

INVESTIMENTOS

TRANSPARÊNCIA EM NÚMEROS: RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS – 1º TRI/2024

Resumo

Explore o desempenho dos investimentos da RIOPRETOPREV no primeiro trimestre de 2024, destacando as estratégias de investimento, a gestão de riscos e o compromisso contínuo com a responsabilidade previdenciária

Versão 1.0, de 31/03/2024 – Aprovada pelo Comitê de Investimentos em 06/05/2024, pelo Conselho Municipal de Previdência em 09/05/2024 e pelo Conselho Fiscal em 27/05/2024



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

Versão 1.0 – abril de 2024

Edinho Araújo
Prefeito Municipal

Jair Moretti
Diretor Superintendente

Conselho Municipal de Previdência

Adriana Rambaiolo Tonin
Adriano Antonio Pazianoto
Andreia Peres
Carlos Henrique de Oliveira
Fernanda Bruschi Porto
Giuliano Cleber Coltro
Mário José Picarelli de Castro
Rosimere Cleide Souza Desidério
Rosycarmen Pontes Gestal Alvares
Silvana Aparecida da Rocha Delfino
Teresa Cristina Sicoli Vilela
Wilclem de Lazari Araújo

Conselho Fiscal

Daniel Henrique Martins Biot
Dimas Fernandes
Fabiano Luís Medeiros Sanches
João Pedro Fortunato Delarmelino Silva
Katia Aparecida Froes Fortunato
Roberto Carlos Menoni Junior
Victor Hugo Yamamoto

Membros do Comitê de Investimentos

Adriano Antônio Pazianoto
Daniel Henrique Martins Biot
Hélio Antunes Rodrigues
Mário José Piccarelli de Castro
Patrícia Nato Toninato Bartolomei

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 - www.riopreto.sp.gov.br

Servidores da RIOPRETOPREV

Adriana Sanchez de Britto
Adriano Antônio Pazianoto
Ana Cristina Alves de Paula
Bruno Santana Costa
Camila Caminha Caro
Carla Yumi Nishimura
Deize Fernanda Feletto de Azevedo
Fabiano Hernandes de Assis
Hélio Antunes Rodrigues
Izabel Cristina Pires Borelli
Lucimara Aparecida Faustino Custódio
Ludmila Andrade Sernagiotto de Souza
Mara Rúbia Santos
Mário José Piccarelli de Castro
Maysa dos Reis Souza
Patrícia Nato Toninato Bartolomei
Rafael Henrique Lopes Pereira
Tatiana Maria Sant'ana Lopes
Vanessa Lago Martins
Wilclem de Lazari Araújo

Sumário

APRESENTAÇÃO	5
MENSAGEM DOS MEMBROS DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS.....	6
ANÁLISE DO MERCADO FINANCEIRO E EXPECTATIVAS DE MERCADO.....	7
MERCADOS INTERNACIONAIS.....	7
CENÁRIO DOMÉSTICO	8
PRINCIPAIS INDICADORES ECONÔMICOS	9
A ALOCAÇÃO DOS RECURSOS E O ASSET LIABILITY MANAGEMENT (ALM)	11
CENÁRIO ECONÔMICO E O DESEMPENHO DOS INVESTIMENTOS.....	12
DA AVALIAÇÃO ANÁLITICA DOS INVESTIMENTOS DA RIOPRETOPREV NO PRIMEIRO TRIMESTRE DO ANO DE 2024.....	13
DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS E O ATENDIMENTO ÀS DIRETRIZES ESTABELECIDAS NA RESOLUÇÃO 4.963/2021	13
DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS E O ATENDIMENTO ÀS DIRETRIZES ESTABELECIDAS NA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS	13
Renda Fixa:	14
Renda Variável:	14
Investimentos no Exterior:.....	14
Investimentos Estruturados:	14
DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS ENTRE INSTITUIÇÕES E <i>BENCHMARKS</i>	14
DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DA CARTEIRA E COMENTÁRIOS SOBRE A PERFORMANCE DOS FUNDOS E RESPECTIVOS SEGMENTOS	15
RENDA FIXA:	16
RENDA VARIÁVEL:	16
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR:	17
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS:	17
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	18
PRINCIPAIS INDICADORES DOS INVESTIMENTOS DA RIOPRETOPREV NO ANO	18
RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL no 1º TRIMESTRE:.....	18
RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL ANUAL:	19
PERFORMANCE NOS ÚLTIMOS PERÍODOS:	19
DO ANEXO I – DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS DOS INVESTIMENTOS DETALHADAS	20

APRESENTAÇÃO

Com entusiasmo, apresentamos o **"TRANSPARÊNCIA EM NÚMEROS: RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS – 1º TRI/2024"** da RIOPRETOPREV, uma análise minuciosa do desempenho dos investimentos ao longo do primeiro trimestre do ano de 2024. Este documento gerencial não apenas presta contas de maneira transparente aos colegas, segurados e beneficiários, mas também destaca as estratégias, a gestão de riscos eficiente e o compromisso contínuo com a responsabilidade previdenciária.

O relatório desempenha um papel crucial ao possibilitar o acompanhamento mais detalhado da Autarquia pelo Conselho Municipal de Previdência e pelo Conselho Fiscal. Além de refletir as conquistas de 2024, serve como ferramenta essencial para a avaliação contínua da gestão de investimentos. Os dados apresentados não só informam sobre os resultados alcançados, mas também oferecem subsídios valiosos para a tomada de decisões, auxiliando na definição de novas diretrizes e orientações gerais.

Este relatório reafirma o compromisso da RIOPRETOPREV com as melhores práticas e normas de transparência, em total conformidade com as diretrizes estabelecidas no Manual do Pró-Gestão RPPS (versão 3.5, de 15/01/2024). Ao adotar a abordagem "Transparência em Números", buscamos não apenas comunicar dados, mas também consolidar uma cultura de responsabilidade, confiança e excelência na gestão previdenciária.

MENSAGEM DOS MEMBROS DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Ao refletir sobre o primeiro trimestre de 2024, é com satisfação que compartilhamos nossas considerações sobre os investimentos da Riopretoprev. O trimestre foi marcado por desafios significativos, com os principais benchmarks locais, onde estão alocados a maior parte do recurso dos RPPS, entregando resultados abaixo da meta atuarial ou ainda negativos, e ao mesmo tempo apresenta oportunidades valiosas para alocações. Nossa abordagem estratégica, pautada na busca constante por solidez e rentabilidade, foi essencial para a construção de uma carteira diversificada e resiliente.

A alocação eficiente de recursos em diferentes classes de ativos, aliada a uma gestão ativa e criteriosa, contribuiu para a valorização de nossa carteira. A performance muito próxima da meta atuarial, evidenciada pelo índice de 89,73% no primeiro trimestre, reflete o comprometimento do Comitê em alcançar as expectativas, garantindo resultados consistentes aos nossos beneficiários.

A manutenção da transparência e aprimoramento contínuo de nossos processos de tomada de decisão foram fundamentais para o resultado significativo alcançado. Estamos confiantes de que a inclusão do Anexo I – Demonstração Detalhada dos Investimentos do primeiro trimestre de 2024 enriquecerá ainda mais a compreensão e avaliação de nossa performance.

ANÁLISE DO MERCADO FINANCEIRO E EXPECTATIVAS DE MERCADO

Neste capítulo, mergulhamos profundamente na dinâmica do mercado financeiro global e doméstico, buscando compreender as influências que moldaram o cenário econômico no trimestre deste ano, além de explorar as expectativas para o futuro. Em um ambiente econômico cada vez mais interconectado, a análise abrange tanto os fatores que impactaram os mercados internacionais quanto aqueles que moldaram o panorama financeiro nacional¹.

MERCADOS INTERNACIONAIS

Ao longo do trimestre, foi observado uma elevação nos juros globais, em virtude das discussões sobre o início do ciclo de redução de juros norte-americanos e sobre a velocidade da redução da inflação nas economias desenvolvidas.

Em relação aos EUA, embora, a inflação caminha em uma direção positiva, os sinais de atividade econômica aquecida ainda estão presentes, tendo o PIB forte e o mercado de trabalho em expansão. Desta forma, ao longo do trimestre, a hipótese em que a trajetória do processo de desinflação ocorra de maneira gradual, num contexto de mercado de trabalho aquecido, ganhou força no mercado.

No fim do trimestre, na Zona do Euro, a situação econômica foi marcada pela estagnação e a necessidade de políticas monetárias mais flexíveis. Onde, apesar da resiliência do mercado de trabalho, os indicadores dos setores de manufatura e serviços da região revelaram um desempenho modesto. Este contexto tem contribuído para a manutenção da tendência de queda nas taxas de inflação, colocando a Zona do Euro em uma posição favorável no que diz respeito ao controle inflacionário.

Na China, ao longo do trimestre, persistiu um cenário de cautela. Onde, apesar dos esforços governamentais, o mercado residencial permanece frágil, sugerindo riscos de deflação. Por outro lado, o setor industrial mostra progresso, o que é positivo para o comércio global, embora persistam preocupações com a fragilidade imobiliária e a baixa inflação, possivelmente ligada a uma demanda interna fraca.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos no período. Onde, no 1º trimestre de 2024, o MSCI ACWI e o S&P 500, respectivamente, renderam +7,73% e +10,16%. Assim, no acumulado dos últimos 12 meses obtiveram retorno de +21,09% e +27,86%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial.

O Comitê de Investimentos da RIOPRETOPREV, em uma análise resumida, conclui que para o cenário internacional no primeiro trimestre de 2024, apesar do cenário geopolítico ainda tenso, as perspectivas do início de corte de juros nas principais economias globais mantiveram o otimismo nos mercados. Assim, os resultados obtidos nos principais índices

¹ Texto extraído e adaptado do Relatório Macroeconômico do 1º trimestre de 2024 da LDB Consultoria – 22.04.2024.

internacionais foram positivos, com destaque para o MSCI ACWI e S&P 500, evidenciando resiliência e adaptabilidade frente às incertezas econômicas.

CENÁRIO DOMÉSTICO

No cenário doméstico, ao longo do trimestre, as curvas de juros apresentaram um aumento, ocasionado pelo aumento de risco no exterior e, no fim do período, refletindo o aumento da incerteza sobre a condução da política econômica nacional.

Os dados de atividade econômica continuam fortes ao longo do trimestre. As pesquisas sobre comércio e serviços superaram as expectativas, porém, houve destaque para o mercado de trabalho. A taxa de desemprego continuou a diminuir e houve uma significativa criação de empregos formais, resultando em um contínuo crescimento substancial do salário real. A sustentação da demanda, em função deste aumento da renda e da expansão das concessões de crédito para pessoas físicas, tem se refletido em aumento gradual das previsões para o PIB deste ano.

Nesse período, a inflação continuou seguindo uma tendência positiva, com desaceleração e de melhora da sua composição. Entretanto, os dados demonstram uma inflação de serviços mais pressionada que o esperado.

Dessa forma, a ausência de ociosidade no mercado de trabalho em conjunto com a elevação dos núcleos de inflação e da inflação subjacente de serviços exige cautela na condução da política monetária.

No primeiro trimestre, houve a continuidade do movimento de redução dos juros básicos até o atual patamar de 10,75%. Entretanto, os dados recentes de inflação e de atividade acima das expectativas resultaram em uma comunicação mais conservadora do Banco Central. Dessa forma, houve a sinalização de somente mais um corte de juros na Taxa Selic e os próximos passos foram deixados em aberto, a depender dos dados econômicos.

Na renda variável, os índices Ibovespa e SMLL seguiram na contramão do movimento observado nos índices internacionais, fechando o trimestre em território negativo, apresentando, respectivamente, um retorno de -1,19% e -4,09% no 1º trimestre de 2024, e de +25,74% e +24,13% no acumulado dos últimos 12 meses.

Em sua análise, o **Comitê de Investimentos** conclui que, a bolsa brasileira teve um desempenho muito ruim no mês de março e no primeiro trimestre de 2024, principalmente pela saída de capital estrangeiro com esses investidores mais cautelosos. Também houve preocupação entre os investidores devido às tentativas do governo de intervir em empresas estatais e em empresas nas quais a União detém uma participação significativa, como a Petrobrás e a Vale. Essas empresas têm uma grande presença no principal índice do Brasil, o Ibovespa. Houve abertura nas curvas de juros locais devido preocupações com o cenário fiscal e inflação de curto prazo um pouco mais forte do que o esperado, o que pode reduzir a velocidade dos cortes de juros por aqui.

PRINCIPAIS INDICADORES ECONÔMICOS

No contexto do primeiro trimestre do ano de 2024, pretendemos avaliar os Principais Indicadores Econômicos que moldaram o cenário nacional e internacional, conforme tabela a seguir:

Indicadores	Índices Financeiros			Acumulado Trimestre	Acumulado 12 Meses
	2024				
	Janeiro	Fevereiro	Março		
Renda Fixa					
IDkA IPCA 20A	-3.34%	0.22%	-1.51%	-4.59%	18.67%
IRF-M 1+	0.60%	0.34%	0.43%	1.37%	15.26%
IRF-M	0.67%	0.46%	0.54%	1.68%	14.03%
IMA-B5+	-1.47%	0.51%	-0.55%	-1.51%	13.38%
IMA-GERAL	0.47%	0.64%	0.52%	1.64%	12.59%
IMA-S	0.99%	0.82%	0.86%	2.69%	12.58%
CDI	0.97%	0.80%	0.83%	2.62%	12.36%
IRF-M 1	0.83%	0.76%	0.84%	2.46%	12.28%
IMA-B	-0.45%	0.55%	0.08%	0.18%	11.81%
IMA-B5	0.68%	0.59%	0.77%	2.06%	9.62%
IDkA IPCA 2A	0.81%	0.42%	0.99%	2.24%	9.48%
Renda Variável					
IDIV	-3.51%	0.91%	-1.20%	-3.81%	27.20%
IVBX-2	-4.91%	2.30%	1.50%	-1.27%	26.59%
ISE	-4.96%	1.99%	1.21%	-4.53%	26.03%
Ibovespa	-4.79%	0.99%	-0.71%	-1.90%	25.74%
IBrX - 100	-4.51%	0.96%	-0.73%	-4.29%	25.18%
IBRX - 50	-4.15%	0.91%	-0.81%	-4.06%	24.88%
SMLL	-6.55%	0.47%	2.15%	-4.09%	24.13%
IFIX	0.67%	0.79%	1.43%	2.92%	23.44%
Investimentos no Exterior					
Global BDRX	4.78%	6.30%	4.04%	15.88%	34.65%
S&P 500 (M. Orig.)	1.59%	5.17%	3.10%	10.16%	27.86%
S&P 500	3.94%	5.80%	3.37%	13.68%	25.75%
MSCI ACWI (M.Orig.)	0.53%	4.17%	2.88%	7.73%	21.09%
MSCI ACWI	2.86%	4.79%	3.14%	11.17%	19.08%
Índices Econômicos					
SELIC	0.97%	0.80%	0.83%	2.62%	12.36%
IPCA	0.42%	0.83%	0.16%	1.42%	3.93%
INPC	0.57%	0.81%	0.19%	1.58%	3.40%
DÓLAR	2.32%	0.60%	0.26%	3.20%	-1.66%
IGP-M	0.07%	-0.52%	-0.47%	-0.91%	-4.26%

Em resumo, ao examinar a tabela, notamos que, em sua maioria, os indicadores financeiros internacionais no primeiro trimestre de 2024 superaram as metas de rentabilidade estabelecidas para o ano. Já os indicadores locais em sua maioria não atingiram o objetivo. Dessa forma, destacamos a importância da diversificação da carteira, que reduz o risco e aumenta o potencial de retorno, combinados com o horizonte de longo prazo dos investimentos.

