

# INVESTIMENTOS

## TRANSPARÊNCIA EM NÚMEROS: RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS – 2º TRI/2024 – 1º SEM/2024

### Resumo

Explore o desempenho dos investimentos da RIOPRETOPREV no segundo trimestre de 2024 – 1º semestre de 2024, destacando as estratégias de investimento, a gestão de riscos e o compromisso contínuo com a responsabilidade previdenciária

Versão 1.0, de 30/06/2024 – Aprovada pelo Comitê de Investimentos em 26/08/2024, pelo Conselho Municipal de Previdência em 05/09/2024 e pelo Conselho Fiscal em 26/09/2024

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

Versão 1.0 – agosto 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) .....	12
CENÁRIO ECONÔMICO E O DESEMPENHO DOS INVESTIMENTOS.....	14
DA AVALIAÇÃO ANÁLITICA DOS INVESTIMENTOS DA RIOPRETOPREV NO PRIMEIRO TRIMESTRE DO ANO DE 2024.....	15
DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS E O ATENDIMENTO ÀS DIRETRIZES ESTABELECIDAS NA RESOLUÇÃO 4.963/2021 .....	15
DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS E O ATENDIMENTO ÀS DIRETRIZES ESTABELECIDAS NA POLÍTICA DE INVESTIMENTOS .....	16
Renda Fixa: .....	16
Renda Variável: .....	16
Investimentos no Exterior:.....	16
Investimentos Estruturados: .....	16
DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS ENTRE INSTITUIÇÕES E <i>BENCHMARKS</i> .....	16
DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DA CARTEIRA E COMENTÁRIOS SOBRE A PERFORMANCE DOS FUNDOS E RESPECTIVOS SEGMENTOS .....	18
RENDA FIXA: .....	18
RENDA VARIÁVEL: .....	18
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR: .....	19
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS: .....	19
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA .....	20
PRINCIPAIS INDICADORES DOS INVESTIMENTOS DA RIOPRETOPREV NO ANO .....	20
RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL no 1º TRIMESTRE:.....	20
RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL ANUAL: .....	21
PERFORMANCE NOS ÚLTIMOS PERÍODOS: .....	21
DO ANEXO I – DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS DOS INVESTIMENTOS DETALHADAS .....	22

## APRESENTAÇÃO

Com entusiasmo, apresentamos o **"TRANSPARÊNCIA EM NÚMEROS: RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS – 2º TRI/2024 – 1º SEM/2024"** da RIOPRETOPREV, uma análise minuciosa do desempenho dos investimentos ao longo do segundo trimestre do ano de 2024 – 1º semestre do ano de 2024. Este documento gerencial não apenas presta contas de maneira transparente aos colegiados, 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 segundo trimestre de 2024, fechamento do primeiro semestre, 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. O Comitê de Investimentos tem se empenhado na otimização dos diversos segmentos da carteira, seguindo princípios de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação à natureza de suas obrigações e transparência.

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 segundo 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 2º 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 nacional<sup>1</sup>.

### MERCADOS INTERNACIONAIS

Ao longo do trimestre, foi observado uma redução dos juros futuros, em virtude da acomodação dos dados de inflação e atividade nos EUA observada no fim do período. No entanto, mesmo com certo alívio das curvas de juros, a continuidade das discussões sobre o início do ciclo de redução dos juros americanos foi tema de debate no mercado. Além disso, no fim do período uma série de eventos políticos impactou o mercado.

No trimestre, a economia dos EUA apresentou crescimento robusto inicialmente, seguido por uma moderação na atividade econômica e sinais de arrefecimento no mercado de trabalho. A inflação, apesar de inicial desaceleração, permaneceu elevada em maio, mas mostrou avanços favoráveis em junho. Esses fatores aumentam a probabilidade de cortes nas taxas de juros no segundo semestre.

No segundo trimestre, na Zona do Euro, a situação econômica foi marcada pela inflação de serviços mais resistente e a melhora da atividade. Esta combinação acarretou na redução das expectativas em relação ao ciclo de corte de juros por parte do Banco Central Europeu (BCE). Apesar disso, em acordo com o previsto pelo BCE, houve o corte de juros em junho.

Na China, no segundo trimestre ainda persiste um cenário de cautela. Onde, apesar das ações de estímulo do governo, o setor imobiliário permanece em crise. Assim, a contínua deterioração do setor coloca limites na recuperação da segunda maior economia do mundo.

