22/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	549.843.945,48	Relatório, SAGP, Outros
22/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	544.431.877,54	Relatório, SAGP, Outros
22/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.411.887,93	Relatório, SAGP, Outros
21/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	550.481.944,32	Relatório, SAGP, Outros
21/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	545.069.118,26	Relatório, SAGP, Outros
21/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.412.525,46	Relatório, SAGP, Outros
20/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	550.812.499,76	Relatório, SAGP, Outros
20/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	545.391.077,89	Relatório, SAGP, Outros
20/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.421.421,88	Relatório, SAGP, Outros
19/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	548.682.955,77	Relatório, SAGP, Outros
19/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	543.267.855,71	Relatório, SAGP, Outros
19/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.414.450,06	Relatório, SAGP, Outros
18/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	547.770.301,80	Relatório, SAGP, Outros
18/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	542.359.545,23	Relatório, SAGP, Outros

**LDB** Carteiras • Posições • Relatórios •

Carteira | Histórico | Simulação por Artigo | Faltas de Liquidez | Fluxo de Caixa | Últimos 100 Posições | Simulações | Análise de Risco | Substituições | Observações | PDF

**ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA**

Artigo	Tipo de Ativo	Valor (R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			ALM	Limite Legal
				Máximo	Objetivo	Mínimo		
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 71 I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	180.418.508,01	34,41	0,00	32,00	80,00	30,00	100,00
Artigo 71 I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	80.715.201,74	17,40	10,00	18,50	70,00	32,25	100,00
Artigo 71 K, Alínea a	Fundos Renda Fixa	62.844.964,15	16,79	0,00	13,50	60,00	15,00	80,00
Artigo 71 N	Ativos de Renda Fixa (Out. Financing)	6.875.378,11	1,51	0,00	1,40	10,00	1,00	20,00
Artigo 71 V, Alínea b	FI FI - Carteira Privada	2.888.506,80	0,55	0,00	0,50	5,00	0,00	20,00
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>334.242.958,81</b>	<b>72,16</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 81 I	Fundos de Ações	66.780.821,00	12,09	0,00	13,00	30,00	4,92	50,00
<b>Total Renda Variável</b>		<b>66.780.821,00</b>	<b>12,09</b>					50,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 81 B	Fundos de Investimento no Exterior	16.327.472,16	3,33	0,00	5,00	10,00	5,00	50,00
Artigo 81 C	Fundos de Ações - BDR (Novo)	20.723.516,39	4,36	0,00	4,00	10,00	5,00	50,00
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		<b>37.050.988,55</b>	<b>7,69</b>					50,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 101 I	Fundos Multimercado	31.848.845,31	6,02	0,00	7,50	15,00	5,00	15,00
Artigo 101 F	Fundo de Participação	13.777.053,40	2,52	0,00	2,50	6,00	2,00	15,00