Prosseguindo na análise, direcionamos agora nossa atenção ao gráfico de dispersão que ilustra o comportamento dos principais indicadores ao longo do primeiro trimestre de 2024. Destaca-se imediatamente que nem todos os indicadores superaram o indicador da meta atuarial.

Um enfoque especial é dedicado à volatilidade, cujas flutuações significativas nos três primeiros meses do ano se refletem no gráfico e na tabela a seguir:

Gráfico de Retorno x Volatilidade (no 1º trimestre):

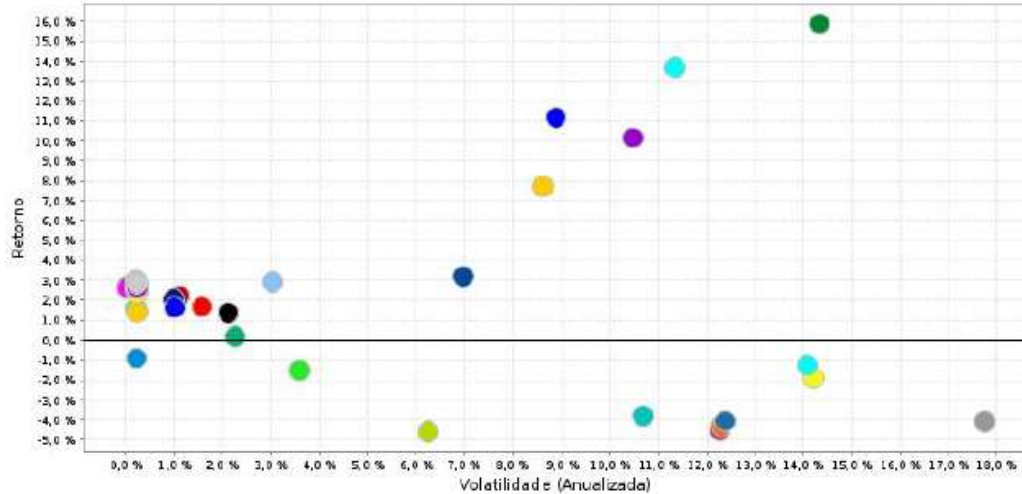


Tabela de Retorno x Volatilidade (no 1º trimestre)

Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
Global BDRX	15,88%	14,32%
S&P 500	13,68%	11,34%
MSCI ACWI	11,17%	8,88%
S&P 500 (Moeda Original)	10,16%	10,46%
MSCI ACWI (Moeda Original)	7,73%	8,61%
Dólar	3,20%	6,98%
INPC + 6,00%	3,02%	0,21%
IFIX	2,92%	3,03%
IPCA + 6,00%	2,86%	0,23%
INPC + 5,00%	2,78%	0,21%
IMA-S	2,69%	0,03%
CDI	2,62%	0,02%
Selic	2,62%	0,02%
IPCA + 5,00%	2,62%	0,23%
INPC + 4,00%	2,55%	0,21%
IRF-M 1	2,46%	0,23%
IPCA + 4,00%	2,38%	0,23%
IDkA IPCA 2 Anos	2,24%	1,12%
IMA-B 5	2,06%	0,99%
IRF-M	1,68%	1,57%
IMA Geral	1,64%	1,01%
INPC	1,58%	0,21%
IPCA	1,42%	0,23%
IRF-M 1+	1,37%	2,12%
IMA-B	0,18%	2,26%
IGP-M	-0,91%	0,22%
IVBX-2	-1,27%	14,07%
IMA-B 5+	-1,51%	3,60%
ISE	-1,90%	14,20%
IDIV	-3,81%	10,67%
IBX-50	-4,06%	12,37%
SMLL	-4,09%	17,75%
IBX	-4,29%	12,30%
Ibovespa	-4,53%	12,27%
IDkA IPCA 20 Anos	-4,59%	6,25%



Em conclusão, ao examinar o gráfico de dispersão, destaca-se que, apesar da excelente diversificação da carteira pela RIOPRETOPREV, não foi possível o atingimento da meta atuarial, uma vez que os principais índices de renda fixa locais, segmento onde o RPPS tem a maior parte dos seus recursos alocados, tiveram desempenho abaixo da meta.

A ALOCAÇÃO DOS RECURSOS E O ASSET LIABILITY MANAGEMENT (ALM)

A alocação dos recursos em consonância com o *Asset Liability Management* (ALM) desempenha um papel crucial na gestão estratégica dos investimentos da RIOPRETOPREV, alinhando-se às diretrizes estabelecidas no Manual do Pró-Gestão e às melhores práticas do mercado. O ALM é uma abordagem estratégica que visa otimizar a relação entre os ativos e passivos da entidade, considerando suas obrigações futuras.

A importância dessa prática reside na mitigação de riscos e na busca pela sustentabilidade financeira a longo prazo. Ao alinhar a alocação de recursos com as responsabilidades atuariais, a RIOPRETOPREV visa assegurar que os investimentos estejam em sintonia com as obrigações futuras, proporcionando um equilíbrio saudável entre risco e retorno. Isso não apenas fortalece a capacidade de cumprir compromissos previdenciários, mas também contribui para a preservação e crescimento do patrimônio.

Ao seguir as diretrizes do Manual do Pró-Gestão, a RIOPRETOPREV demonstra seu compromisso com a transparência, responsabilidade e boas práticas de governança. A gestão eficiente do ALM não apenas atende aos requisitos normativos, mas também representa uma abordagem proativa na adaptação às dinâmicas do mercado e na garantia da segurança e solidez dos investimentos previdenciários. Em um ambiente financeiro dinâmico, a prática consistente do ALM é essencial para a tomada de decisões informadas, a maximização de retornos e a gestão eficaz dos riscos inerentes aos investimentos.

Com base no Asset Liability Management (ALM) conduzido em 05/05/2023 pela LDB Consultoria Financeira, a recomendação de alocação de recursos, seguindo a metodologia de Markowitz, sugere a distribuição estratégica dos ativos em relação aos *benchmarks*:

BENCHMARKS	% ALOCAÇÃO
SELIC/CDI	15,00%
IMA-B	60,08%
SMLL	4,92%
MSCI AC	10,00%
S&P500	10,00%
IFIX	0,00%
TOTAL	100,00%

Quanto à alocação em títulos públicos, as diretrizes do estudo de Asset Liability Management (ALM) estabelecem o seguinte:

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 - www.riopreto.sp.gov.br



ALOCAÇÃO EM (NTN-Bs) IMA-B = 60,08% = R\$ 286.009.522,11

286.009.522,11	NTNB	NTNB	NTNB	NTNB	NTNB	NTNB	NTNB
	15/08/2024	15/08/2026	15/05/2035	15/08/2040	15/05/2045	15/08/2050	15/05/2055
ALOCAÇÃO (%)	2,45%	7,48%	9,64%	12,23%	12,94%	23,30%	31,98%
ALOCAÇÃO (R\$)	6.998.594,81	21.380.957,96	27.564.413,17	34.978.533,72	36.996.661,72	66.627.856,11	91.462.504,62
ATUAL RIO PRETO PREV	6.713.106,93	21.037.530,06	27.334.198,70	34.898.508,88	36.674.644,32	26.422.397,00	10.355.975,84
DIFERENÇA	285.487,88	343.427,90	230.214,47	80.024,84	322.017,40	40.205.459,11	81.106.528,78
PU's NTNBS em 28/04/2023	4.119,54	4.195,11	4.232,63	4.164,10	4.214,92	4.152,57	4.220,63
QUANTIDADES de NTNBS	69	82	54	19	76	9.682	19.217

Conforme estabelecido em estudos de Asset Liability Management (ALM) anteriores, a carteira de investimentos iniciou o ano com a maior parte dos recursos alocados em títulos públicos, seja pela marcação na curva dos títulos públicos adquiridos diretamente, NTN-B, ou pela marcação à mercado através das cotas de fundos de investimentos. O Comitê de Investimentos segue diligenciando na execução das recomendações previstas no referido estudo através das indicações dos vértices de vencimentos delineados, visando assegurar a congruência entre o passivo e o ativo. Adicionalmente, busca oportunidades explorando a marcação à mercado através de fundos de investimentos. Essa abordagem não apenas busca a compatibilidade entre ativo e passivo, mas também demonstra a atenção à dinâmica do mercado financeiro, evidenciando o compromisso contínuo da entidade em seguir as diretrizes do ALM e otimizar a gestão de seus investimentos.

CENÁRIO ECONÔMICO E O DESEMPENHO DOS INVESTIMENTOS

Ao analisar o desempenho da carteira no primeiro trimestre de 2024, que registrou uma rentabilidade de 2,36%, muito próximo a meta atuarial de 2,63% e alcançando um cumprimento de meta de 89,73%. Reforçamos que este resultado é atribuído à abordagem estratégica adotada na gestão de ativos da Riopretoprev. A diversificação abrangente da carteira em diferentes segmentos, incluindo Renda Fixa, Renda Variável, Investimentos no Exterior e Investimentos Estruturados, desempenhou um papel fundamental nesse resultado.

Particularmente, as rentabilidades destacadas em cada segmento — sendo 2% em Renda Fixa, -4,27% em Renda Variável, 14,04% em Investimentos no Exterior e 8,42% em Investimentos Estruturados — refletem a eficácia da estratégia de alocação de recursos diversificada, evidenciando a capacidade do Comitê de Investimentos em aproveitar as oportunidades de mercado.

Este desempenho muito próximo à meta atuarial não apenas valida a gestão baseada nas recomendações do Manual do Pró-Gestão RPPS, mas também reafirma o compromisso do Comitê com a busca contínua pela excelência na administração dos ativos da Riopretoprev. A utilização de melhores práticas de gestão e a análise criteriosa do cenário econômico destacam-se como pilares fundamentais na consecução dos objetivos a longo prazo da entidade. Assim,

esta conclusão ressalta não apenas a busca pelo atingimento de metas, mas também a construção de uma base sólida para o sucesso contínuo da gestão de investimentos da Riopretoprev.

DA AVALIAÇÃO ANÁLITICA DOS INVESTIMENTOS DA RIOPRETOPREV NO PRIMEIRO TRIMESTRE DO ANO DE 2024

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS E O ATENDIMENTO ÀS DIRETRIZES ESTABELECIDAS NA RESOLUÇÃO 4.963/2021

Conforme os relatórios internos da Riopretoprev e da LDB Consultoria referentes ao primeiro trimestre do ano de 2024, verifica-se que todos os fundos em nossa carteira estão em conformidade com os limites estabelecidos pela Resolução CMN n.º 4.963/2021. O maior percentual em relação ao Patrimônio Líquido (PL) de um fundo, respeitando o limite de 15% estabelecido pelo Art. 19º da Resolução CMN n.º 4.963/2021 (reduzido para 5% para fundos mencionados no inciso V do Art. 7º), é de 6,57%, sendo atribuído ao fundo FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA. Os dois seguintes, com 5,99% e 4,68% do PL, são, respectivamente, BB PREV AÇÕES ALOCAÇÃO FIA e BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B.

No que diz respeito aos limites em relação ao PL da Riopretoprev, o maior percentual é do fundo FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP, representando 7,20% do PL. Os fundos BRADESCO INSTT FIC FI RF IMA-B e BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO ocupam o 2º e 3º lugares, com 4,64% e 4,55% do PL, respectivamente.

A conformidade com a Resolução CMN n.º 4.963/2021 abrange diferentes segmentos, destacando-se:

- ✓ Renda Fixa: 72,36% do PL (Limite 100%);
- ✓ Renda Variável: 12,20% do PL (Limite 50%, Art. 8, § 3º);
- ✓ Investimentos no Exterior: 7,11% do PL (Limite 10%);
- ✓ Investimentos Estruturados: 8,33% do PL (Limite 20%, Art. 10, § 2º).

Adicionalmente, a análise de Artigos específicos, como o Art. 14 (que representa 20,53% do PL, respeitando o limite de 60%) e o Art. 20 (assegurando que o total das aplicações não ultrapasse 5% do volume total gerido de recursos de terceiros das Instituições Financeiras), evidencia o cuidado e a aderência da Riopretoprev aos parâmetros normativos estabelecidos.

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS E O ATENDIMENTO ÀS DIRETRIZES ESTABELECIDAS NA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS

Conforme os relatórios internos da Riopretoprev e da LDB Consultoria, é notável que todos os fundos presentes em nossa carteira estão em conformidade com a Política de Investimentos, aproximando-se dos objetivos estabelecidos. A análise dos diferentes segmentos,

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 - www.riopreto.sp.gov.br

de acordo com os artigos, incisos e alíneas especificados, demonstra a aderência aos parâmetros previamente definidos:

Renda Fixa:

- ✓ Art. 7º, I, a => 34,41% do PL (Objetivo: 32%; Limite entre 0% e 60%);
- ✓ Art. 7º, I, b => 17,49% do PL (Objetivo: 19,5%; Limite entre 10% e 70%);
- ✓ Art. 7º, III, a => 18,78% do PL (Objetivo: 13,5%; Limite entre 0% e 60%);
- ✓ Art. 7º, IV => 1,11% do PL (Objetivo: 1,4%; Limite entre 0% e 10%);
- ✓ Art. 7º, V, b => 0,56% do PL (Objetivo: 0,6%; Limite entre 0% e 5%).

Renda Variável:

- ✓ Art. 8º, I => 12,20% do PL (Objetivo: 13%; Limite entre 0% e 30%).

Investimentos no Exterior:

- ✓ Art. 9º, II => 3,33% do PL (Objetivo: 5%; Limite entre 0% e 10%);
- ✓ Art. 9º, III => 3,78% do PL (Objetivo: 4%; Limite entre 0% e 10%).

Investimentos Estruturados:

- ✓ Art. 10º, I => 5,82% do PL (Objetivo: 7,5%; Limite entre 0% e 15%);
- ✓ Art. 10º, II => 2,52% do PL (Objetivo: 3,5%; Limite entre 0% e 8%).