Com relação aos eventos políticos mencionados. Na França, a decisão inesperada de convocar novas eleições parlamentares gerou aversão ao risco na Europa. Movimentos populistas de esquerda e direita devem dominar a nova assembleia, dificultando a redução do déficit fiscal e aumentando o risco de deterioração das relações entre a França e a União Europeia.

Já, nos EUA, o desempenho do presidente no primeiro debate eleitoral gerou discussões sobre sua substituição na corrida presidencial. Sem um substituto claro e com a resistência à renúncia, a perspectiva de conflito interno entre os democratas aumenta a chance de vitória do Trump.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos no período. Onde, no 2º trimestre de 2024 o MSCI ACWI e o S&P 500 respectivamente renderam +2,41% e +3,92%. Assim, no acumulado dos últimos 12 meses

<sup>1</sup> Texto extraído e adaptado do Relatório Macroeconômico do 2º trimestre de 2024 da LDB Consultoria – 16.07.2024.

obtiveram retorno de +17,45% e +22,70%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, devido a valorização do Dólar frente ao Real, o MSCI ACWI e o S&P 500 apresentaram rendimentos positivos, respectivamente, de +13,94% e +15,63% no 2º trimestre de 2024, enquanto, no acumulado dos últimos 12 meses apresentaram retornos positivos de +35,48% e +41,53%.

**O Comitê de Investimentos da RIOPRETOPREV**, em uma análise resumida, conclui que para o cenário internacional do segundo 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 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, mesmo com a redução dos juros americanos, ao longo do trimestre as curvas de juros apresentaram alta devido pelo o aumento da incerteza no cenário econômico e pelas inseguranças em relação à condução da política fiscal.

Na parte fiscal, o governo enviou o projeto da Lei de Diretrizes Orçamentárias com um resultado primário inferior ao sinalizado anteriormente, mesmo assim, ainda é uma meta desafiadora que exige uma elevação significativa das receitas. A mudança da meta de superávit primário para 2025, junto com análises sobre a insustentabilidade do atual arcabouço fiscal face à rigidez do orçamento, contribuiu para a elevação da curva de juros.

No fim do período, a resistência do governo em implementar reformas para cortar gastos gera dúvidas sobre a viabilidade da meta de resultado primário e do arcabouço fiscal, aumentando as preocupações, levando à depreciação do Real e dificultando a política monetária.

A economia local está mais forte do que previsto, com o PIB em crescimento, um mercado de trabalho aquecido e uma taxa de desemprego historicamente baixa. Esse desempenho dificulta a tarefa de desinflacionar a economia e pode afetar desfavoravelmente a inflação projetada.

Além disso, a inflação recente mostra sinais de desaceleração gradual e não homogênea, com o núcleo de serviços acima do desejado pelo Copom. Dessa forma, as leituras trazem sinais benignos, mas as projeções de alta na inflação continuam preocupantes. Por fim, a atividade econômica mantém uma trajetória sólida, sem sinais claros que justifiquem a queda de juros.

No segundo trimestre, houve o interrompimento do movimento de redução dos juros básicos no atual patamar de 10,50%. Além disso, ao longo do trimestre, foi sendo reforçada a preocupação em relação à crescente desancoragem das expectativas de inflação. Assim, a movimentação da taxa de juros foi condicionada a uma melhora do cenário local.

Na renda variável, os índices Ibovespa e SMLL seguiram na contramão do movimento observado nos índices internacionais, fechando o trimestre em território negativo. Respectivamente, apresentando um retorno de -3,28% e -11,23% no 2º trimestre de 2024, e de +4,93% e -11,96% no acumulado dos últimos 12 meses.

Em sua análise, o **Comitê de Investimentos** conclui que, a bolsa brasileira teve um desempenho muito ruim durante todo o primeiro semestre de 2024, registrando apenas 2 meses de rentabilidade positiva. O trimestre foi marcado principalmente pelo crescente antagonismo entre o Presidente da República e do Banco Central e as dificuldades para definir um plano de cortes nos gastos públicos. Com a manutenção da taxa Selic, sinalizada por um período maior que o esperado, as expectativas macroeconômicas têm sido alteradas e os ativos de mais longo prazo, marcados a mercado, sofrido desvalorização.