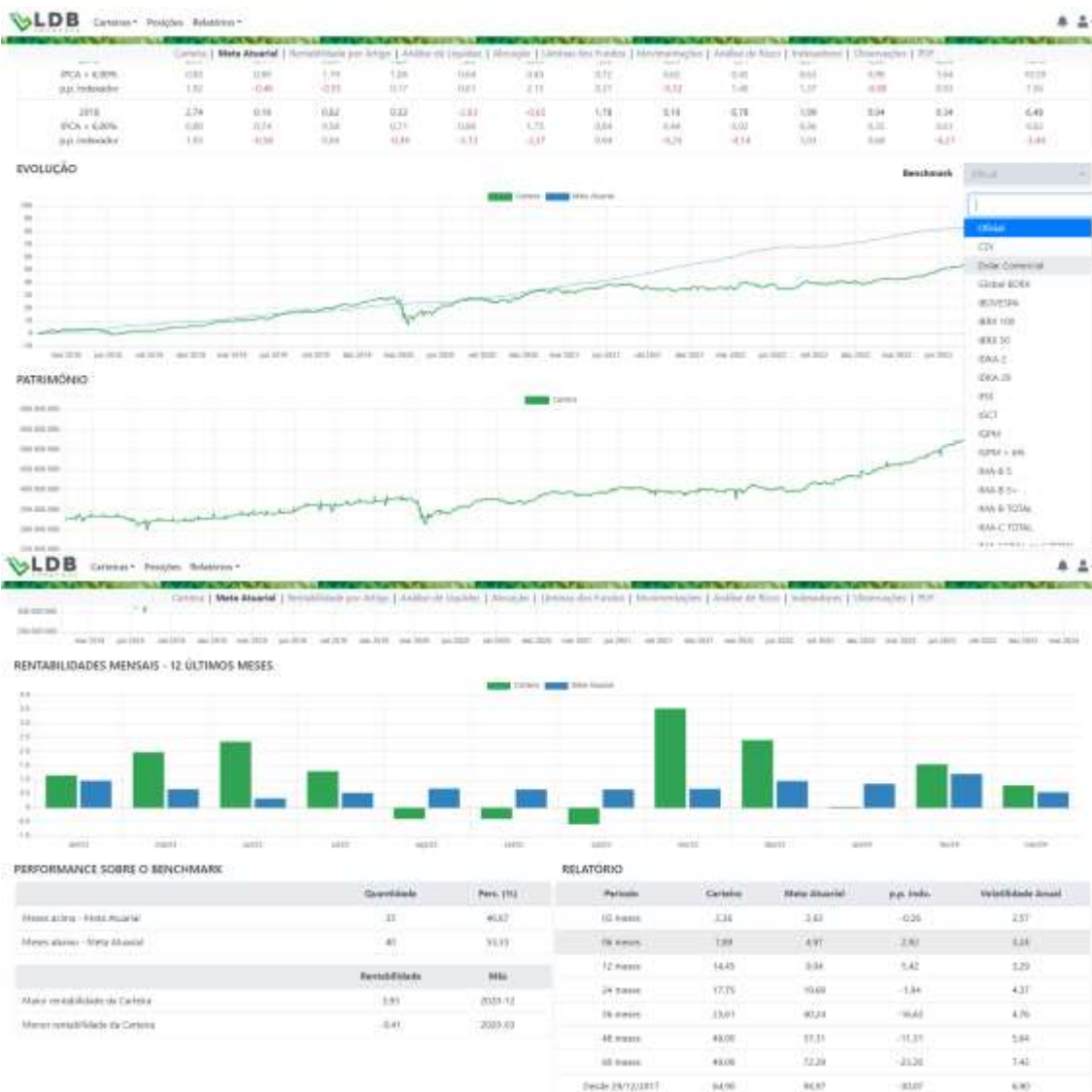
- ✓ Relatório de Rentabilidade diária (para todos os dias úteis que se tenha mercado financeiro funcionando) da carteira do RPPS, levando-se em conta a data de cada uma das aplicações e resgates efetuadas pelo RPPS (a rentabilidade não poderá ser obtida simplesmente pela metodologia de cotas, ou por diferença de patrimônio líquido dos fundos, ou pela metodologia da Taxa Interna de Retorno (TIR)), sendo que também deverá ser fornecida a rentabilidade diária consolidada para cada um dos cinco segmentos de investimentos permitidos pela Resolução CMN nº 4.963/21, a rentabilidade consolidada para cada um dos artigos da Resolução CMN nº 4.963/21 e, por fim, a rentabilidade diária de cada um dos fundos de investimentos que o RPPS possui os seus recursos alocados. Possibilidade

de comparação da rentabilidade diária do RPPS não só com a sua Meta Atuarial, como também em relação a cada um dos benchmarks existentes no mercado de renda fixa (Selic, CDI e benchmarks da Anbima), de renda variável (Ibovespa, IBrX100, IBrX50, SMLL e Dividendos) e de investimentos no exterior (MSCI AC, S&P500), tendo em vista as janelas de tempo: mês, 3 meses, 6 meses, 12 meses, 24 meses, 36 meses, 48 meses e 60 meses. Ainda deverá ser apresentada uma tabela que demonstre quantos meses o RPPS conseguiu bater a sua Meta Atuarial e quanto meses o RPPS não conseguiu bater a sua Meta Atuarial, qual foi o mês que o RPPS possuiu a sua menor rentabilidade e respectivo valor e qual foi o mês que o RPPS possuiu a sua maior rentabilidade e seu respectivo valor;