Essa aderência aos limites e diretrizes estabelecidos reforça a eficácia da gestão de investimentos da Riopretoprev, evidenciando a coerência com os objetivos traçados na Política de Investimentos.

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS ENTRE INSTITUIÇÕES E *BENCHMARKS*

A alocação de recursos entre instituições e benchmarks na carteira da Riopretoprev é detalhada a seguir:

Banco do Brasil (R\$ 66,18 mi; 12,08% do PL):

- ✓ 10 fundos: 2 RV, 3 Invest. Exterior, 5 RF.
- ✓ Destaques: Ações ESG globais, Ações no exterior e diversas estratégias de renda fixa.

Caixa (R\$ 146,89 mi; 26,83% do PL):

- ✓ 14 fundos: 3 RV, 1 Multimercado Bolsa Americana, 1 Invest. Exterior, 9 RF.
- ✓ Notáveis: fundos DI vinculados a contas, múltiplos IMAs e estratégias alinhadas ao cenário econômico.

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 - www.riopreto.sp.gov.br

Bradesco (R\$ 45,92 mi; 8,38% do PL):

- ✓ 3 fundos: 2 RF (IMA-B5 e IMA-B), 1 RV Mid Small Cap.

XP Investimentos (R\$ 9,786 mi; 1,79% do PL):

- ✓ 3 fundos: RV dividendos, Invest. Exterior e FIP Pátria Investimentos.
- ✓ Custódia das NTN-Bs (R\$ 188,46 mi; 34,41% do PL)
- ✓ Custódia LF BTG Pactual (R\$ 6,075mi; 1,11% do PL)

Santander (R\$ 17,726 mi; 3,24% do PL):

- ✓ 2 fundos: IMA B5 e Exterior Global ESG, sem variação cambial.

Western Asset (R\$ 27,609 mi; 5,04% do PL):

- ✓ 3 fundos: IMA-B ATIVO, IMA-B5 ATIVO e Invest. Exterior Ações BDR.

Kinea/Lions (R\$ 11,579 mi; 2,12% do PL):

- ✓ 1 fundo FIP adquirido em 2017, em fase de desinvestimentos.

Kinea/Intrag (R\$ 1,254 mi; 0,23% do PL):

- ✓ 1 fundo FIP em captação inicial.

BTG Pactual (R\$ 25,21 mi; 4,6% do PL):

- ✓ 2 fundos: Multimercado S&P 500 e FIP Economia Real em captação inicial.

Essa estratégia reflete a abordagem criteriosa da Riopretoprev, buscando otimizar o retorno e gerenciar riscos eficientemente.

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DA CARTEIRA E COMENTÁRIOS SOBRE A PERFORMANCE DOS FUNDOS E RESPECTIVOS SEGMENTOS

A presente seção oferece uma análise detalhada da distribuição dos recursos da carteira da Riopretoprev, apresentando uma visão abrangente dos diferentes segmentos de investimento e seus respectivos fundos. Ao longo do texto, serão fornecidos comentários aprofundados sobre o desempenho de cada fundo, destacando os resultados alcançados em relação às metas estabelecidas e as condições de mercado enfrentadas durante o período em análise. Essa análise crítica visa proporcionar uma compreensão holística da performance da carteira, oferecendo insights valiosos para a tomada de decisões estratégicas futuras.

RENDA FIXA:

Ao final do primeiro trimestre, 72,36% dos recursos (R\$ 396,24 milhões) foram alocados em Renda Fixa, conforme a Resolução n.º 4.963/2021 (art. 7º). O segmento registrou uma valorização de 2,00 % no período, onde ao final do trimestre as curvas de juros futuras aumentaram, refletindo o aumento da incerteza sobre a condução da política econômica. Sem alterações na estratégia no trimestre, a manutenção das deliberações de 21/08/23 foi reafirmada em 05/02/2024. Em fevereiro, o fundo CAIXA BRASIL RF Ref DI LP recebeu a alocação dos recursos recebidos de pagamento de cupom das NTN-Bs de vencimento par e também o desinvestimento do fundo Rio Bravo Proteção FIM, porém o não recebimento da contribuição suplementar patronal do período levou à utilização de parte dos recursos no fundo para cobertura da folha de pagamento de benefícios previdenciários. Títulos públicos federais valorizaram-se em 3,07% no, superando a meta atuarial. Os fundos 100% títulos públicos, especialmente os de longo prazo, apresentaram rentabilidade média de 0,81% no trimestre. Fundos de renda fixa geral alcançaram rendimento médio de 1,03% no período. Destaque para ativos emitidos por instituições financeiras, como a Letra Financeira Subordinada do Banco BTG Pactual SA, com rendimento de 3,82% no trimestre. O fundo de renda fixa de crédito privado, BB Prev CP IPCA III, apresentou rendimento de 2,39%. O CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF foi o fundo que se destacou, rendendo 2,78% no trimestre. Todos os títulos públicos e privados entregaram a meta atuarial no período, já nos fundos de investimentos apenas alguns fundos de prazo mais curtos, foram beneficiados pela marcação a mercado e entregaram a meta atuarial. Assim, não visualizamos nenhum fundo ou ativo no segmento que requeira maior atenção e análise no momento pelo Comitê de Investimentos. No geral, a Renda Fixa encerrou o 1º trimestre de 2024 com valorização de R\$ 7.748.817,06, rendimento médio de 2%, abaixo da meta atuarial trimestral de 2,63%.

RENDA VARIÁVEL:

No trimestre, 12,20% (R\$ 66,79 milhões) dos recursos foram alocados em Renda Variável, conforme a Resolução n.º 4.963/2021 (art. 8º). Em fundos de ações (Art. 8º, I), R\$ 66,79 milhões (12,20% do PL) se desvalorizaram em média 4,27% no 1º trimestre, próximo ao principal índice do setor, o Ibovespa, que não seguiu a dinâmica dos índices internacionais, desvalorizando-se em 4,53% no trimestre, justificado principalmente pela saída de capital estrangeiro com investidores mais cautelosos. Os recursos distribuíram-se em vários segmentos de mercado, como ETF IBOVESPA, SMALL CAPS, DIVIDENDOS, ALOCAÇÃO EM SEGMENTOS DE MERCADO, FUNDOS DE "VALOR" e AÇÕES LIVRES.

No trimestre, em especial no mês de março, o Comitê de Investimentos iniciou processo de otimização do segmento de renda variável, conforme deliberado em reunião ordinária de 22/03/24, com resgate parcial dos fundos de maior concentração do segmento: BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS, BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA e FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS (sendo que esse último será cotizado e liquidado apenas no final de abril/2024), porém os recursos do resgate parcial do BB Ações Alocação FIA fecharam o mês alocados no BB PREV RF FLUXO FIC e os recursos do resgate parcial do BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS ficaram disponíveis na conta corrente da CEF e serão realocados no início de abril em outras estratégias do segmento em fundos com gestão ativa e foco em empresas com alto potencial de valorização. A movimentação total corresponde a menos de 2,5% do total da carteira de investimentos da RIOPRETOPREV e a

cerca de 1% do total do ativo atual da entidade. Resumo da Operação e deliberação: a) Resgate parcial do BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA, CNPJ: 18.270.783/0001-99, referente as aplicações efetuadas em 02 e 03/2014, R\$ 4.551.396,72, com aplicação dos recursos no fundo TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA, CNPJ: 39.346.123/0001-14; b) Resgate parcial do BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS, CNPJ: 06.988.623/0001-09, referente a aplicação efetuada em 05/06/2019, R\$ 2.116.716,16, com aplicação dos recursos no fundo BTG PACTUAL FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES OPORTUNIDADES LISTADAS I, CNPJ: 46.300.375/0001-78; c) Resgate parcial do FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS, CNPJ: 14.507.699/0001-95, no valor de R\$ 4.500.000,00 com aplicação dos recursos no fundo GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA, CNPJ: 38.280.883/0001-03.

No fechamento do trimestre, apenas o fundo FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE fechou com rentabilidade positiva de 0,85%, porém abaixo da meta atuarial do período. Os membros continuam monitorando o fundo BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS que tem apresentado dificuldade em sua recuperação e sofrido diversos resgates por parte dos cotistas. No geral, a Renda Variável fechou o trimestre com desvalorização de R\$ 3.357.106,17.

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR:

No trimestre, 7,11% (R\$ 38,959 milhões) dos recursos foram destinados a Investimentos no Exterior, seguindo a Resolução n.º 4.963/2021 (art. 9º). Nesse 1º trimestre, o segmento teve valorização de 14,04%. Nos fundos de Investimento no Exterior GLOBAL (Art. 9º, II), ficaram 3,33% do PL da Riopretoprev, R\$ 18,237 milhões, com rentabilidade média de 12,37%. Os fundos BDR (Art. 9º, III) somam R\$ 20,721 milhões (3,78% do PL), com desempenho médio de 15,57% no trimestre. Foi feita uma única nova aplicação no segmento no fundo BB AÇÕES GLOBAIS BDR NÍVEL I FIC FIA referente recursos previdenciários que estavam disponíveis no fundo de fluxo do Banco do Brasil e recursos recebidos do cupom de fundo de vértice BB PREV RF TP IPCA III FI que totalizaram R\$ 228.238,24.

Todos os fundos fecharam o trimestre com rentabilidade acima da meta atuarial, o destaque ficou para o fundo WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I com 16,41% de rentabilidade no período. Importante salientar que, em continuidade a diligência com o fundo BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI, o Comitê de Investimentos, no início de fevereiro, solicitou novas informações sobre a gestão do fundo, onde de acordo com as perspectivas e estratégias seguem “vendo oportunidades significativas de investimento decorrentes a fatores climáticos e ambientais que impactam as tendências da sociedade, a lucratividade das empresas e os preços de suas ações”. No geral, os Investimentos no Exterior fecharam o trimestre com valorização de R\$ 4.782.452,54.

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS:

No trimestre, 8,33% (R\$ 45,627 milhões) dos recursos foram alocados em Investimentos Estruturados. Em fundos Multimercados (art. 10º, I), ficaram 5,82% do PL da Riopretoprev, R\$ 31,849 milhões, com valorização média de 10,85%. Foi feito o desinvestimento total do fundo Rio Bravo Proteção FIM que teve a operação estruturada finalizada em 16/02/2024 e que resultou na entrega do índice Ibovespa do período da aplicação, correspondente a 14,79%.

Apesar do fundo abrir para novas captações e realização de nova operação estruturada o Comitê de Investimentos em reunião ordinária de 05/02/2024 deliberou pelo resgate total do fundo com aplicação dos recursos no fundo CAIXA BRASIL RF Ref DI LP. Em fundos de participação (art. 10º, II), ficaram 2,52% do PL, R\$ 13,777 milhões, aplicados em FIP Kinea IV, FIP Kinea V, FIP BTG Pactual Economia Real II e PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C. Valorizaram-se 3,07% no trimestre impactados pela remarcação anual de cotas positiva dos fundos de gestão Kinea. Apenas o PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C recebeu nova integralização de capital no período. No geral, o segmento de Investimentos Estruturados teve valorização de R\$ 3.573.320,09, média de 8,42%.

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA

No trimestre, R\$ 2.116.716,16 ficaram disponíveis em conta corrente. O valor é referente ao resgate parcial do fundo BRADESCO FIA MID SMALL CAPS que foi liquidado no dia 28/03/2024 e não houve tempo hábil para aplicação dos recursos. Entretanto, conforme detalhado na estratégia de renda variável foi aplicado no início de abril de acordo com deliberação do Comitê de Investimentos.

PRINCIPAIS INDICADORES DOS INVESTIMENTOS DA RIOPRETOPREV NO ANO

Frente à volatilidade inerente do mercado financeiro, o empenho do Comitê de Investimentos emerge como um elemento crucial na busca pelo cumprimento da meta atuarial estabelecida. Em um período desafiador, marcado por oscilações e incertezas, o Comitê demonstrou uma abordagem estratégica, trabalhando para otimizar os retornos e mitigar os riscos.

A rentabilidade da carteira de investimentos ficou muito próxima da meta atuarial no primeiro trimestre. Esse resultado não apenas reflete a competência e a diligência do Comitê, mas também evidencia sua firme dedicação em garantir a saúde financeira e o cumprimento dos compromissos previdenciários.

Além disso, é importante ressaltar que a meta gerencial, representada pelo IMA-B, rendeu apenas 0,18% no período. Nesse contexto, é digno de nota que somente os investimentos no exterior superaram a meta estabelecida, destacando a importância da diversificação e da estratégia global do portfólio.

Abaixo segue uma análise detalhada dos principais indicadores que permite observar o desempenho

RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL no 1º TRIMESTRE:

- ✓ RENDIMENTO no 1º tri-2024 (em R\$): R\$ 12.747.483,52
- ✓ RENDIMENTO no 1º tri-2024 (em %): 2,36%

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 - www.riopreto.sp.gov.br

- ✓ META ATUARIAL no 1º tri-2024 (%): 2,63%
- ✓ RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL (%) NO 1º tri-2024: 89,73%

RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL ANUAL:

- ✓ RENDIMENTO ano (em R\$): R\$ 12.747.483,52
- ✓ RENDIMENTO ano (em %): 2,36%
- ✓ META ATUARIAL ano (%): 2,63%
- ✓ META GERENCIAL (IMA-B) (%): 0,18%
- ✓ CDI (%): 2,62%
- ✓ IBOVESPA (%): -4,53%
- ✓ IBX-50 (%): -4,06%
- ✓ IRF M1 (%): 2,46%
- ✓ S&P 500 (%): 13,68%
- ✓ MSCI ACWI (%): 11,17%

PERFORMANCE NOS ÚLTIMOS PERÍODOS:

- ✓ NOS ÚLTIMOS 3 MESES: 89,73%
- ✓ NOS ÚLTIMOS 6 MESES: 158,75%
- ✓ NOS ÚLTIMOS 12 MESES: 159,85%
- ✓ DO ANO EM CURSO: 89,73%
- ✓ DESDE O INÍCIO DA ADMINISTRAÇÃO DA CARTEIRA: 61,91%
- ✓ DESDE O INÍCIO DA RIOPRETOPREV: 86,72%

Com base nos resultados apresentados, o desempenho do portfólio de investimentos no primeiro trimestre de 2024 revela uma gestão eficiente e resiliente por parte do Comitê de Investimentos, apesar do ambiente desafiador do mercado financeiro.

O rendimento de 2,36% superou significativamente a meta gerencial (IMA-B) de 0,18%, e os principais índices de mercado brasileiros (IBOVESPA e IBX-50), com exceção ao CDI, indicando uma performance sólida em relação aos benchmarks nacionais.