## PRINCIPAIS INDICADORES ECONÔMICOS

No contexto do segundo 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 em 2024						Acumulado Trimestre	Acumulado Semestre	Acumulado 12 meses
	1º Trimestre			2º Trimestre					
	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Maió	Junho			
<b>Renda Fixa</b>									
IMA-5	0.99%	0.82%	0.86%	0.90%	0.83%	0.81%	2.56%	5.32%	11.85%
CDI	0.97%	0.80%	0.83%	0.89%	0.83%	0.79%	2.53%	5.22%	11.69%
IRF-M 1	0.83%	0.76%	0.84%	0.58%	0.78%	0.63%	2.00%	4.51%	10.95%
IDKa IPCA 2A	0.81%	0.42%	0.99%	-0.29%	1.07%	0.18%	0.95%	3.21%	8.37%
IMA-GERAL	0.47%	0.64%	0.52%	-0.22%	0.95%	0.05%	0.77%	2.42%	8.23%
IMA-B5	0.68%	0.59%	0.77%	-0.20%	1.05%	0.39%	1.24%	3.32%	8.23%
IRF-M	0.67%	0.46%	0.54%	-0.52%	0.66%	-0.29%	-0.17%	1.51%	7.89%
IRF-M 1+	0.60%	0.34%	0.43%	-1.02%	0.60%	-0.72%	-1.14%	0.22%	6.61%
IMA-B	-0.45%	0.55%	0.08%	-1.61%	1.33%	-0.97%	-1.27%	-1.10%	3.07%
IMA-B5+	-1.47%	0.51%	-0.55%	-2.91%	1.59%	-2.25%	-3.58%	-5.04%	-1.43%
IDKa IPCA 20A	-3.34%	0.22%	-1.51%	-4.90%	2.01%	-5.03%	-7.87%	-12.09%	-8.64%
<b>Renda Variável</b>									
IDIV	-3.51%	0.91%	-1.20%	-0.56%	-0.99%	1.99%	0.42%	-3.41%	12.09%
IBRX - 50	-4.15%	0.91%	-0.81%	-0.62%	-3.11%	1.63%	-2.15%	-6.12%	7.39%
IFIX	0.67%	0.79%	1.43%	-0.77%	0.02%	-1.04%	-1.78%	1.08%	6.09%
IBrX - 100	-4.51%	0.96%	-0.73%	-1.34%	-3.18%	1.51%	-3.03%	-7.20%	5.59%
Ibovespa	-4.79%	0.99%	-0.71%	-1.70%	-3.04%	1.48%	-3.28%	-7.66%	4.93%
IVBX-2	-4.91%	2.30%	1.50%	-5.81%	-3.66%	2.23%	-7.23%	-8.40%	-0.76%
ISE	-4.96%	1.99%	1.21%	-6.02%	-3.61%	1.10%	-8.41%	-10.14%	-5.90%
SMLL	-6.55%	0.47%	2.15%	-7.76%	-3.38%	-0.39%	-11.23%	-14.85%	-11.96%
<b>Investimentos no Exterior</b>									
Global BDRX	4.78%	6.30%	4.04%	0.57%	7.32%	12.79%	21.74%	41.07%	54.78%
S&P 500	3.94%	5.80%	3.37%	-0.79%	6.22%	9.73%	15.63%	31.45%	41.53%
MSCI ACWI	2.86%	4.79%	3.14%	0.00%	5.22%	8.28%	13.94%	26.67%	35.48%
S&P 500 (M. Orig.)	1.59%	5.17%	3.10%	-4.16%	4.80%	3.47%	3.92%	14.48%	22.70%
MSCI ACWI (M.Orig.)	0.53%	4.17%	2.88%	-3.39%	3.82%	2.10%	2.41%	10.32%	17.45%
<b>Índices Econômicos</b>									
DÓLAR	2.32%	0.60%	0.26%	3.51%	1.35%	6.05%	11.26%	14.82%	15.35%
SELIC	0.97%	0.80%	0.83%	0.89%	0.83%	0.79%	2.53%	5.22%	11.69%
IPCA	0.42%	0.83%	0.16%	0.38%	0.46%	0.21%	1.05%	2.48%	4.23%
INPC	0.57%	0.81%	0.19%	0.37%	0.46%	0.25%	1.08%	2.68%	3.70%
IGP-M	0.07%	-0.52%	-0.47%	0.31%	0.89%	0.81%	2.03%	1.10%	2.45%
<b>Meta Atuarial</b>									
IPCA + 6% a.a.	0.93%	1.27%	0.62%	0.89%	0.95%	0.67%	2.54%	5.46%	10.40%
INPC + 6% a.a.	1.08%	1.25%	0.65%	0.88%	0.95%	0.71%	2.57%	5.66%	9.84%
IPCA + 5% a.a.	0.85%	1.20%	0.55%	0.81%	0.87%	0.60%	2.29%	4.97%	9.38%
INPC + 5% a.a.	1.00%	1.18%	0.58%	0.80%	0.87%	0.64%	2.32%	5.17%	8.82%
IPCA + 4% a.a.	0.76%	1.13%	0.47%	0.72%	0.79%	0.52%	2.05%	4.48%	8.35%
INPC + 4% a.a.	0.91%	1.11%	0.50%	0.71%	0.79%	0.56%	2.08%	4.68%	7.80%