Data	Carteira	PL Informada	Funcionalidades
22/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	549.943.945,48	Relatório, DM, Outros
22/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	544.431.977,54	Relatório, DM, Outros
22/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.411.967,01	Relatório, DM, Outros
21/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	550.481.644,32	Relatório, DM, Outros
21/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	545.093.118,26	Relatório, DM, Outros
21/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.421.525,46	Relatório, DM, Outros
20/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	550.812.489,76	Relatório, DM, Outros
20/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	545.391.077,88	Relatório, DM, Outros
20/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.421.421,88	Relatório, DM, Outros
19/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	549.652.955,77	Relatório, DM, Outros
19/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	543.297.455,71	Relatório, DM, Outros
19/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	5.414.450,05	Relatório, DM, Outros
18/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	547.770.301,80	Relatório, DM, Outros
18/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - PLANO PREVIDENCIÁRIO	542.339.645,23	Relatório, DM, Outros

Setor	Adm.	Ativo	Valor R\$	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				4m (T)	12m	36m				
ETF FUNDL	ETF FUNDL	ETEA EMANCIPADA - BANC - BDI ETF FUNDL SA BANC SA	6,31	1,44	1,44	0,80	6.075.578,11	1,11		
Sub-total Artigo 7º IV			4,38	1,44	1,44	3,82	6.075.578,11	1,11		
Artigo 7º V, Alínea b (Fundo de Invest.)										
SE	SE	SE PREV 10 CREDITO PRIVADO 3CA B V F	1,31	0,00	0,77	2,30	3.054.166,06	0,50	311.801.894,50	0,39
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,31	0,00	0,77	2,30	3.054.166,06	0,50		
Renda Fixa			1,31	0,00	0,00	2,30	3.054.166,06	0,50		
<b>RENDA VARIÁVEL</b>										<b>12,20%</b>
Artigo 8º I (Fundo de Ações)										
SI	SI	SI AÇÕES SELEÇÃO REGIONAL FIC DE SI	15,12	0,00	-1,31	-1,40	2.295.423,76	0,41	1.236.503.942,21	0,17
SI04	SI04	BRADERCO FUND AÇÕES MID SMALL CAPS	20,52	0,00	-1,11	-1,09	12.015.388,08	2,19	832.744.838,59	1,04
CASA INVEST	CIPI	FIC FUND AÇÕES CASA INVEST VINCULADO RPPS	15,52	0,00	-0,44	-1,07	19.084.912,60	3,39	742.279.499,06	0,95
SI	SAMRANDEB	AP INVESTIMENTOS FI DE AÇÕES	13,54	0,42	-1,57	-1,20	5.072.394,00	0,91	328.585.541,45	0,34
CASA INVEST	CIPI	FIC CASA BRASIL FIC MEDIAS	15,95	0,12	-0,63	-1,41	4.794.428,00	0,86	12.984.214,83	0,17





LDB Carteira - Posição Atualizada

Carteira | Meta Atuarial | Rentabilidade por Artigo | Análise de Liquidez | Alíquotas | Líquidos dos Fundos | Alocações | Índice de Risco | Transações | Observações | PDF