É especialmente notável o destaque dos investimentos no exterior, representados pelos índices S&P 500 e MSCI ACWI, que registraram ganhos expressivos de 13,68% e 11,17%, respectivamente. Isso ressalta a importância da diversificação internacional no contexto de um mercado doméstico volátil.

Apesar dos desafios representados pelas condições adversas do mercado, o Comitê de Investimentos demonstrou sua capacidade de adaptação e tomada de decisões acertadas, resultando em um desempenho geral satisfatório e próximo da meta atuarial estabelecida, atingindo 89,73%.

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 - www.riopreto.sp.gov.br

Esses resultados refletem não apenas a competência e expertise do Comitê, mas também sua diligência em proteger e fazer crescer os recursos sob sua responsabilidade, assegurando assim a sustentabilidade e a solidez do plano previdenciário no longo prazo.

DO ANEXO I – DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS DOS INVESTIMENTOS DETALHADAS

É com satisfação que informamos a incorporação do Anexo I ao presente relatório, apresentando as demonstrações financeiras detalhadas dos investimentos referentes ao primeiro trimestre do ano de 2024. Este anexo foi elaborado minuciosamente para oferecer uma visão aprofundada da performance e alocação de recursos ao longo do último trimestre, proporcionando uma análise abrangente e transparente da gestão dos investimentos da Riopretoprev. A inclusão deste anexo visa enriquecer a compreensão dos *stakeholders* sobre as estratégias adotadas, os resultados obtidos e contribuir para uma tomada de decisão embasada e esclarecedora.

São José do Rio Preto, na data da assinatura digital.

(assinatura digital)

JAIR MORETTI

Diretor Superintendente

(assinatura digital)

WILCLEM DE LAZARI ARAUJO

Diretor Técnico e Presidente do Conselho
Municipal de Previdência

(assinatura digital)

ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO60

Diretor Executivo

(assinatura digital)

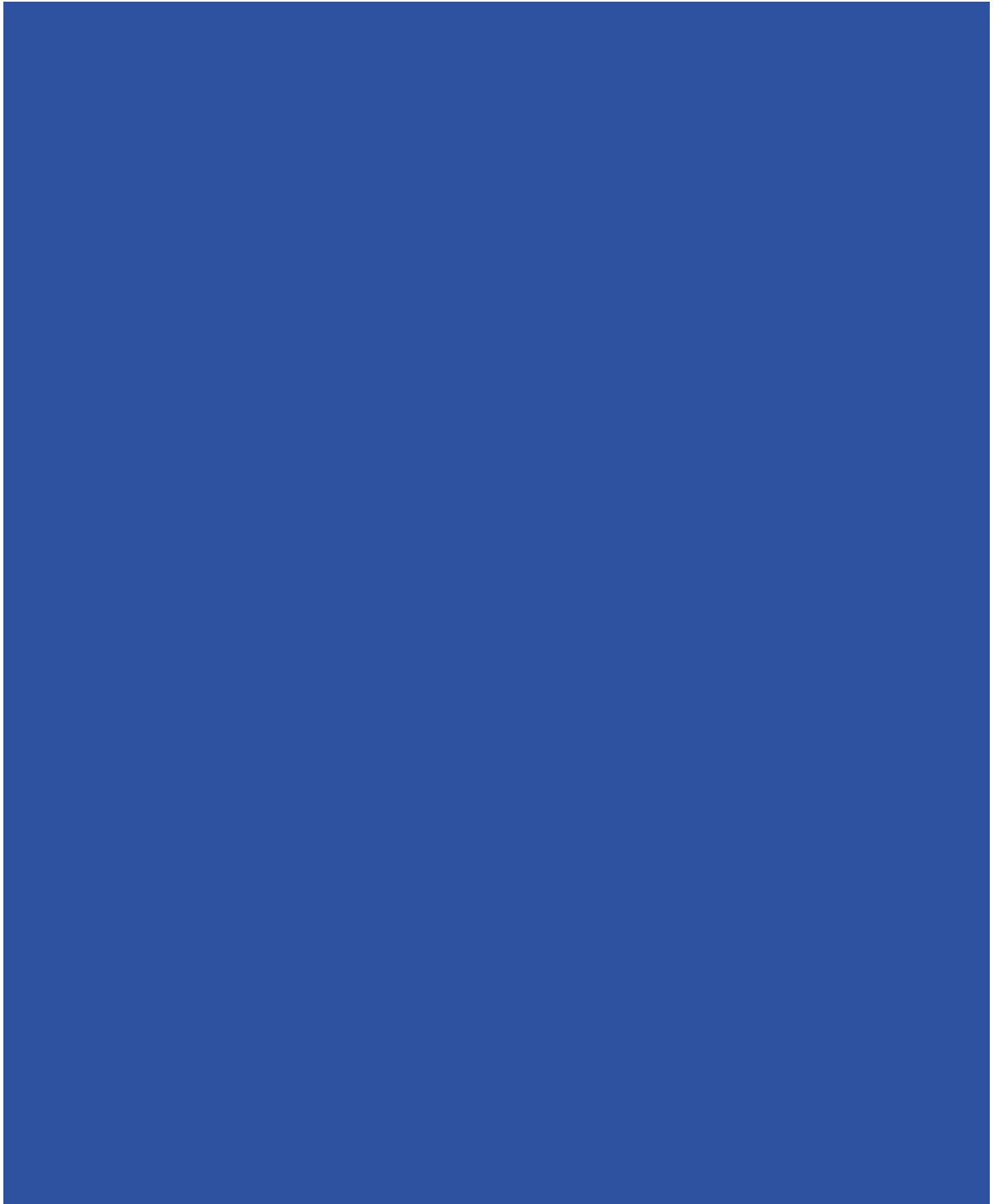
**PATRICIA NATO TONINATO
BARTOLOMEI**

Coordenadora do Comitê de Investimentos

(assinatura digital)

FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES

Presidente do Conselho Fiscal



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 - www.riopreto.sp.gov.br



SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO

1º TRIMESTRE 2024

Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 28.03.2024.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

72,36%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,825000%)	0,40	0,03	0,93	2,85	5.730.677,57	1,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,875000%)	0,40	0,03	0,93	2,86	5.784.228,83	1,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,965000%)	0,40	0,03	0,94	2,89	5.691.575,93	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,41	0,03	0,97	2,97	5.696.639,52	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,100000%)	0,44	0,03	1,03	3,15	5.468.573,96	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,690000%)	0,55	0,03	0,99	3,06	5.680.075,46	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,750000%)	4,06	0,03	1,00	3,07	2.234.844,55	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,854000%)	0,56	0,03	1,01	3,10	5.560.797,69	1,02
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,895000%)	0,56	0,03	1,01	3,10	21.561.083,16	3,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,421000%)	0,58	0,04	1,05	3,23	5.433.285,14	0,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,351000%)	0,66	0,04	1,04	3,21	10.808.858,77	1,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (5,270000%)	0,27	0,03	0,96	2,96	6.940.073,81	1,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,408000%)	0,27	0,04	1,12	3,46	10.319.207,23	1,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,525000%)	0,29	0,03	0,98	3,02	11.326.414,59	2,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,563000%)	0,30	0,04	1,06	3,26	10.577.077,81	1,93



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,830000%)	0,45	0,03	0,93	2,85	11.699.322,79	2,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,873000%)	0,45	0,03	0,93	2,86	11.637.252,40	2,13
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,045000%)	0,46	0,03	0,95	2,90	5.713.056,71	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,47	0,03	0,97	2,98	5.713.805,35	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,49	0,03	0,99	3,06	1.475.405,35	0,27
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,760000%)	0,60	0,03	1,00	3,07	1.122.005,69	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,832500%)	0,60	0,03	1,01	3,09	5.834.406,59	1,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,042000%)	0,61	0,03	1,02	3,14	10.662.377,47	1,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,351000%)	0,63	0,04	1,04	3,21	10.485.688,04	1,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,352000%)	0,63	0,04	1,04	3,21	5.301.834,22	0,97
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,46	0,03	1,00	3,07	188.458.568,63	34,41

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,97	0,03	0,77	2,41	13.795.540,61	2,52	6.783.435.564,44	0,20
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,04	0,79	2,55	5.207.958,27	0,95	13.231.140.496,66	0,04
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,90	0,04	0,91	2,78	1.004.763,48	0,18	236.769.060,66	0,42
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,89	0,04	0,91	2,77	579.849,22	0,11	192.185.931,64	0,30
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,90	-0,00	0,06	0,11	15.788.346,37	2,88	5.324.825.927,52	0,30
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,88	-0,00	0,06	0,13	3.602.570,54	0,66	5.029.824.301,86	0,07
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	4,73	-0,00	-0,04	-0,29	5.579.006,40	1,02	168.544.602,31	3,31

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,69	0,08	0,75	1,99	9.951.169,61	1,82	1.269.573.693,69	0,78
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,00	-0,08	-0,56	-1,52	18.359.534,14	3,35	1.366.454.531,96	1,34
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,62	0,08	0,65	1,56	11.021.937,47	2,01	406.970.875,94	2,71
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,36	0,03	0,58	1,80	10.884.617,63	1,99	5.431.217.487,91	0,20
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			2,64	0,01	0,29	0,81	95.775.293,74	17,49		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,07	0,04	0,87	2,72	23.361.858,96	4,27	16.216.695.874,70	0,14
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	3,95	0,00	0,04	0,09	25.383.309,06	4,64	541.976.373,60	4,68
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3,99	-0,01	0,10	0,20	39.402.522,56	7,20	1.280.284.121,42	3,08
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,75	1,69	4.871.337,75	0,89	4.354.660.093,34	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,04	0,75	2,37	119.605,74	0,02	1.092.831.104,05	0,01
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,70	0,08	0,74	1,97	8.516.605,18	1,56	850.459.230,83	1,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,85	2,70	1.189.721,90	0,22	6.030.179.613,18	0,02
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a			2,45	0,01	0,34	1,03	102.844.961,15	18,78		

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,46% a.a	4,36	1,44	1,44	3,82	6.075.578,11	1,11		
Sub-total Artigo 7º IV			4,36	1,44	1,44	3,82	6.075.578,11	1,11		

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,28	0,06	0,77	2,39	3.088.566,86	0,56	311.881.894,95	0,99
Sub-total Artigo 7º V, Alínea b			1,28	0,06	0,77	2,39	3.088.566,86	0,56		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Renda Fixa

1,31

0,05

0,66

2,00

396.242.968,49

72,36

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

12,20%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	15,12	0,09	-1,58	-7,45	2.246.425,70	0,41	1.336.503.943,21	0,17
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	20,52	0,08	-0,11	-5,08	12.015.388,88	2,19	652.744.629,19	1,84
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	15,52	0,39	-0,44	-3,57	19.684.812,60	3,59	743.274.690,86	2,65
XP	SANTANDER	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	13,53	0,42	-1,57	-1,28	3.072.301,80	0,56	326.565.041,45	0,94
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	15,95	0,32	-0,65	-4,44	4.794.628,00	0,88	72.986.253,63	6,57
BB	BB	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	14,76	0,35	-1,18	-5,46	19.663.133,13	3,59	328.259.131,39	5,99
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,75	1,04	1,36	0,85	5.314.231,69	0,97	716.419.031,98	0,74
Sub-total Artigo 8º I			15,56	0,36	-0,59	-4,27	66.790.921,80	12,20		
Renda Variável			15,56	0,36	-0,59	-4,27	66.790.921,80	12,20		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

7,11%

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BB	BB	BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,99	1,13	4,75	10,39	2.657.731,25	0,49	377.378.412,61	0,70
BB	BB	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,35	1,09	3,66	13,55	803.894,37	0,15	1.350.128.697,33	0,06
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,82	1,35	2,16	15,24	7.000.665,56	1,28	769.263.355,99	0,91
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	11,38	0,56	3,35	10,46	7.775.181,01	1,42	413.689.904,13	1,88
Sub-total Artigo 9º II			11,75	0,97	3,10	12,37	18.237.472,19	3,33		

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	14,00	0,35	3,48	14,98	7.029.275,51	1,28	2.280.222.056,45	0,31
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	15,39	0,43	1,57	16,41	11.007.861,45	2,01	1.559.186.452,18	0,71
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	13,27	-0,02	2,16	13,65	2.684.789,43	0,49	739.738.803,19	0,36
Sub-total Artigo 9º III			14,43	0,35	2,28	15,57	20.721.926,39	3,78		

Investimentos no Exterior

11,94 0,64 2,67 14,04 38.959.398,58 7,11

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,33%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	11,50	0,14	3,44	11,26	24.919.244,72	4,55	648.677.226,01	3,84
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,49	0,14	3,39	11,13	6.930.598,59	1,27	1.864.604.527,50	0,37
Sub-total Artigo 10º I			11,23	0,14	3,43	10,85	31.849.843,31	5,82		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
PÁTRIA	XP	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	13,37	4,55	4,55	2,22	651.921,75	0,12	108.653.624,60	0,60
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	8,39	-2,38	-2,38	-6,87	291.396,42	0,05	122.656.310,27	0,24
KINEA	INTRAG	KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	51,52	8,45	8,45	7,01	1.254.418,48	0,23	136.982.498,03	0,92
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	29,68	0,11	0,11	2,98	11.579.346,84	2,11	369.381.113,95	3,13
Sub-total Artigo 10º II			28,04	0,96	0,95	3,07	13.777.083,49	2,52		

Investimentos Estruturados

11,69 0,39 2,67 8,42 45.626.926,80 8,33

Total

3,29 0,16 0,79 2,36 547.620.215,67 100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	2.116.716,16
Sub-total Disponibilidades Financeiras	2.116.716,16
Total	549.736.931,83

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			Pró-Gestão Nível 4	
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
Renda Fixa								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	188.458.568,63	34,41	0,00	32,00	60,00	36,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	95.775.293,74	17,49	10,00	19,50	70,00	22,38	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	102.844.961,15	18,78	0,00	13,50	60,00	15,00	80,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	6.075.578,11	1,11	0,00	1,40	10,00	1,10	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.088.566,86	0,56	0,00	0,60	5,00	0,60	20,00
	Total Renda Fixa	396.242.968,49	72,36					100,00
Renda Variável								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	66.790.921,80	12,20	0,00	13,00	30,00	4,92	50,00
	Total Renda Variável	66.790.921,80	12,20					50,00
Investimentos no Exterior								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	18.237.472,19	3,33	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	20.721.926,39	3,78	0,00	4,00	10,00	5,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	38.959.398,58	7,11					10,00
Investimentos Estruturados								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	31.849.843,31	5,82	0,00	7,50	15,00	7,50	15,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	13.777.083,49	2,52	0,00	3,50	8,00	2,50	15,00
	Total Investimentos Estruturados	45.626.926,80	8,33					20,00
Total		547.620.215,67	100,00					