Em resumo, ao examinar a tabela, notamos que, em sua maioria, os indicadores financeiros internacionais no segundo trimestre de 2024 superaram as metas de rentabilidade estabelecidas para o período e também 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 fechamento do 1º semestre 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 do ano se refletem no gráfico e na tabela a seguir:

### Gráfico de Retorno x Volatilidade (no 2º trimestre/1º semestre):

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

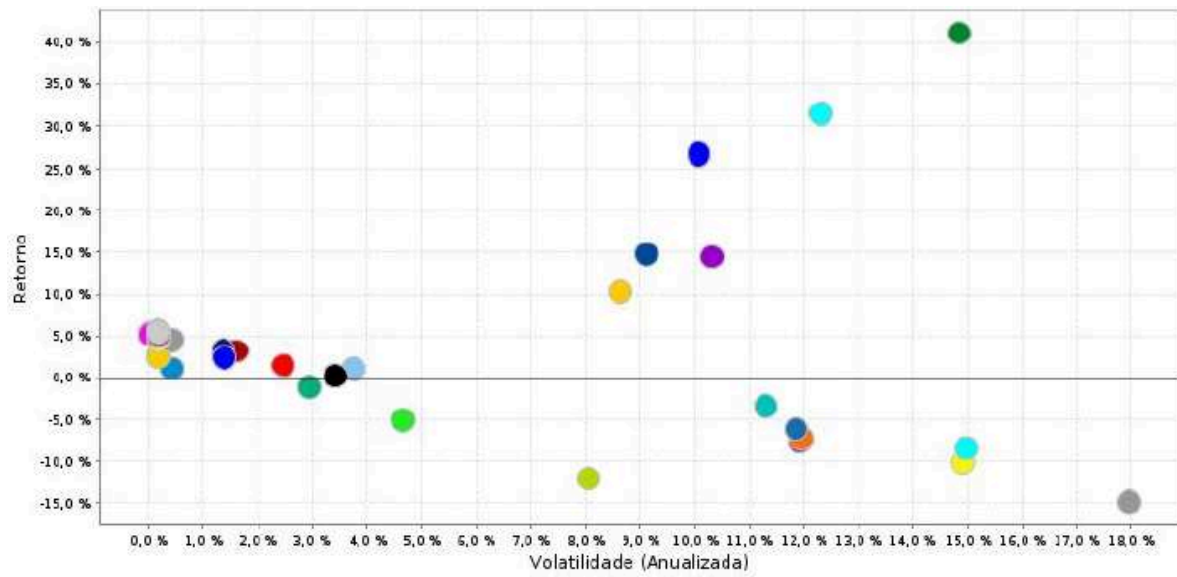


Tabela de Retorno x Volatilidade (no 1º semestre)

	Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
	Global BDRX	41,07%	14,84%
	S&P 500	31,45%	12,31%
	MSCI ACWI	26,67%	10,07%
	Dólar	14,82%	9,12%
	S&P 500 (Moeda Original)	14,48%	10,31%
	MSCI ACWI (Moeda Original)	10,32%	8,64%
	INPC + 6,00%	5,66%	0,17%
	IPCA + 6,00%	5,46%	0,18%
	IMA-S	5,32%	0,04%
	CDI	5,22%	0,03%
	Selic	5,22%	0,03%
	INPC + 5,00%	5,17%	0,17%
	IPCA + 5,00%	4,97%	0,18%
	INPC + 4,00%	4,68%	0,17%
	IRF-M 1	4,51%	0,42%
	IPCA + 4,00%	4,48%	0,18%
	IMA-B 5	3,32%	1,37%
	IDkA IPCA 2 Anos	3,21%	1,61%
	INPC	2,68%	0,17%
	IPCA	2,48%	0,18%
	IMA Geral	2,42%	1,38%
	IRF-M	1,51%	2,47%
	IGP-M	1,10%	0,43%
	IFIX	1,08%	3,75%
	IRF-M 1+	0,22%	3,42%
	IMA-B	-1,10%	2,95%
	IDIV	-3,41%	11,30%
	IMA-B 5+	-5,04%	4,66%
	IBX-50	-6,12%	11,86%
	IBX	-7,20%	11,95%
	Ibovespa	-7,66%	11,92%
	IVBX-2	-8,40%	14,97%
	ISE	-10,14%	14,90%
	IDkA IPCA 20 Anos	-12,09%	8,06%
	SMLL	-14,85%	17,95%

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.

**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

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.

Novo estudo de Asset Liability Management (ALM) foi elaborado pela LDB Consultoria Financeira em 17/05/2024 e, com base no estudo, 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	5,22%
IMA-B	67,84%
SMLL	1,94%
MSCI AC	10,00%
S&P500	15,00%
IFIX	0,00%
<b>TOTAL</b>	<b>100,00%</b>

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



NTN-B	15/08/2040	15/05/2045
<b>ALOCAÇÃO (%)</b>	<b>30,86%</b>	<b>37,92%</b>
<b>ALOCAÇÃO (R\$)</b>	112.210.735,04	137.877.751,86
<b>ATUAL RIO PRETO PREV</b>	36.478.764,58	40.769.292,85
<b>DIFERENÇA</b>	<b>75.731.970,46</b>	<b>97.108.459,01</b>
<b>PU's NTNBS em 16/05/2024</b>	4.321,52	4.238,12
<b>QUANTIDADES de NTNBS</b>	<b>17.524</b>	<b>22.913</b>

**LIÇÃO DE CASA A FAZER!**

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.

Em reunião ordinária de 10/06/2024 o Comitê de Investimentos optou por realizar a troca de uma parte de fundos compostos por títulos públicos, marcados a mercado, pela aquisição direta de NTN-B, com remuneração acima da meta atuarial e marcação na curva, retirando a volatilidade da carteira e seguindo as indicações dos vértices trazidos pelo referido estudo de ALM.

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 fechamento do segundo trimestre de 2024 (1º semestre 2024), que registrou uma rentabilidade acumulada no ano de 3,7%, e meta atuarial de 4,98%, alcançando um cumprimento de meta de 74,3%, reforçamos 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 3,17% em Renda Fixa, -9,48% em Renda Variável, 28,89% em Investimentos no Exterior e 12,16% 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.

**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

Este desempenho, embora inferior 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 SEGUNDO 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 segundo 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 IBOVESPA.** Os dois seguintes, com 6,00% e 3,71% do PL, são, respectivamente, BB PREV AÇÕES ALOCAÇÃO FIA e BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO.

No que diz respeito aos limites em relação ao PL da Riopretoprev, o maior percentual é do fundo BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO, representando 4,77% do PL. Os fundos FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP e BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA ocupam o 2º e 3º lugares, com 3,81% e 3,43% do PL, respectivamente.

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

- ✓ Renda Fixa: 70,59% do PL (Limite 100%);
- ✓ Renda Variável: 12,70% do PL (Limite 50%, Art. 8, § 3º);
- ✓ Investimentos no Exterior: 8,01% do PL (Limite 10%);
- ✓ Investimentos Estruturados: 8,70% do PL (Limite 20%, Art. 10, § 2º).

Adicionalmente, a análise de Artigos específicos, como o Art. 14 (que representa 21,40% 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, de acordo com os artigos, incisos e alíneas especificados, demonstra a aderência aos parâmetros previamente definidos:

### **Renda Fixa:**

- ✓ Art. 7º, I, a => 49,70% do PL (Objetivo: 32%; Limite entre 0% e 60%);
- ✓ Art. 7º, I, b => 11,42% do PL (Objetivo: 19,5%; Limite entre 10% e 70%);
- ✓ Art. 7º, III, a => 7,78% do PL (Objetivo: 13,5%; Limite entre 0% e 60%);
- ✓ Art. 7º, IV => 1,14% 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 => 12,70% do PL (Objetivo: 13%; Limite entre 0% e 30%).