Estreia Indicador	No Mês	No An	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	Atribuição Descriç. (%)	No An(R\$)
Artigo 7º L Alínea e % do CDI	3,00	3,07	3,07	3,54	10,21	1.805.700,00	0,34	3.805.616,30
Artigo 7º L Alínea b % do CDI	8,29	8,91	8,91	4,90	10,09	272.646,33	0,05	796.672,42
Artigo 7º L Alínea a % do CDI	0,34	-1,04	-1,04	2,10	11,86	130.004,48	0,04	1.020.679,41
Artigo 7º V % do CDI	1,44	3,82	3,82	6,72	13,03	30.446,20	0,02	223.382,54
Artigo 7º V Alínea b % do CDI	0,77	0,39	0,39	0,71	10,16	23.801,82	0,00	72.661,11
Artigo 8º I % do CDI	-0,56	-4,21	-4,21	8,16	21,24	-68.375,29	-0,01	-1.221.536,77
Artigo 8º I % do CDI	0,72	0,29	0,29	1,71	4,46			
Artigo 8º I % do CDI	3,10	12,37	12,37	24,91	29,37	540.871,70	0,10	2.007.771,83
Artigo 8º R % do CDI	2,28	18,57	18,57	21,94	34,71	462.705,05	0,09	2.774.674,71
Artigo 10º V % do CDI	0,40	10,86	10,86	25,24	39,89	1.600.431,29	0,31	6.164.456,15
Artigo 10º H % do CDI	0,30	3,07	3,07	3,81	5,15	120.480,03	0,02	490.901,94
Artigo 7º % do CDI	0,66	2,00	2,00	3,31	10,66	2.590.158,12	0,45	7.740.611,06
Artigo 8º % do CDI	-0,20	-4,21	-4,21	8,16	21,24	-68.375,29	-0,01	-1.221.536,77
Artigo 9º % do CDI	0,97	14,84	14,84	23,89	32,16	1.671.317,43	0,33	4.791.452,04
Artigo 10º % do CDI	2,07	8,42	8,42	16,00	25,81	1.194.822,14	0,22	3.875.320,09

- ✓ Relatório de Evolução do Patrimônio Líquido (PL) diária (para todos os dias úteis que se tenha mercado financeiro funcionando) do RPPS, sendo expressa em gráfico diário de evolução do PL;



e) Elaboração/geração de relatórios mensais de investimentos, por meio de plataforma WEB própria, para divulgação aos segurados e sociedade, contendo a posição da carteira por segmentos e ativos, tipos de risco, rentabilidades, meta atuarial, instituição financeira e limites da Resolução CMN nº 4.963/2021 e alterações e da Política de Investimentos. Também devem ser elaborados relatórios trimestrais e anuais de investimentos, com a consolidação de todas as informações relativas ao ano anterior, incluindo a conjuntura econômica, os resultados alcançados em relação às metas estabelecidas, o de caixa e das aplicações financeiras, a composição do ativo, a evolução do orçamento e a composição da carteira de imóveis, se houver.



Carteira: SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO Data Extração: 29/12/2023

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

RFB	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Conta
29	31/01/2023	FI CAIXA BRASL DISPONIBILIDADES RF	607.990,25	0,00	317.935,97648179	2.1697230000
30	31/01/2023	FI CAIXA BRASL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.024.622,58	0,00	903.368,63787400	4.4590290000
31	31/01/2023	FI CAIXA BRASL MATRIZ RENDA FI	45.548,00	0,00	26.314,80119400	1.7308130000
32	01/02/2023	FI CAIXA BRASL DISPONIBILIDADES RF	489,29	0,00	211,58904880	2.1106700000
33	01/02/2023	FI CAIXA BRASL DISPONIBILIDADES RF	0,00	8.174,76	4.228,89499400	2.1106700000
34	01/02/2023	FI CAIXA BRASL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	491.723,89	110.329,12472000	4.4590820000
35	02/02/2023	BRÁDESCO FIO FIF RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	0,00	4.797,43	2.571,87148000	1.8653482000
36	02/02/2023	FI CAIXA BRASL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	11.490,47	2.574,75069700	4.4588510000
37	03/02/2023	BRÁDESCO FIC FIF RF CURTO PRAZO PODER PUBLICO	70,19	0,00	37,61300000	1.8661100000
38	03/02/2023	FI CAIXA BRASL DISPONIBILIDADES RF	0,00	558,62	257,14709100	2.1125830000

g) O fornecimento de ferramenta para preenchimento automático do DAIR no sistema CADPREV do MPS, em prazo hábil, para cada uma das posições de fechamento de mês, sem a necessidade de preenchimento manual;