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

Estratégia Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Trimestre (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,00 120,03	3,07 117,15	3,07 117,15	5,54 100,01	10,21 82,57	1.866.766,85	5.665.816,58
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,29 34,30	0,81 30,86	0,81 30,86	4,96 89,59	10,20 82,51	272.646,33	766.672,42
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,34 40,85	1,03 39,28	1,03 39,28	5,13 92,71	11,95 96,66	336.694,64	1.020.878,41
Artigo 7º IV % do CDI	1,44 173,18	3,82 145,43	3,82 145,43	6,72 121,28	13,03 105,42	86.448,38	223.392,54
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,77 92,39	2,39 91,01	2,39 91,01	5,11 92,36	10,16 82,18	23.601,92	72.057,11
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-0,59 0,12	-4,27 0,26	-4,27 0,26	8,18 -1,73	21,28 -4,46	-508.575,29	-3.357.106,17
Artigo 9º II % do CDI	3,10 372,25	12,37 471,32	12,37 471,32	24,61 444,38	29,37 237,60	548.811,78	2.007.777,83
Artigo 9º III % do CDI	2,28 274,02	15,57 593,22	15,57 593,22	27,04 488,27	34,73 280,96	462.705,65	2.774.674,71
Artigo 10º I % do CDI	3,43 411,21	10,85 413,35	10,85 413,35	25,24 455,75	35,89 290,28	1.055.431,29	3.164.358,15
Artigo 10º II % do CDI	0,95 113,91	3,07 116,81	3,07 116,81	3,61 65,28	5,15 41,63	129.490,85	408.961,94
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO (Total)						4.274.022,40	12.747.483,52

RESULTADO POR ATIVO

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (4,825000%)	5.677.945,31	0,00	0,00	0,00	5.730.677,57	52.732,26	158.892,15
NTN-B 150535 (4,875000%)	5.730.785,39	0,00	0,00	0,00	5.784.228,83	53.443,44	161.033,18
NTN-B 150535 (4,965000%)	5.638.607,67	0,00	0,00	0,00	5.691.575,93	52.968,26	159.599,44
NTN-B 150535 (5,320000%)	5.642.110,38	0,00	0,00	0,00	5.696.639,52	54.529,14	164.265,59
NTN-B 150535 (6,100000%)	5.413.055,02	0,00	0,00	0,00	5.468.573,96	55.518,94	167.168,48

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150545 (5,690000%)	5.624.136,13	0,00	0,00	0,00	5.680.075,46	55.939,33	168.471,06
NTN-B 150545 (5,750000%)	2.212.735,90	0,00	0,00	0,00	2.234.844,55	22.108,65	66.581,99
NTN-B 150545 (5,854000%)	5.505.360,11	0,00	0,00	0,00	5.560.797,69	55.437,58	166.956,51
NTN-B 150545 (5,895000%)	21.345.473,08	0,00	0,00	0,00	21.561.083,16	215.610,08	649.300,02
NTN-B 150545 (6,421000%)	5.376.835,22	0,00	0,00	0,00	5.433.285,14	56.449,92	169.937,95
NTN-B 150555 (6,351000%)	10.697.114,36	0,00	0,00	0,00	10.808.858,77	111.744,41	336.408,26
NTN-B 150824 (5,270000%)	6.873.901,31	0,00	0,00	0,00	6.940.073,81	66.172,50	202.088,82
NTN-B 150824 (7,408000%)	10.204.517,56	0,00	0,00	0,00	10.319.207,23	114.689,67	349.921,55
NTN-B 150826 (5,525000%)	11.216.263,30	0,00	0,00	0,00	11.326.414,59	110.151,29	336.327,86
NTN-B 150826 (6,563000%)	10.466.084,08	0,00	0,00	0,00	10.577.077,81	110.993,73	338.837,22
NTN-B 150840 (4,830000%)	11.591.632,15	0,00	0,00	0,00	11.699.322,79	107.690,64	328.469,13
NTN-B 150840 (4,873000%)	11.529.744,43	0,00	0,00	0,00	11.637.252,40	107.507,97	327.884,46
NTN-B 150840 (5,045000%)	5.659.544,21	0,00	0,00	0,00	5.713.056,71	53.512,50	163.234,58
NTN-B 150840 (5,360000%)	5.658.942,99	0,00	0,00	0,00	5.713.805,35	54.862,36	167.401,04
NTN-B 150840 (5,690000%)	1.460.876,70	0,00	0,00	0,00	1.475.405,35	14.528,65	44.344,98
NTN-B 150850 (5,760000%)	1.110.898,51	0,00	0,00	0,00	1.122.005,69	11.107,18	33.899,39
NTN-B 150850 (5,832500%)	5.776.328,28	0,00	0,00	0,00	5.834.406,59	58.078,31	177.254,21
NTN-B 150850 (6,042000%)	10.554.595,23	0,00	0,00	0,00	10.662.377,47	107.782,24	329.066,33
NTN-B 150850 (6,351000%)	10.377.295,13	0,00	0,00	0,00	10.485.688,04	108.392,91	331.063,09
NTN-B 150850 (6,352000%)	5.247.019,33	0,00	0,00	0,00	5.301.834,22	54.814,89	167.409,29
	186.591.801,78	0,00	0,00	0,00	188.458.568,63	1.866.766,85	

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	13.690.584,86	0,00	0,00	0,00	13.795.540,61	104.955,75	324.427,65
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	15.778.940,10	0,00	0,00	0,00	15.788.346,37	9.406,27	16.735,97
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	574.618,58	0,00	0,00	0,00	579.849,22	5.230,64	15.890,46
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	995.656,47	0,00	0,00	0,00	1.004.763,48	9.107,01	27.580,04

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18.462.765,81	0,00	0,00	0,00	18.359.534,14	-103.231,67	-283.552,54
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3.362.938,50	237.331,59	0,00	0,00	3.602.570,54	2.300,45	5.420,41
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.937.414,52	230.822,91	0,00	0,00	5.207.958,27	39.720,84	120.378,17
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.822.085,24	0,00	0,00	0,00	10.884.617,63	62.532,39	192.279,81
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	9.877.027,90	0,00	0,00	0,00	9.951.169,61	74.141,71	194.438,35
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5.581.352,11	0,00	0,00	0,00	5.579.006,40	-2.345,71	-16.108,08
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	10.951.108,82	0,00	0,00	0,00	11.021.937,47	70.828,65	169.182,18
	95.034.492,91	468.154,50	0,00	0,00	95.775.293,74	272.646,33	

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF FLUXO FIC	1.726,82	4.868.901,82	0,00	0,00	4.871.337,75	709,11	1.625,07
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	8.454.183,47	0,00	0,00	0,00	8.516.605,18	62.421,71	164.417,72
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	25.373.807,91	0,00	0,00	0,00	25.383.309,06	9.501,15	23.876,94
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	941.360,00	0,00	-826.585,61	0,00	119.605,74	4.831,35	15.075,03
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1.179.707,67	0,00	0,00	0,00	1.189.721,90	10.014,23	31.260,18
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	25.929.777,24	5.399.660,88	-8.178.222,03	0,00	23.361.858,96	210.642,87	705.464,07
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	38.831.739,73	532.208,61	0,00	0,00	39.402.522,56	38.574,22	79.159,40
	100.712.302,84	10.800.771,31	-9.004.807,64	0,00	102.844.961,15	336.694,64	

Artigo 7º IV (Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira))

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,46% a.a	5.989.129,73	0,00	0,00	0,00	6.075.578,11	86.448,38	223.392,54
	5.989.129,73	0,00	0,00	0,00	6.075.578,11	86.448,38	

Artigo 7º V, Alínea b (FI RF - Crédito Privado)

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.064.964,94	0,00	0,00	0,00	3.088.566,86	23.601,92	72.057,11
	3.064.964,94	0,00	0,00	0,00	3.088.566,86	23.601,92	

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	24.556.336,59	0,00	-4.551.396,72	0,00	19.663.133,13	-341.806,74	-1.453.376,37
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	2.282.579,56	0,00	0,00	0,00	2.246.425,70	-36.153,86	-180.880,57
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	14.166.494,84	0,00	-2.116.716,16	0,00	12.015.388,88	-34.389,80	-775.973,00
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	4.826.202,03	0,00	0,00	0,00	4.794.628,00	-31.574,03	-222.736,63
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	19.771.558,24	0,00	0,00	0,00	19.684.812,60	-86.745,64	-729.117,06
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	5.243.089,15	0,00	0,00	0,00	5.314.231,69	71.142,54	44.671,86
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	3.121.349,56	0,00	0,00	0,00	3.072.301,80	-49.047,76	-39.694,40
	73.967.609,97	0,00	-6.668.112,88	0,00	66.790.921,80	-508.575,29	

Artigo 9º II (Fundos de Investimento no Exterior)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	2.537.304,19	0,00	0,00	0,00	2.657.731,25	120.427,06	250.071,88
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	775.496,02	0,00	0,00	0,00	803.894,37	28.398,35	95.920,53
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6.852.438,84	0,00	0,00	0,00	7.000.665,56	148.226,72	925.831,30
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	7.523.421,36	0,00	0,00	0,00	7.775.181,01	251.759,65	735.954,12
	17.688.660,41	0,00	0,00	0,00	18.237.472,19	548.811,78	

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	2.628.047,73	0,00	0,00	0,00	2.684.789,43	56.741,70	307.185,05
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	6.793.022,02	0,00	0,00	0,00	7.029.275,51	236.253,49	915.851,66
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	10.838.150,99	0,00	0,00	0,00	11.007.861,45	169.710,46	1.551.638,00
	20.259.220,74	0,00	0,00	0,00	20.721.926,39	462.705,65	

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	24.091.350,07	0,00	0,00	0,00	24.919.244,72	827.894,65	2.521.240,68
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6.703.061,95	0,00	0,00	0,00	6.930.598,59	227.536,64	693.985,54
	30.794.412,02	0,00	0,00	0,00	31.849.843,31	1.055.431,29	

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	298.509,31	0,00	0,00	0,00	291.396,42	-7.112,89	-21.481,74
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	11.567.180,55	0,00	0,00	0,00	11.579.346,84	12.166,29	334.991,48
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	1.156.652,77	0,00	0,00	0,00	1.254.418,48	97.765,71	82.132,42
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	586.075,17	39.174,84	0,00	0,00	651.921,75	26.671,74	13.319,78
	13.608.417,80	39.174,84	0,00	0,00	13.777.083,49	129.490,85	

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3

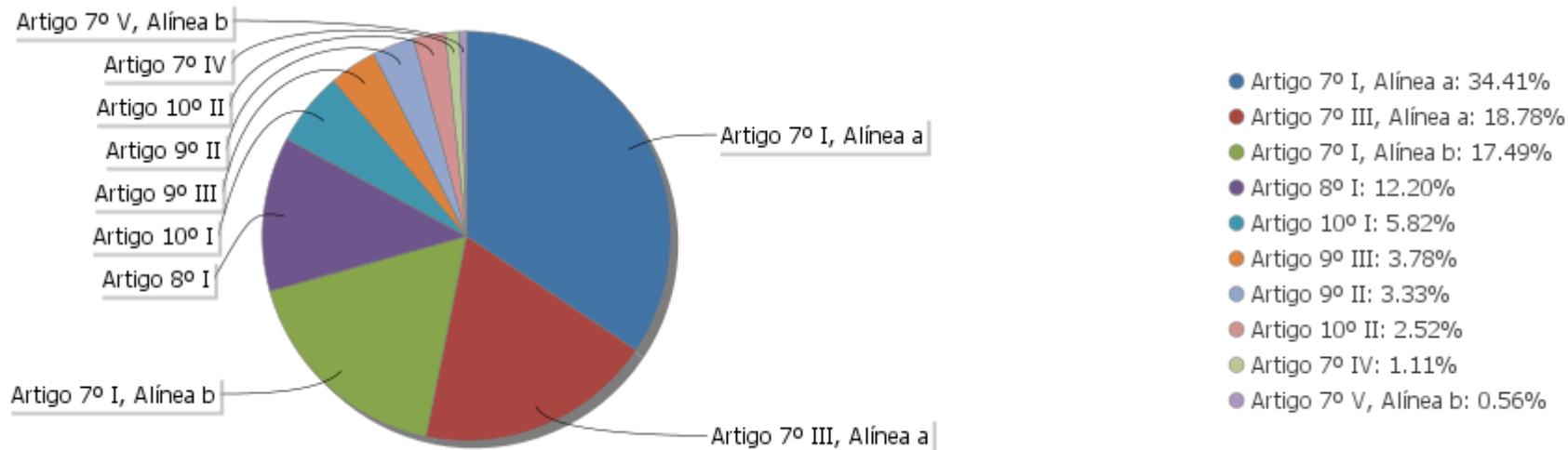
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Liquidez

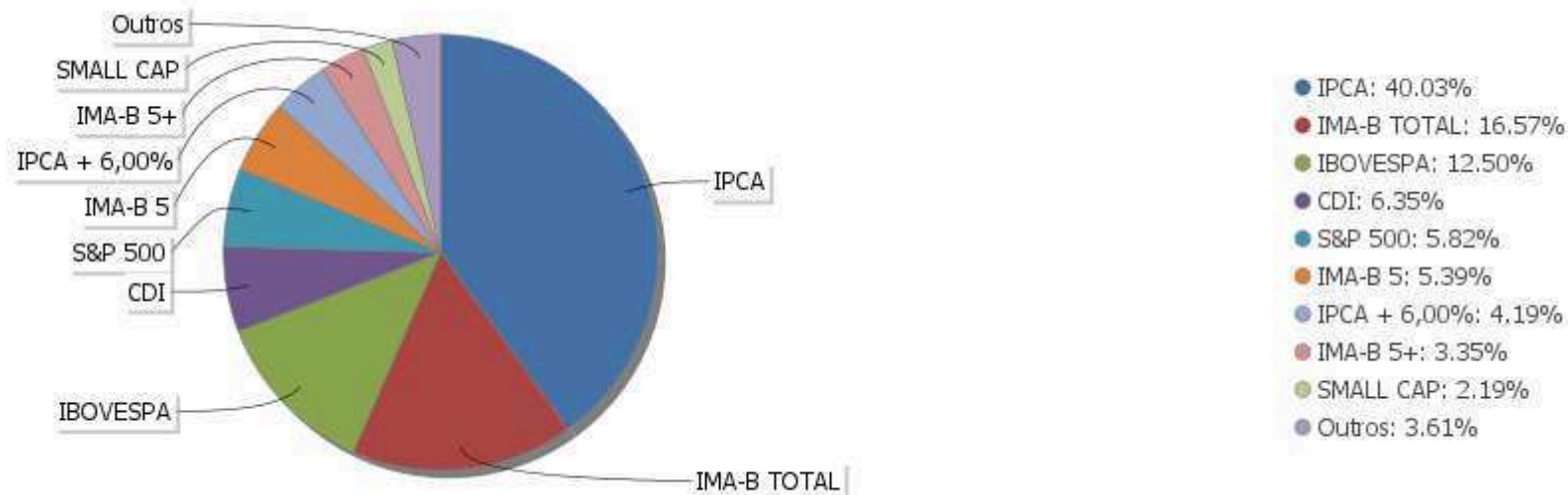
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	318.039.560,14	58,08	40,00	318.039.560,14	58,08	40,00
de 31 dias a 365 dias	38.528.706,34	7,04		356.568.266,48	65,11	40,00
acima de 365 dias	191.051.949,19	34,89		547.620.215,67	100,00	40,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