### **Investimentos no Exterior:**

- ✓ Art. 9º, II => 3,59% do PL (Objetivo: 5%; Limite entre 0% e 10%);
- ✓ Art. 9º, III => 4,42% do PL (Objetivo: 4%; Limite entre 0% e 10%).

### **Investimentos Estruturados:**

- ✓ Art. 10º, I => 6,09% do PL (Objetivo: 7,5%; Limite entre 0% e 15%);
- ✓ Art. 10º, II => 2,61% 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\$ 45,64 mi; 8,3% do PL):**

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

**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

***Caixa (R\$ 100,74 mi; 18,33% do PL):***

- ✓ 15 fundos: 3 RV, 1 Multimercado Bolsa Americana, 1 Invest. Exterior, 10 RF.
- ✓ Notáveis: fundos DI vinculados a contas, múltiplos IMAs e estratégias alinhadas ao cenário econômico.

***Bradesco (R\$ 19,65 mi; 3,57% do PL):***

- ✓ 3 fundos: 2 RF (IMA-B5 e IMA-B, tendo sido desinvestido totalmente em 06/2024), 1 RV Mid Small Cap.

***XP Investimentos (R\$ 11,543 mi; 2,1% do PL):***

- ✓ 3 fundos: RV dividendos, Invest. Exterior e FIP Pátria Investimentos.
- ✓ Custódia das NTN-Bs (R\$ 273,15 mi; 49,7% do PL)
- ✓ Custódia LF BTG Pactual (R\$ 6,26 mi; 1,14% do PL)

***Santander (R\$ 18,22 mi; 3,32% do PL):***

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

***Western Asset (R\$ 23,72 mi; 4,31% do PL):***

- ✓ 3 fundos: IMA-B ATIVO (tendo sido desinvestido totalmente em 06/2024), IMA-B5 ATIVO e Invest. Exterior Ações BDR.

***Kinea/Lions (R\$ 11,687 mi; 2,13% do PL):***

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

***Kinea/Intrag (R\$ 1,23 mi; 0,22% do PL):***

- ✓ 1 fundo FIP em captação inicial.

***BTG Pactual (R\$ 28,73 mi; 5,23% do PL):***

- ✓ 3 fundos: RV de ações valor, Multimercado S&P 500 e FIP Economia Real em captação inicial.

***Banco Daycoval (R\$ 9,07 mi; 1,65% do PL):***

- ✓ 2 fundos: 1 RV com gestão Tarpon e 1 com gestão Guepardo, ambos de ações valor.

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 segundo trimestre (1º semestre 2024), 70,59% dos recursos (R\$ 387,99 milhões) foram alocados em Renda Fixa, conforme a Resolução n.º 4.963/2021 (art. 7º). O segmento registrou uma valorização de 1,15% no 2º trimestre e 3,17% no 1º semestre. Houve grande oscilação nas curvas de juros futuras, refletindo o aumento da incerteza sobre a condução da política econômica, o aumento dos ruídos entre Governo e Banco Central, tudo isso em meio a um cenário externo desafiador. No final do 2º trimestre foram feitas alterações de estratégia no segmento, com a diminuição da exposição em fundos de maior duration, IMA-B e IMA-B5+, cerca de R\$ 80 milhões no total (quase 15% da carteira) e consequente aquisição de títulos públicos federais com marcação na curva, diminuindo a volatilidade da carteira e em linha com a sugestão trazida pelo novo estudo de Asset Liability Management-ALM, de 17/05/2024, nos vértices 2040 e 2045, sendo que o segmento de Títulos públicos federais valorizou-se em 2,46% no 2º trimestre e 5,61% no 1º semestre, superando a meta atuarial. Os fundos 100% títulos públicos, apresentaram desvalorização média de -0,27% no trimestre e rentabilidade média de 0,54% no semestre. Fundos de renda fixa geral alcançaram rendimento médio de -0,35% no trimestre e 0,68% no semestre. Destaque para ativos emitidos por instituições financeiras, como a Letra Financeira Subordinada do Banco BTG Pactual SA, com rendimento de 3,07% no trimestre. O fundo de renda fixa de crédito privado, BB Prev CP IPCA III, apresentou rendimento de -0,22% no trimestre e 2,16% no semestre. O CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF foi o fundo que se destacou, rendendo 5,71% no semestre. 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. O Comitê de Investimentos tem acompanhado os fundos de gestão ativa que diante do cenário de alta volatilidade dos últimos anos não tem tido agilidade e expertise nas movimentações conforme era esperado pela estratégia. No geral, a Renda Fixa performou no 2º trimestre de 2024 com valorização de R\$ 4.454.537,19, rendimento médio de 1,15%, abaixo da meta atuarial trimestral de 2,3%, e fechou o 1º semestre de 2024 com valorização de R\$ 12.203.354,25, rendimento médio de 3,17%.