**LDB** Carteira\* Posições Relatórios\*

Data de Referência: 28/03/2024 | Carteira

Data	Carteira	Pl. Informada	Funcionalidades
28/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	347.635.215,87	Relatório   LDB   Carteira
28/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - FUNDO PREVIDENCIÁRIO	542.768.817,48	Relatório   LDB   Carteira
28/03/2024	SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - TÁXA DE ADMINISTRAÇÃO	4.873.008,18	Relatório   LDB   Relatórios

**LDB** Carteira\* Monitorização\* Posições Relatórios\* Cartões\* Ferramentas\*

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - 28/03/2024

Estreito	Fundo	CNPJ	Rend. Mês	Quantidade de Cotas	Valor Financeiro	Valor de Cota	Participação Líquida
Artigo 7º L Adm.a	NTN-B 156513 (RUBS009%)		0,03	1.339.300.000	5.730.671,37	4.271.389.187,00	0,00
Artigo 7º L Adm.a	NTN-B 156519 (RUBS009%)		3,24	1.299.000.000	5.361.834,22	4.131.151.884,00	0,00
Artigo 7º L Adm.a	NTN-B 156515 (RUBS009%)		0,07	1.241.000.000	5.690.632,32	4.582.362,249.000	0,00
Artigo 7º L Adm.a b	FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.746.834.0001-83	0,08	302.946.129,23	3.692.570,34	4.460.066,000	0,00
Artigo 7º L Adm.a b	88 PREV RP FUNDACAO ATIVA RITOMAR 1024L PC R	05.282.388/0001-89	0,17	8.996.316.146,80	16.785.540,81	1.800.914,800	6.700.473.364,84
Artigo 7º L Adm.a b	88 PREV RP TITULO PUBLICO RFCA R FI	10.302.799/0001-25	3,01	188.337.740,747	579.949,22	3.078.732,000	102.183.321,84
Artigo 7º L Adm.a b	FC DE FUNDACAO BRASILEIRA DE INVESTIMENTOS RF	25.015.801/0001-85	0,58	540.180.223,019	18.884.113,63	1.934.284,800	5.491.217.467,91
Artigo 7º L Adm.a b	802 FUNDACAO RITOMAR ATIVA RITOMAR R FI	09.697.301/0001-79	-0,04	1.213.754.381,661	5.529.006,40	4.246.011,000	108.344.952,51

**LDB** Carteira\* Monitorização\* Posições Relatórios\* Cartões\* Ferramentas\*

SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - 28/03/2024

Artigo 1º F B	FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	CNPJ	Rend. Mês	Quantidade de Cotas	Valor Financeiro	Valor de Cota	Participação Líquida
Artigo 1º F B	FC DE FUNDACAO BRASILEIRA DE INVESTIMENTOS RF	25.015.801/0001-85	0,11	6.005.882.464,242	37.376.296,84	1.270.031,200	388.383.333,00
Artigo 1º F B	FUNDO FUNDACAO ECONOMIA REAL R FI FUNDACAO RITOMAR R FI	44.172.821/0001-11	-0,23	375.370.404,125	381.136,42	0.776.270,000	182.056.932,27

**APR**

Número	Fundo	CNPJ	Tipo	Data da Operação	Quantidade de Cota	Valor Financeiro	Valor de Cota	Participação Líquida
64	FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.746.834.0001-83	Aplicação	18/03/2024	51.051.217,775	227.551,99	4.437.932,800	5.018.987.024,51
78	FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	10.746.834.0001-83	Aplicação	28/03/2024	41.822.744,145	230.822,81	5.490.134,800	11.000.054.411,78
76	88 PREV RP FUNDACAO ATIVA RITOMAR 1024L PC R	05.282.388/0001-89	Aplicação	18/03/2024	71.865.148,800	188.341,70	2.778.182,800	4.851.341.817,42
77	88 PREV RP FUNDACAO ATIVA RITOMAR 1024L PC R	05.282.388/0001-89	Aplicação	28/03/2024	3.881.050,31	16.786,21	2.778.182,800	5.113.589.894,04