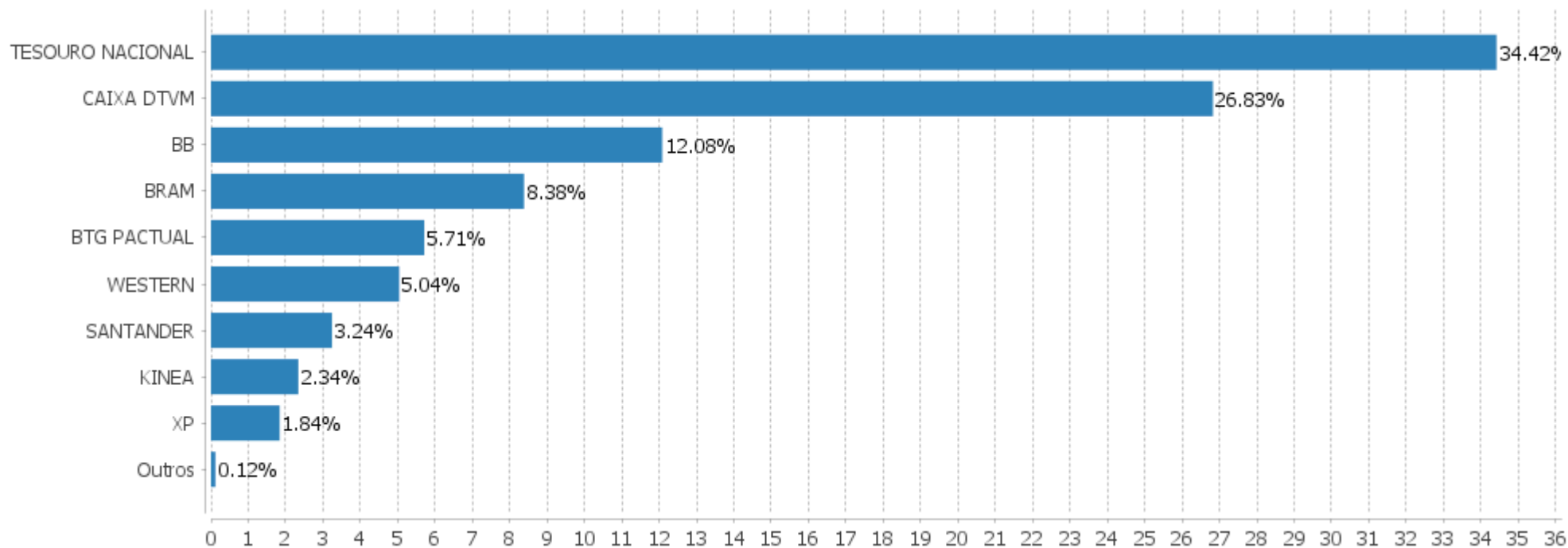


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2024	0,03	1,54	0,79										2,36
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55										2,63
p.p. indexador	-0,82	0,33	0,24										-0,26
2023	1,67	-0,32	1,15	1,15	1,97	2,35	1,30	-0,40	-0,40	-0,59	3,53	2,41	14,62
IPCA + 5,02%	0,96	1,19	1,16	0,96	0,66	0,33	0,53	0,68	0,65	0,65	0,67	0,95	9,81
p.p. indexador	0,71	-1,51	-0,01	0,19	1,31	2,02	0,77	-1,08	-1,05	-1,24	2,86	1,46	4,81
2022	-0,35	0,40	2,59	-1,93	0,83	-2,43	1,92	0,96	-0,55	2,18	-0,03	-0,51	3,01
IPCA + 4,85%	0,94	1,37	2,04	1,42	0,89	1,07	-0,29	0,07	0,10	0,97	0,79	1,04	10,90
p.p. indexador	-1,28	-0,97	0,54	-3,35	-0,05	-3,50	2,21	0,89	-0,65	1,21	-0,81	-1,55	-7,88
2021	-0,89	-0,49	1,07	1,57	1,51	0,27	-0,63	-0,67	-1,29	-0,88	1,10	1,33	1,95
IPCA + 5,41%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	0,97	1,43	1,34	1,61	1,67	1,37	1,22	15,99
p.p. indexador	-1,56	-1,73	-0,34	0,84	0,24	-0,71	-2,06	-2,01	-2,90	-2,55	-0,27	0,11	-14,04
2020	0,63	-1,53	-9,41	3,40	2,58	2,85	3,37	-0,44	-1,77	-0,52	3,92	3,93	6,38
IPCA + 5,89%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,89	0,72	1,12	1,34	1,35	1,86	10,65
p.p. indexador	-0,08	-2,19	-9,98	3,25	2,51	2,11	2,48	-1,16	-2,89	-1,86	2,57	2,07	-4,27
2019	2,75	0,44	0,65	1,23	1,25	2,60	1,03	0,30	1,91	2,01	0,09	2,58	18,15
IPCA + 6,00%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	1,92	-0,46	-0,55	0,17	0,61	2,15	0,31	-0,32	1,46	1,37	-0,89	0,93	7,56
2018	2,74	0,16	0,62	0,32	-2,83	-0,62	1,78	0,19	0,78	1,99	0,94	0,34	6,48
IPCA + 6,00%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,93	-0,58	0,04	-0,39	-3,72	-2,37	0,94	-0,25	-0,14	1,03	0,68	-0,27	-3,44

Performance Sobre a Meta Atuarial

	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	35	46,67
Meses abaixo - Meta Atuarial	40	53,33

	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-9,41	2020-03

Relatório

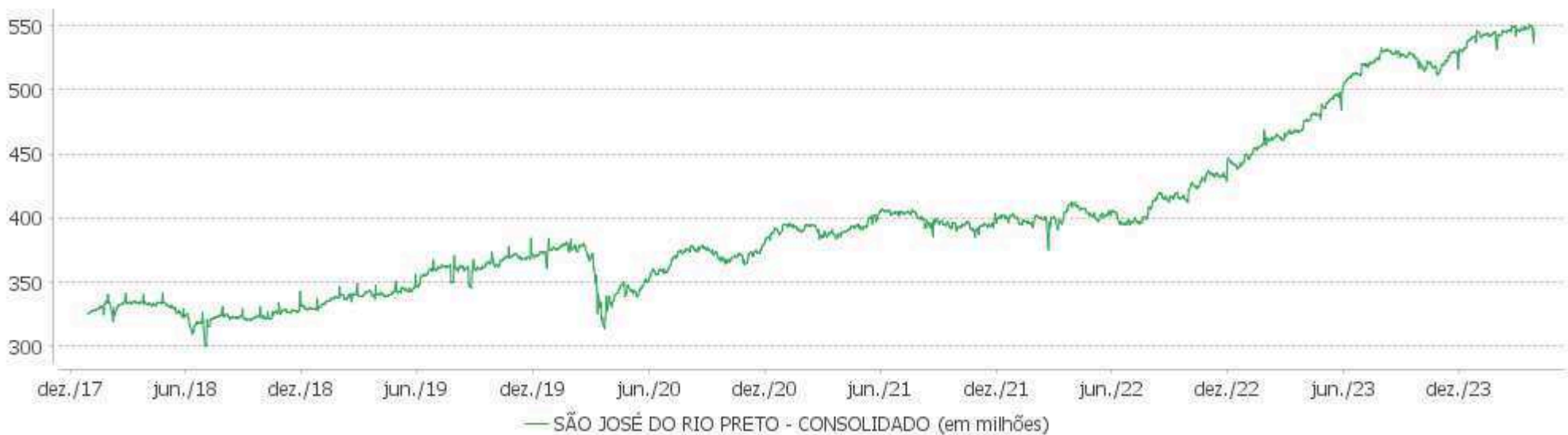
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,36	2,63	-0,26	2,57
06 meses	7,89	4,97	2,92	3,24
12 meses	14,45	9,04	5,42	3,29
24 meses	17,75	19,69	-1,94	4,37
36 meses	23,61	40,24	-16,63	4,76
48 meses	46,00	57,31	-11,31	5,64
60 meses	49,09	72,29	-23,20	7,43
Desde 29/12/2017	64,90	94,97	-30,07	6,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

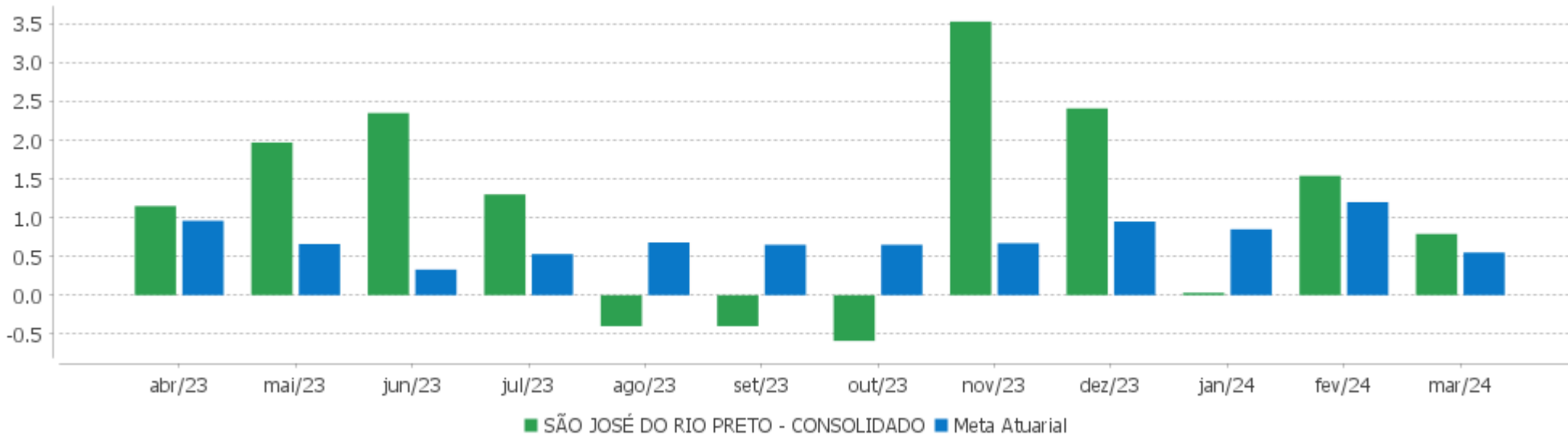


Patrimônio Líquido



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,46% a.a Var. IPCA p.p.	1,44 1,28	3,82 2,40	3,82 2,40	6,72 4,20	13,03 9,11		
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,77 0,15	2,39 -0,47	2,39 -0,47	5,11 -0,33	10,16 0,13	21,03 -1,03	31,72 -12,28
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,06 1,64	3,06 1,64	5,52 3,00	10,16 6,23	22,64 13,88	35,58 14,53
NTN-B 150545 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,66	3,07 1,66	2,64 0,13	4,20 0,28		
NTN-B 150824 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,80	2,96 1,54	2,96 1,54	5,14 2,63	9,55 5,63	21,47 12,72	37,51 16,47
NTN-B 150545 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,99 0,83	3,06 1,64	3,06 1,64	5,55 3,03	10,19 6,27	22,67 13,92	35,66 14,61
NTN-B 150850 (6,351000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,88	3,21 1,80	3,21 1,80	5,91 3,39	10,91 6,99	24,25 15,49	37,59 16,54
NTN-B 150826 (6,563000%) Var. IPCA p.p.	1,06 0,90	3,26 1,85	3,26 1,85	5,81 3,30	10,92 7,00	20,86 12,10	
NTN-B 150535 (4,875000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,77	2,86 1,45	2,86 1,45	5,07 2,56	9,27 5,35	20,71 11,95	36,46 15,41
NTN-B 150850 (5,832500%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,09 1,67	3,09 1,67	5,65 3,13	10,37 6,44	16,23 7,48	
NTN-B 150535 (4,825000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,77	2,85 1,44	2,85 1,44	5,04 2,53	9,22 5,30	20,60 11,84	36,28 15,23
NTN-B 150535 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	1,03 0,87	3,15 1,74	3,15 1,74	5,69 3,17	10,55 6,63	16,51 7,75	
NTN-B 150850 (6,352000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,88	3,21 1,80	3,21 1,80	5,91 3,40	10,91 6,99	16,92 8,16	
NTN-B 150840 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,97 0,81	2,98 1,56	2,98 1,56	5,35 2,83	9,81 5,89	21,87 13,11	38,28 17,23
NTN-B 150840 (5,045000%) Var. IPCA p.p.	0,95 0,79	2,90 1,49	2,90 1,49	5,19 2,67	9,48 5,56	21,14 12,38	37,17 16,12
NTN-B 150545 (5,854000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,68	3,10 1,68	5,63 3,12	10,37 6,44	23,06 14,30	36,14 15,09
NTN-B 150535 (5,320000%)	0,97	2,97	2,97	5,30	9,74	21,74	38,05