### **RENDA VARIÁVEL:**

**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

No trimestre, 12,70% (R\$ 69,789 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\$ 69,79 milhões (12,70% do PL) se desvalorizaram em média 5,44% no 2º trimestre, seguindo o principal índice do setor, o Ibovespa, que não seguiu a dinâmica dos índices internacionais, desvalorizando-se em 3,28% no trimestre. 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 abril, o Comitê de Investimentos terminou processo de otimização do segmento de renda variável iniciado em março, conforme deliberado em reunião ordinária de 22/03/24, com resgate parcial do FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS e realocação de recursos resgatados de outros fundos em outras estratégias do segmento com gestão ativa e foco em empresas com alto potencial de valorização, sendo o fundo TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA, fundo BTG PACTUAL FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES OPORTUNIDADES LISTADAS I, e fundo GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA.

No trimestre todos os fundos do segmento tiveram desvalorização, assim como no fechamento do semestre, mesmo com recuperação do segmento ao final do mês 06/2024. 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 se desvalorizou R\$ 3.993.982,52 no trimestre e fechou o 1º semestre com desvalorização de R\$ 7.351.088,69, que corresponde a -9,48%.

### **INVESTIMENTOS NO EXTERIOR:**

No trimestre, 8,01% (R\$ 44,032 milhões) dos recursos foram destinados a Investimentos no Exterior, seguindo a Resolução n.º 4.963/2021 (art. 9º). Nesse 2º trimestre, o segmento teve valorização de 13,02%. Nos fundos de Investimento no Exterior GLOBAL (Art. 9º, II), ficaram 3,59% do PL da Riopretoprev, R\$ 19,75 milhões, com rentabilidade média de 7,61%. Os fundos BDR (Art. 9º, III) somam R\$ 24,28 milhões (4,42% do PL), com desempenho médio de 11,91% no trimestre. Não foram feitas movimentações no segmento no período.

Todos os fundos fecharam o trimestre com rentabilidade acima da meta atuarial, o destaque do trimestre ficou para o fundo FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I com 21,34% de rentabilidade no período, sendo também o destaque no semestre com rentabilidade de 39,52%. No geral, os Investimentos no Exterior fecharam o trimestre com valorização de R\$ 5.073.214,86 e o semestre com valorização de R\$ 9.855.667,40, rentabilidade de 28,89%.

### **INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS:**

No trimestre, 8,7% (R\$ 47,834 milhões) dos recursos foram alocados em Investimentos Estruturados. Em fundos Multimercados (art. 10º, I), ficaram 6,09% do PL da Riopretoprev, R\$ 33,49 milhões, com valorização média de 5,15%. Não foram feitas movimentações na estratégia. Em fundos de participação (art. 10º, II), ficaram 2,61% do PL, R\$ 14,34 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. Desvalorizaram-se -0,47% no trimestre impactados pelo período de integralização de capital da maior parte dos fundos. Foram feitas integralizações nos FIP's Kinea IV, BTG Economia Real e Pátria VII, que juntas somam cerca de R\$ 630 mil. No geral, o segmento de Investimentos Estruturados teve

valorização no trimestre de R\$ 1.577.072,02, média de 3,45% e fechou o semestre com valorização de 12,16%, R\$ 5.150.392,11.

### **DISPONIBILIDADE FINANCEIRA**

O primeiro trimestre havia se encerrado com R\$ 2.116.716,16 disponíveis em conta corrente, cuja destinação foi dada de acordo com deliberação do Comitê de Investimentos. Já no fechamento do 2º trimestre todos os recursos estavam aplicados no mercado financeiro fechando as contas com saldo zerado.