**LDB** Carteira\* Posições Relatórios\*

88 88 PREV RP FUNDACAO ATIVA RITOMAR 1024L PC R

64 FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP

78 FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP

76 FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP

77 FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP

79 FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP

75 FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP

74 FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP

76 FUNDO DE CAIXA BRASILEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS RF LP

**CADPREV - Investimentos:**

CNPJ

Ser/Pa

Operacional

Representante Legal

Programa

Liquidante

Participação Líquida

n) Relatório customizado que contemple a escolha de qualquer fundo de investimento que seja enquadrado para os RPPS (tendo em vista a lista de fundos da Secretaria de Previdência), podendo-se escolher uma data inicial e uma data final para obtenção das seguintes informações: denominação



social do fundo de investimento, classe CVM, CNPJ do Fundo, nome do administrador e seu respectivo CNPJ, nome do gestor e seu respectivo CNPJ, se é fundo de cotas, se é fundo exclusivo, se possui tributação de longo prazo, se é destinado a investidores qualificados, Prazo de Cotização da Aplicação, Prazo de Liquidação da Aplicação, Prazo de Cotização do Resgate, Prazo de Liquidação do Resgate, percentual da taxa de performance, percentual da taxa de administração, Artigo da Resolução CMN nº 4.963/21, Se o fundo está enquadrado ou não perante a Resolução CMN nº 4.963/21. Apresentar ainda mais algumas informações: patrimônio do fundo na data inicial escolhida, patrimônio do fundo na data final escolhida, número de cotistas, rentabilidade no período, Índice de Sharpe, Volatilidade, VaR (Value at Risk) e B-VaR (Benchmark VaR). Apresentar a rentabilidade no período escolhido consolidada no mês, e ainda, a rentabilidade consolidada para as seguintes janelas de tempo: 3 meses, 6 meses, 12 meses, 24 meses, 36 meses, 48 meses e 60 meses, não só do fundo de investimento como também de qualquer benchmark dos segmentos de mercado: renda fixa, renda variável e investimentos no exterior. Apresentar um gráfico de evolução da rentabilidade do fundo de investimento diante do benchmark escolhido para comparação, como também um gráfico de evolução do patrimônio líquido do fundo de investimento. Deverá ainda apresentar quantos meses o fundo conseguiu superar o benchmark escolhido e quantos meses o fundo não conseguiu superar o seu benchmark, apresentando o mês com o valor da menor rentabilidade e o mês com o valor da maior rentabilidade;

"O único lugar em que o sucesso vem antes do trabalho é no dicionário."

**DADOS DO FUNDO**

Denominação Social		Classo CVM	CNPJ
BB PREVIDENCIÁRIO FUNDO FOM FIA 8 A 8 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO		Fundo de Renda Fixa	07.442.078/0001-00
Administrador	CNPJ	Gestor	CNPJ
BB GESTÃO DE RECURSOS OPVM SA	30.823.936/0001-68	BB GESTÃO DE RECURSOS OPVM SA	30.823.936/0001-68
Fundo de Cotas	Fundo Exclusivo	Tributação de Longo Prazo	Investidores Qualificados
Não	Não	Não	Não
Aplicação Cotização	Aplicação Liquidação	Resgate Cotização	Resgate Liquidação
D+0	D+0	D+1 dia	D+1 dia
Taxa Performance	Taxa Administração (%)	Artigo	Enquadramento
	0,20	Artigo 7º 1 Alínea b	Sim
Número de Cotistas			
63			

**INDICADORES**

Patrimônio 28/03/2021	Patrimônio 31/03/2024	Rentabilidade no Período
7.036.512.501,66	5.124.821.827,12	25,20