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IPCA p.p.	0,81	1,55	1,55	2,78	5,81	12,98	17,00
NTN-B 150850 (6,042000%) Var. IPCA p.p.	1,02 0,86	3,14 1,72	3,14 1,72	5,75 3,24	10,59 6,66	19,97 11,21	
NTN-B 150545 (6,421000%) Var. IPCA p.p.	1,05 0,89	3,23 1,81	3,23 1,81	5,92 3,41	10,96 7,03	17,01 8,25	
NTN-B 150555 (6,351000%) Var. IPCA p.p.	1,04 0,88	3,21 1,80	3,21 1,80	5,93 3,41	10,93 7,00	20,54 11,78	33,46 12,41
NTN-B 150824 (7,408000%) Var. IPCA p.p.	1,12 0,96	3,46 2,04	3,46 2,04	6,17 3,66	11,73 7,81	19,10 10,35	
NTN-B 150545 (5,895000%) Var. IPCA p.p.	1,01 0,85	3,10 1,69	3,10 1,69	5,65 3,14	10,41 6,48	19,67 10,91	32,40 11,35
NTN-B 150840 (4,873000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,77	2,86 1,45	2,86 1,45	5,10 2,59	9,30 5,38	20,74 11,98	36,57 15,52
NTN-B 150840 (4,830000%) Var. IPCA p.p.	0,93 0,77	2,85 1,44	2,85 1,44	5,08 2,56	9,26 5,33	20,64 11,88	39,94 18,90
NTN-B 150850 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	1,00 0,84	3,07 1,66	3,07 1,66	5,61 3,10	10,29 6,37	22,87 14,11	35,92 14,87
NTN-B 150535 (4,965000%) Var. IPCA p.p.	0,94 0,78	2,89 1,47	2,89 1,47	5,12 2,60	9,37 5,44	20,92 12,16	36,78 15,73
NTN-B 150826 (5,525000%) Var. IPCA p.p.	0,98 0,82	3,02 1,60	3,02 1,60	5,31 2,79	9,85 5,93	22,11 13,35	38,56 17,52
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,65 -0,12	1,56 -0,50	1,56 -0,50	4,97 -0,11	9,42 -0,21	18,38 -2,63	25,22 -6,34
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06 -0,02	0,13 -0,05	0,13 -0,05	4,84 -0,10	11,64 -0,17	19,81 -0,40	24,88 -0,74
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,75 -0,02	1,99 -0,06	1,99 -0,06	4,96 -0,13	9,37 -0,25	20,47 -0,54	30,69 -0,86
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,04 -0,12	-0,29 -0,46	-0,29 -0,46	4,86 -0,08	11,64 -0,17	17,36 -2,85	18,98 -6,64
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. IPCA p.p.	0,58 0,42	1,80 0,38	1,80 0,38	4,77 2,26	11,99 8,07	25,10 16,35	28,10 7,05
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06 -0,02	0,11 -0,07	0,11 -0,07	4,82 -0,12	11,56 -0,25	19,65 -0,56	24,65 -0,97
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p.	0,77 0,61	2,41 0,99	2,41 0,99	5,40 2,88	13,73 9,81	25,89 17,14	31,67 10,63
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,91	2,77	2,77	4,98	9,78	21,57	33,27

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. INPC + 6,00% p.p.	0,26	-0,25	-0,25	-0,31	0,30	0,47	-10,16
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,79 95,28	2,55 97,24	2,55 97,24	5,41 97,75	12,25 99,11	26,99 98,93	35,33 99,67
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,91 0,84	2,78 2,60	2,78 2,60	4,99 0,05	9,77 -2,04	20,11 -0,10	30,21 4,59
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5+ p.p.	-0,56 -0,01	-1,52 -0,01	-1,52 -0,01	4,78 -0,03	13,13 -0,25	18,45 -0,63	18,32 -1,18
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,04 -0,04	0,09 -0,08	0,09 -0,08	4,78 -0,16	11,48 -0,33	19,47 -0,74	24,23 -1,39
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,74 -0,03	1,97 -0,09	1,97 -0,09	4,93 -0,16	9,33 -0,29	20,22 -0,78	30,15 -1,41
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,10 0,02	0,20 0,02	0,20 0,02	4,97 0,03	11,90 0,09	19,88 -0,33	24,98 -0,64
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,51	2,38 90,70	2,38 90,70	5,02 90,65	11,27 91,14	24,78 90,83	31,36 88,48
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,87 104,20	2,72 103,65	2,72 103,65	5,74 103,60	12,93 104,59	27,88 102,20	36,71 103,58
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,85 101,85	2,70 102,81	2,70 102,81	5,72 103,26	12,96 104,85	27,89 102,21	36,73 103,63
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,75 90,22	2,37 90,41	2,37 90,41	5,02 90,73	11,13 90,06	23,79 87,18	30,10 84,93
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	1,36 2,07	0,85 5,38	0,85 5,38	15,38 5,47	36,06 10,32	22,66 15,91	34,78 24,94
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-1,18 -0,47	-5,46 -0,92	-5,46 -0,92	6,70 -3,20	21,69 -4,05	4,77 -1,99	5,12 -4,71
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-0,44 0,27	-3,57 0,96	-3,57 0,96	10,25 0,35	25,42 -0,32	4,21 -2,55	6,17 -3,67
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-1,58 -0,88	-7,45 -2,92	-7,45 -2,92	5,40 -4,50	19,61 -6,13	-2,02 -8,78	4,15 -5,68
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	-0,65 0,05	-4,44 0,09	-4,44 0,09	9,73 -0,17	25,09 -0,65	6,86 0,11	9,92 0,08
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-1,57 -0,86	-1,28 3,25	-1,28 3,25	11,56 1,66	27,07 1,33	23,55 16,79	30,73 20,90
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-0,11 -2,26	-5,08 -0,99	-5,08 -0,99	4,69 -2,24	9,20 -14,94	-19,36 -8,80	-18,39 0,94
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	3,48	14,98	14,98	23,77	32,44	27,69	18,24

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. Global BDRX p.p.	-0,57	-0,90	-0,90	-1,11	-2,21	-2,86	-5,60
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	2,16 2,87	13,65 18,19	13,65 18,19	22,00 12,10	28,41 2,67	21,95 15,20	14,57 4,74
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	1,57 2,27	16,41 20,94	16,41 20,94	30,45 20,55	37,79 12,05	28,06 21,31	13,84 4,00
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	4,75 1,60	10,39 -0,79	10,39 -0,79	16,65 -2,31	9,69 -9,40	9,80 -6,26	-1,37 -3,37
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	3,66 0,52	13,55 2,37	13,55 2,37	22,89 3,92	25,66 6,58	28,77 12,70	21,74 19,73
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI Var. MSCI ACWI p.p.	3,35 0,20	10,46 -0,72	10,46 -0,72	23,57 4,61	30,44 11,35	28,35 12,29	45,62 43,61
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,16 1,54	15,24 12,38	15,24 12,38	29,37 23,92	37,99 27,96	27,89 5,83	-12,39 -56,39
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	3,39 0,03	11,13 -2,55	11,13 -2,55	25,56 3,31	36,04 10,29	34,42 12,11	62,08 46,10
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	3,44 0,07	11,26 -2,43	11,26 -2,43	25,85 3,60	36,73 10,98	41,02 18,71	71,15 55,17
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,11 -0,52	2,98 0,12	2,98 0,12	4,06 -1,39	5,24 -4,79	-4,93 -26,99	15,54 -28,46
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C Var. IPCA + 7,00% p.p.	4,55 3,85	2,22 -0,87	2,22 -0,87	3,43 -2,50			
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 8,00% p.p.	-2,38 -3,16	-6,87 -10,19	-6,87 -10,19	-13,67 -20,08			
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	8,45 7,83	7,01 4,15	7,01 4,15	5,00 -0,44	12,13 2,09		
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,02% p.p.	0,79 0,24	2,36 -0,26	2,36 -0,26	7,89 2,92	14,45 5,42	17,75 -2,09	23,61 -16,46
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Cotização e Taxas

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,00
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,60
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,30
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		2,00
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,08
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	D+0	D+0	D+3 du	D+3 du		0,30
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	D+0	D+0	D+30	D+30		0,20
BB PREV RF FLUXO FIC	D+0	D+0	D+0	D+0		1,00
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		1,50
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA						
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+0	D+0	D+0	D+2 du		0,20
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+0	D+0	D+0	D+1 du		1,20
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	D+0	D+0	D+0	D+0		0,40
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	D+1 du	D+0	D+21 du	D+23 du		1,72
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	D+1 du	D+0	D+13 du	D+15 du		2,00
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Não se aplica	Não se aplica				
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA						
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	D+1 du	D+0	D+1 du	D+5 du		0,80
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C						
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	D+0	D+1	D+1	D+6		1,00
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,10
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,50
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	D+0	D+0	D+0	D+1 du		0,40
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		3,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Renda Fixa

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IRF-M 1	0,84	2,46	2,46	5,42	12,28	27,08	33,61	36,96	46,08
IRF-M 1+	0,43	1,37	1,37	6,49	15,26	28,03	28,76	31,09	48,08
IRF-M TOTAL	0,54	1,68	1,68	6,13	14,03	27,20	29,99	32,91	47,66
IMA-B 5	0,77	2,06	2,06	5,09	9,62	21,01	31,56	42,74	56,07
IMA-B 5+	-0,55	-1,51	-1,51	4,82	13,38	19,08	19,49	33,85	44,87
IMA-B TOTAL	0,08	0,18	0,18	4,94	11,81	20,21	25,62	38,67	51,35
IMA-GERAL TOTAL	0,52	1,64	1,64	5,51	12,59	24,78	30,91	37,43	49,07
IDKA 2	0,99	2,24	2,24	5,19	9,48	20,66	31,64	42,92	55,95
IDKA 20	-1,51	-4,59	-4,59	5,22	18,67	18,54	9,63	26,29	33,79
CDI	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-0,71	-4,53	-4,53	9,90	25,74	6,76	9,84	75,44	34,26
IBRX 100	-0,73	-4,29	-4,29	10,02	25,18	5,09	8,02	75,18	36,28
IBRX 50	-0,81	-4,06	-4,06	9,78	24,88	5,45	9,81	80,89	34,52
SMALL CAP	2,15	-4,09	-4,09	6,93	24,13	-10,57	-19,33	32,77	16,87
Índice Consumo - ICON	1,26	-7,10	-7,10	4,34	13,75	-29,62	-42,70	-13,51	-19,55
Índice Dividendos - IDIV	-1,20	-3,81	-3,81	10,25	27,20	19,02	32,90	85,19	70,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
S&P 500	3,37	13,68	13,68	22,26	25,75	22,31	15,98	95,38	137,68

Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	1,43	2,92	2,92	5,87	23,44	22,60	19,72	36,65	37,26

Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	3,14	11,17	11,17	18,97	19,08	16,07	2,01	70,15	97,45

Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,16	1,42	1,42	2,51	3,93	8,76	21,05	28,43	32,67
INPC	0,19	1,58	1,58	2,36	3,40	7,91	20,56	28,93	33,20
IGPM	-0,47	-0,91	-0,91	0,91	-4,26	-4,10	10,07	44,30	54,12
SELIC	0,83	2,62	2,62	5,54	12,36	27,28	35,44	38,46	46,00

Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,47	2,38	2,38	4,48	8,00	17,54	36,06	50,08	61,29
IPCA + 5,00%	0,55	2,62	2,62	4,96	9,02	19,79	39,99	55,90	69,16
IPCA + 5,50%	0,59	2,74	2,74	5,21	9,53	20,92	41,99	58,87	73,21
IPCA + 5,89%	0,62	2,83	2,83	5,39	9,92	21,81	43,56	61,21	76,43
IPCA + 6,00%	0,62	2,86	2,86	5,45	10,03	22,06	44,00	61,88	77,34
INPC + 4,00%	0,50	2,55	2,55	4,32	7,45	16,62	35,51	50,66	61,93
INPC + 6,00%	0,65	3,02	3,02	5,29	9,47	21,10	43,43	62,51	78,04

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150535 (4,825000%)	5.730.677,57	4,825000	5.293.207,31	5,847100	-437.470,26
NTN-B 150535 (4,875000%)	5.784.228,83	4,875000	5.363.724,64	5,847100	-420.504,19
NTN-B 150535 (4,965000%)	5.691.575,93	4,965000	5.315.243,97	5,847100	-376.331,96
NTN-B 150535 (5,320000%)	5.696.639,52	5,320000	5.469.500,64	5,847100	-227.138,88
NTN-B 150535 (6,100000%)	5.468.573,96	6,100000	5.575.276,64	5,847100	106.702,68
NTN-B 150545 (5,690000%)	5.680.075,46	5,690000	5.550.530,97	5,891100	-129.544,49
NTN-B 150545 (5,750000%)	2.234.844,55	5,750000	2.199.017,04	5,891100	-35.827,51
NTN-B 150545 (5,854000%)	5.560.797,69	5,854000	5.537.283,88	5,891100	-23.513,81
NTN-B 150545 (5,895000%)	21.561.083,16	5,895000	21.570.679,23	5,891100	9.596,07
NTN-B 150545 (6,421000%)	5.433.285,14	6,421000	5.766.900,12	5,891100	333.614,98
NTN-B 150555 (6,351000%)	10.808.858,77	6,351000	11.515.443,33	5,874700	706.584,56
NTN-B 150824 (5,270000%)	6.940.073,81	5,270000	6.877.012,80	7,796100	-63.061,01
NTN-B 150824 (7,408000%)	10.319.207,23	7,408000	10.304.886,83	7,796100	-14.320,40
NTN-B 150826 (5,525000%)	11.326.414,59	5,525000	11.289.187,53	5,680000	-37.227,06
NTN-B 150826 (6,563000%)	10.577.077,81	6,563000	10.776.238,57	5,680000	199.160,76
NTN-B 150840 (4,830000%)	11.699.322,79	4,830000	10.529.520,00	5,857500	-1.169.802,79
NTN-B 150840 (4,873000%)	11.637.252,40	4,873000	10.520.807,11	5,857500	-1.116.445,29
NTN-B 150840 (5,045000%)	5.713.056,71	5,045000	5.258.225,34	5,857500	-454.831,37
NTN-B 150840 (5,360000%)	5.713.805,35	5,360000	5.432.483,01	5,857500	-281.322,34
NTN-B 150840 (5,690000%)	1.475.405,35	5,690000	1.450.695,14	5,857500	-24.710,21
NTN-B 150850 (5,760000%)	1.122.005,69	5,760000	1.104.182,82	5,883900	-17.822,87
NTN-B 150850 (5,832500%)	5.834.406,59	5,832500	5.795.868,72	5,883900	-38.537,87
NTN-B 150850 (6,042000%)	10.662.377,47	6,042000	10.880.346,93	5,883900	217.969,46
NTN-B 150850 (6,351000%)	10.485.688,04	6,351000	11.124.751,03	5,883900	639.062,99
NTN-B 150850 (6,352000%)	5.301.834,22	6,352000	5.625.658,72	5,883900	323.824,50

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
1	03/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.430.322,50	286.164,31439700	4,9982560000
2	03/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	76.207,45	31.754,70540600	2,3998790000
3	03/01/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	61.310,42	0,00	13.686,48585400	4,4796320000
4	05/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.751,34	1.561,89461200	2,4017880000
5	08/01/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	511.807,39	0,00	107.823,78796800	4,7467020000
6	08/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	20.058,69	8.348,23941500	2,4027450000
7	09/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	315,25	131,15208100	2,4036980000
8	10/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	12.267,67	5.101,64517900	2,4046500000
9	11/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	54.840,00	22.796,76913200	2,4056040000
10	12/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	5.418,47	2.251,54160600	2,4065600000
11	15/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.794,51	745,37821900	2,4075160000
12	16/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	700,20	290,72337100	2,4084750000
13	19/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	37.050,41	0,00	13.550,48541800	2,7342496490
14	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	207.736,51	0,00	38.472,08939500	5,3996680000
15	19/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	10.565,01	4.381,38540600	2,4113400000
16	22/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	47.685,90	0,00	9.484,35781700	5,0278470000
17	22/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	16,28	6,74874700	2,4122980000
18	24/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.865,90	0,00	2.142,77607800	2,7375235600
19	25/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	244.385,65	101.187,38588400	2,4151790000
20	29/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	19.595,46	0,00	7.149,68865800	2,7407431200
21	29/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	13.694.923,79	2.717.644,18688400	5,0392630000
22	29/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	172.208,08	71.245,88814500	2,4170950000
23	30/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	29.577,61	0,00	10.787,62850500	2,7418083580
24	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.745.870,68	0,00	1.338.052,24573300	5,0415600000
25	30/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	81.327,95	33.633,63666100	2,4180540000
26	31/01/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	35.362,07	0,00	12.892,25035600	2,7428935230
27	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.156.713,20	0,00	824.110,90201200	5,0438760000
28	31/01/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	963.763,37	0,00	398.411,32510000	2,4190160000

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
29	01/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	12.343,86	5.100,82097300	2,4199750000
30	01/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.443.448,65	286.047,45259700	5,0461860000
31	02/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	198.370,54	81.941,06233200	2,4208930000
32	02/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.589,80	0,00	1.307,74096700	2,7450390320
33	02/02/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	194.544,11	0,00	43.649,69381400	4,4569410000
34	05/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.466,91	1.431,53278300	2,4218120000
35	06/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	24.755,42	0,00	9.011,45506500	2,7471057470
36	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	29.438,18	5.823,74944100	5,0548500000
37	07/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.989,13	1.233,31648800	2,4236520000
38	07/02/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	544.484,42	0,00	114.500,63676300	4,7552960000
39	08/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	331,60	0,00	136,76646300	2,4245710000
40	09/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	28.407,18	11.711,91993300	2,4254930000
41	14/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	12.757,00	5.257,55937700	2,4264110000
42	15/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	269,50	111,02727800	2,4273310000
43	15/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	71.528,24	0,00	25.987,84942900	2,7523724190
44	15/02/2024	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	16.908,46	5.558,87635600	3,0417046390
45	15/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.100.779,97	0,00	612.402,85142000	5,0633010000
46	16/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	38.447,42	15.833,37974200	2,4282510000
47	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	130,11	53,56142800	2,4291730000
48	19/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	105.979,49	0,00	20.913,14392800	5,0676020000
49	20/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.168,79	480,96452600	2,4300960000
50	20/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	228.238,24	82.829,87447600	2,7555062600
51	20/02/2024	RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,00	1.131.081,06	998.266,41055140	1,1330453000
52	20/02/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	193.333,41	0,00	35.506,62112500	5,4449960000
53	21/02/2024	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	228.238,24	0,00	88.091,07204900	2,5909349800
54	22/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.134.061,88	0,00	223.488,38850000	5,0743660000
55	23/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	161.769,25	66.493,36608600	2,4328630000
56	23/02/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.724,19	0,00	625,01234900	2,7586494930
57	27/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	182.012,76	35.822,30229600	5,0809900000
58	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	189.330,79	77.733,70994900	2,4356330000

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
59	28/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	7.076.016,55	1.392.023,61030900	5,0832590000
60	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	551.402,30	0,00	226.303,87879200	2,4365570000
61	29/02/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.045.104,34	0,00	795.423,26634600	5,0854740000
62	01/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.458.107,68	286.590,44080400	5,0877750000
63	01/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	16.474,20	6.758,69047100	2,4374840000
64	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	237.331,59	0,00	53.051,25727900	4,4736280000
65	04/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	239.424,04	98.188,71208500	2,4384070000
66	05/03/2024	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	39.174,84	0,00	39,17484000	1.000,0000000000
67	05/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	37.614,85	7.386,80310000	5,0921690000
68	06/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	44,33	18,16609200	2,4402600000
69	07/03/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	532.208,61	0,00	111.361,14513000	4,7791230000
70	11/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	18.661,35	7.638,59912000	2,4430330000
71	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	60.665,11	0,00	11.886,71500100	5,1036060000
72	12/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	1.280,00	523,74060300	2,4439580000
73	13/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	3.104,26	1.269,69669900	2,4448830000
74	14/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	15.421,03	6.305,08340300	2,4458090000
75	15/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	15.933,39	6.512,09758500	2,4467370000
76	19/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	199.541,19	0,00	71.865,74980000	2,7765825940
77	20/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	10.780,01	0,00	3.881,00453100	2,7776339640
78	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	230.822,91	0,00	42.027,14414500	5,4922340000
79	20/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	2.106,78	860,07908600	2,4495190000
80	21/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	22.948,98	0,00	8.258,90017500	2,7786968620
81	21/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	42.499,50	8.302,37478200	5,1189570000
82	22/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	84.234,92	0,00	30.303,31816600	2,7797259540
83	25/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	204.954,29	83.579,11466900	2,4522190000
84	26/03/2024	BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	0,00	2.116.716,16	227.907,20078600	9,2876230000
85	26/03/2024	BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	0,00	4.551.396,72	2.118.408,20356400	2,1484984400
86	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.640.000,00	1.294.923,76309400	5,1277150000
87	27/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	182.925,19	74.541,91553200	2,4539910000
88	28/03/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.551.396,72	0,00	1.635.020,54002700	2,7836939100

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
89	28/03/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.338.995,77	0,00	1.040.813,15858600	5,1296390000
90	28/03/2024	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	126.256,75	51.430,92438400	2,4548800000
Total			34.330.296,98	42.238.617,74		

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

Horizonte: 21 dias / Nível de Confiança: 95,0%

Value-At-Risk (R\$): 7.315.302,17

Value-At-Risk: 1,34%

	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	Limite ⁽⁵⁾	CVaR ⁽³⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	1,03	0,45	5,00	0,22	-0,17	0,66	396.242.968,49	72,36
Artigo 8º	11,44	6,49	15,00	0,69	-0,12	-0,59	66.790.921,80	12,20
Artigo 9º	11,64	5,49	15,00	0,19	0,16	2,67	38.959.398,58	7,11
Artigo 10º	7,80	3,54	15,00	0,24	0,24	2,68	45.626.926,80	8,33
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	2,57	1,34		1,34	-0,10	2,36	547.620.215,67	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,45%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150535 (4,825000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,37	0,93	5.730.677,57	1,05
NTN-B 150535 (4,875000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,39	0,93	5.784.228,83	1,06
NTN-B 150535 (4,965000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,41	0,94	5.691.575,93	1,04
NTN-B 150535 (5,320000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,52	0,97	5.696.639,52	1,04
NTN-B 150535 (6,100000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,75	1,03	5.468.573,96	1,00
NTN-B 150545 (5,690000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,63	0,99	5.680.075,46	1,04
NTN-B 150545 (5,750000%)	0,26	0,28	-0,00	0,29	0,65	1,00	2.234.844,55	0,41
NTN-B 150545 (5,854000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,68	1,01	5.560.797,69	1,02
NTN-B 150545 (5,895000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,69	1,01	21.561.083,16	3,94
NTN-B 150545 (6,421000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,85	1,05	5.433.285,14	0,99
NTN-B 150555 (6,351000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,83	1,04	10.808.858,77	1,97
NTN-B 150824 (5,270000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	0,51	0,96	6.940.073,81	1,27
NTN-B 150824 (7,408000%)	0,26	0,08	-0,00	0,11	1,14	1,12	10.319.207,23	1,88
NTN-B 150826 (5,525000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,58	0,98	11.326.414,59	2,07
NTN-B 150826 (6,563000%)	0,26	0,16	-0,00	0,17	0,89	1,06	10.577.077,81	1,93
NTN-B 150840 (4,830000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,37	0,93	11.699.322,79	2,14

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO. Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (4,873000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,39	0,93	11.637.252,40	2,13
NTN-B 150840 (5,045000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,44	0,95	5.713.056,71	1,04
NTN-B 150840 (5,360000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,53	0,97	5.713.805,35	1,04
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,63	0,99	1.475.405,35	0,27
NTN-B 150850 (5,760000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,65	1,00	1.122.005,69	0,20
NTN-B 150850 (5,832500%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,67	1,01	5.834.406,59	1,07
NTN-B 150850 (6,042000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,74	1,02	10.662.377,47	1,95
NTN-B 150850 (6,351000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,83	1,04	10.485.688,04	1,91
NTN-B 150850 (6,352000%)	0,26	0,15	-0,00	0,17	0,83	1,04	5.301.834,22	0,97
Sub-total	0,26	0,14	-0,00		0,65	1,00	188.458.568,63	34,41

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,17	0,08	0,00	0,13	-0,40	0,77	13.795.540,61	2,52
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,15	0,05	0,00	0,04	-0,26	0,79	5.207.958,27	0,95
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,42	0,33	-0,00	1,29	0,19	0,91	1.004.763,48	0,18
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,42	0,33	-0,00	0,35	0,18	0,91	579.849,22	0,11
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,29	1,22	0,02	0,01	-0,34	0,06	15.788.346,37	2,88
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,28	1,22	0,01	0,01	-0,34	0,06	3.602.570,54	0,66
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	2,85	1,63	0,01	0,46	-0,31	-0,04	5.579.006,40	1,02
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,93	0,54	0,01	0,00	-0,09	0,75	9.951.169,61	1,82
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,53	2,22	0,05	0,03	-0,39	-0,56	18.359.534,14	3,35
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	1,59	0,87	0,01	0,38	-0,12	0,65	11.021.937,47	2,01
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,17	0,40	0,00	0,41	-0,22	0,58	10.884.617,63	1,99
Sub-total	1,69	0,95	0,11		-0,32	0,29	95.775.293,74	17,49

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,03	0,02	0,00	0,01	1,21	0,87	23.361.858,96	4,27
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	2,28	1,23	0,04	0,09	-0,35	0,04	25.383.309,06	4,64

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	2,31	1,26	0,06	0,07	-0,32	0,10	39.402.522,56	7,20
BB PREV RF FLUXO FIC	0,02	0,01	0,00	0,01	-3,99	0,75	4.871.337,75	0,89
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,01	0,01	0,00	0,00	-6,51	0,75	119.605,74	0,02
BRANCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,93	0,54	0,01	0,01	-0,10	0,74	8.516.605,18	1,56
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,11	0,05	0,00	0,04	0,14	0,85	1.189.721,90	0,22
Sub-total	1,57	0,83	0,11		-0,31	0,34	102.844.961,15	18,78

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,46% a.a	5,09	0,25	0,00	0,27	0,12	1,44	6.075.578,11	1,11
Sub-total	5,09	0,25	0,00		0,12	1,44	6.075.578,11	1,11

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	1,59	0,52	0,00	0,53	-0,04	0,77	3.088.566,86	0,56
Sub-total	1,59	0,52	0,00		-0,04	0,77	3.088.566,86	0,56

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,49%

Artigo 8º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	11,17	6,22	0,02	1,36	-0,22	-1,58	2.246.425,70	0,41
BRANCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	16,46	8,63	0,16	2,70	-0,06	-0,11	12.015.388,88	2,19
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	10,98	6,17	0,19	1,24	-0,12	-0,44	19.684.812,60	3,59
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	9,10	7,21	0,03	3,45	-0,26	-1,57	3.072.301,80	0,56
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	10,92	5,45	0,04	1,33	-0,14	-0,65	4.794.628,00	0,88
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	11,70	6,37	0,20	1,44	-0,17	-1,18	19.663.133,13	3,59
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	11,54	6,88	0,06	3,25	0,05	1,36	5.314.231,69	0,97
Sub-total	11,44	6,49	0,69		-0,12	-0,59	66.790.921,80	12,20

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, JAIR MORETTI, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e WILCLEM DE LAZARI ARAUJO
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/985E-8AF2-42AF-36C3> e informe o código 985E-8AF2-42AF-36C3

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,54%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	9,64	5,05	0,18	4,20	0,27	3,44	24.919.244,72	4,55
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9,64	5,09	0,05	4,20	0,27	3,39	6.930.598,59	1,27
Sub-total	9,64	5,06	0,24		0,27	3,43	31.849.843,31	5,82

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	27,54	0,12	-0,00	0,16	0,13	4,55	651.921,75	0,12
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	8,56	0,57	-0,00	0,58	-0,38	-2,38	291.396,42	0,05
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	28,80	0,26	0,00	0,28	0,26	8,45	1.254.418,48	0,23
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,37	0,20	0,00	0,21	-1,95	0,11	11.579.346,84	2,11
Sub-total	3,55	0,16	0,00		0,03	0,95	13.777.083,49	2,52

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,49%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	12,13	5,88	0,00	5,71	0,32	4,75	2.657.731,25	0,49
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,69	6,02	0,00	5,67	0,21	3,66	803.894,37	0,15
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,55	10,03	0,04	10,02	0,07	2,16	7.000.665,56	1,28
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS MULT IE FI	9,58	4,70	0,05	4,15	0,26	3,35	7.775.181,01	1,42
Sub-total	10,82	6,01	0,09		0,21	3,10	18.237.472,19	3,33

Artigo 9º III

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade ⁽¹⁾	VaR ⁽²⁾	CVaR ⁽³⁾	BVaR ⁽⁴⁾	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	12,38	5,51	0,03	0,56	0,21	3,48	7.029.275,51	1,28
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	12,61	6,40	0,06	8,48	0,06	1,57	11.007.861,45	2,01
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	12,20	5,55	0,01	7,44	0,11	2,16	2.684.789,43	0,49
Sub-total	12,36	5,89	0,10		0,12	2,28	20.721.926,39	3,78

(1) Volatilidade anualizada do ativo no período (%)

(2) VaR (Value-at-Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(3) Component VaR: contribuição no risco da carteira (%)

(4) BVaR (Benchmark-Value at Risk): 21 dias com 95% de confiança (%)

(5) Limite Política de Investimentos (%)



VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: 985E-8AF2-42AF-36C3

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

- ✓ PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI (CPF 326.XXX.XXX-02) em 17/06/2024 08:56:14 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: AC VALID RFB v5 << AC Secretaria da Receita Federal do Brasil v4 << Autoridade Certificadora Raiz Brasileira v5 (Assinatura ICP-Brasil)
- ✓ FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES (CPF 169.XXX.XXX-39) em 17/06/2024 09:02:58 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ JAIR MORETTI (CPF 275.XXX.XXX-04) em 17/06/2024 09:20:14 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: AC VALID RFB v5 << AC Secretaria da Receita Federal do Brasil v4 << Autoridade Certificadora Raiz Brasileira v5 (Assinatura ICP-Brasil)
- ✓ ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO (CPF 327.XXX.XXX-48) em 17/06/2024 09:22:23 (GMT-03:00)
Papel: Parte
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
- ✓ WILCLEM DE LAZARI ARAUJO (CPF 352.XXX.XXX-01) em 17/06/2024 09:49:14 (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/985E-8AF2-42AF-36C3>