INDICADORES

Patrimônio 28/03/2021	Patrimônio 28/03/2024	Rentabilidade no Período	
7.638.132.561,86	5.134.825.827,52	25,20	
Sharpe	Volatilidade (ao ano)	Value-At-Risk (21 dias)	BIVR (21 dias)
-2,03	3,00	1,22	0,01

RENTABILIDADES

Ano	Jan	Feb	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dec	Rent. Ano
2024	-4,48	6,51	0,06										0,11
IMA-B TOTAL	-4,48	6,51	0,06										0,16
pp. Indexador	-0,03	-0,02	-0,02										-0,07
2023	-4,01	1,27	2,60	2,00	2,38	2,37	0,73	0,40	-0,01	-0,67	2,61	2,74	15,77
IMA-B TOTAL	-4,00	1,28	2,60	2,01	2,37	2,38	0,73	0,39	-0,01	-0,66	2,62	2,75	16,01
pp. Indexador	-0,01	-0,01	-0,01	-0,01	0,01	-0,01	-0,01	-0,01	-0,01	-0,01	-0,01	-0,01	-0,24

Data Inicial: 21/10/2023  
Data Final: 28/03/2024  
Benchmark: IMA-B TOTAL

**Calcular**

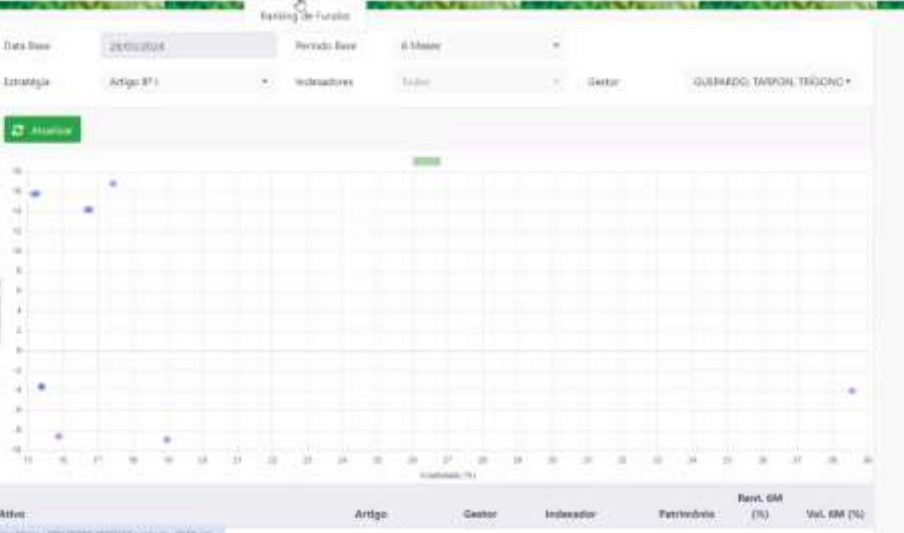
**DADOS DO FUNDO**

Denominação Social: BB PREVIDENCIÁRIO RENDIA F  
Administrador: IMA-B S-  
BB GESTAO DE RECURSOS DTVM SA  
Fundo de Cotes: IMA-B TOTAL

Classe CVM: Fundo de Renda Fixa  
CNPJ: 07.442.078/0001-02

Gestor: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM SA  
CNPJ: 20.822.836/0001-00

Tributação de Longo Prazo: Investidores (Qualificados)

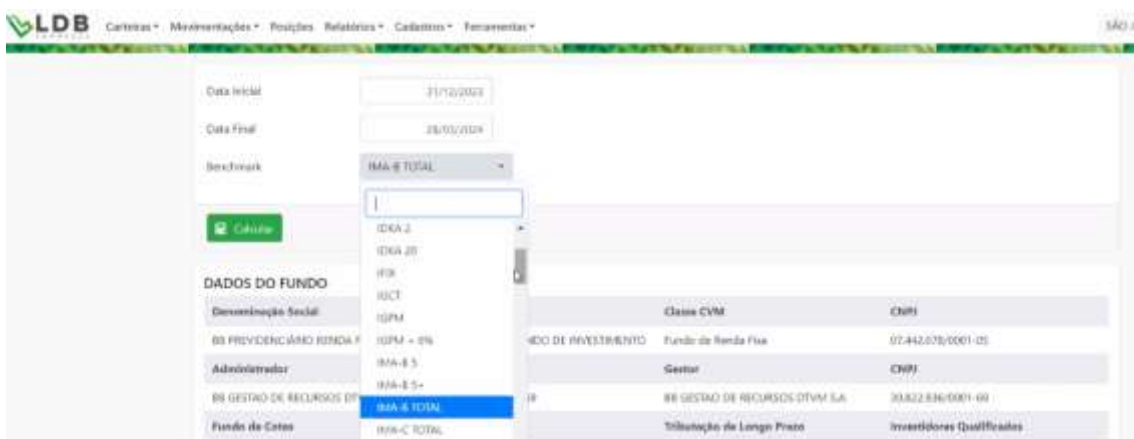




o) A Plataforma Web deverá disponibilizar um ranking comparativo dos fundos de investimentos oferecidos pelas instituições financeiras ao RPPS. Este comparativo deverá ser realizado por benchmark, artigo, inciso e alínea da Resolução CMN nº 4.963/2021;



"O único lugar em que o sucesso vem antes do trabalho é no dicionário."





Determinístico, incluindo, de um lado, a macroalocação através da construção da Fronteira Eficiente de Markowitz e, de outro, a modelagem de Cash Flow Matching para a determinação dos vértices de títulos públicos federais para serem adquiridos e proteger o Passivo do RPPS, em consonância, de um lado, com os ditames da Portaria MTP nº 1.467/22, artigos 141 à 146 e seu respectivo Anexo VIII, artigos 2º à 7º, e de outro, com a Resolução CMN 4.963/21 e alterações posteriores, e com as normas da Secretaria de Previdência, principalmente o estabelecido no Manual do Pró Gestão versão 3.5, item 3.2.6. Deve-se ressaltar que o Estudo de ALM não é o Estudo de Solvência, uma vez que compreende não só a Fronteira Eficiente de Markowitz, como também a modelagem de Cash Flow Matching. Deve-se ainda, atender o item 3.2.6 – Política de Investimentos do Manual do Pró Gestão Versão 3.5, que estipula para o ALM a utilização de metodologia que demonstre a compatibilidade do passivo com o ativo, principalmente do ALM, e, ainda, a utilização de metodologia que demonstre a compatibilidade do passivo com o ativo e a moderna teoria de diversificação de carteira, principalmente do ALM, para elaboração do diagnóstico da carteira de investimentos atual do RPPS e proposta de revisão de alocação das aplicações financeiras da política de investimentos, visando à otimização das carteiras de investimento. Emitir nota explicativa ao estudo.





## VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: 3CCB-054C-E280-E182

Este documento foi assinado digitalmente pelos seguintes signatários nas datas indicadas:

- ✓ PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI (CPF 326.XXX.XXX-02) em 25/04/2024 10:24:07 (GMT-03:00)  
Papel: Parte  
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
  
- ✓ ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO (CPF 327.XXX.XXX-48) em 25/04/2024 13:34:06 (GMT-03:00)  
Papel: Parte  
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
  
- ✓ DANIEL HENRIQUE MARTINS BIOT (CPF 410.XXX.XXX-57) em 25/04/2024 20:52:22 (GMT-03:00)  
Papel: Parte  
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
  
- ✓ MÁRIO JOSÉ PICCARELLI DE CASTRO (CPF 219.XXX.XXX-01) em 26/04/2024 08:21:18 (GMT-03:00)  
Papel: Parte  
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

Para verificar a validade das assinaturas, acesse a Central de Verificação por meio do link:

<https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/3CCB-054C-E280-E182>