### **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.

Embora a rentabilidade da carteira de investimentos não tenha atingido a meta atuarial no trimestre e no encerramento do semestre, é possível observar não apenas o comprometimento, mas também a diligência do Comitê, que se dedica firmemente a assegurar a saúde financeira e o cumprimento das obrigações previdenciárias. O Comitê tem buscado realizar otimizações nos diversos segmentos da carteira, com o objetivo de posicioná-la estrategicamente em consonância com as oscilações do cenário econômico.

Além disso, é importante ressaltar que a meta gerencial, representada pelo IMA-B, se desvalorizou em 1,1% no período. Nesse contexto, é digno de nota que somente os investimentos no exterior e os ativos de curto prazo, Selic e CDI, 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 2º TRIMESTRE:**

- ✓ RENDIMENTO no 2º tri-2024 (em R\$): R\$ 7.110.841,55
- ✓ RENDIMENTO no 2º tri-2024 (em %): 1,3%
- ✓ META ATUARIAL no 2º tri-2024 (%): 2,3%
- ✓ RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL (%) NO 2º tri-2024: 56,52%

## RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL no 1º SEMESTRE:

- ✓ RENDIMENTO no 1º sem-2024 (em R\$): R\$ 19.858.325,07
- ✓ RENDIMENTO no 1º sem-2024 (em %): 3,70%
- ✓ META ATUARIAL no 1º sem-2024 (%): 4,98%
- ✓ RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL (%) NO 1º sem-2024: 74,30%

## RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL ANUAL:

- ✓ RENDIMENTO ano (em R\$): R\$ 19.858.325,07
- ✓ RENDIMENTO ano (em %): 3,70%
- ✓ META ATUARIAL ano (%): 4,98%
- ✓ META GERENCIAL (IMA-B) (%): -1,10%
- ✓ CDI (%): 5,22%
- ✓ IBOVESPA (%): -7,66%
- ✓ IBX-50 (%): -6,12%
- ✓ IRF M1 (%): 4,51%
- ✓ S&P 500 (%): 31,45%
- ✓ MSCI ACWI (%): 26,67%

## PERFORMANCE NOS ÚLTIMOS PERÍODOS:

- ✓ NOS ÚLTIMOS 3 MESES: 56,52%
- ✓ NOS ÚLTIMOS 6 MESES: 74,30%
- ✓ NOS ÚLTIMOS 12 MESES: 104,57%
- ✓ DO ANO EM CURSO: 74,30%
- ✓ DESDE O INÍCIO DA ADMINISTRAÇÃO DA CARTEIRA: 61,29%
- ✓ DESDE O INÍCIO DA RIOPRETOPREV: 85,83%

Com base nos resultados apresentados, o desempenho do portfólio de investimentos ao final do segundo 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 3,70% superou significativamente a meta gerencial (IMA-B) de -1,10%, e os principais índices de mercado brasileiros (IBOVESPA e IBX-50), com exceção ao CDI e índices de curto prazo, 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 31,45% e 26,67%, 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 74,30%.

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 segundo 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 PAZIANOTO**

Diretor Executivo

*(assinatura digital)*

**PATRICIA NATO TONINATO  
BARTOLOMEI**

Coordenadora do Comitê de Investimentos

*(assinatura digital)*

**FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES**

Presidente do Conselho Fiscal





# SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO

2º TRIMESTRE 2024

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385



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 28.06.2024.

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

70,59%

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 150824 (5,270000%)	0,22	0,03	0,80	2,34	7.102.179,75	1,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824 (7,408000%)	0,22	0,04	0,96	2,85	10.613.457,35	1,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (5,525000%)	0,25	0,04	0,81	2,40	11.597.990,29	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,563000%)	0,26	0,04	0,89	2,65	10.857.221,82	1,98
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (6,081000%)	4,15	0,04	0,86	1,28	2.289.008,58	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,825000%)	0,37	0,03	0,76	2,23	5.704.920,95	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,875000%)	0,37	0,03	0,77	2,24	5.758.312,48	1,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,965000%)	0,37	0,03	0,77	2,26	5.666.223,92	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,38	0,04	0,80	2,35	5.671.786,27	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,100000%)	0,41	0,04	0,86	2,54	5.445.483,00	0,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,830000%)	0,42	0,03	0,76	2,23	11.960.063,48	2,18
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,873000%)	0,42	0,03	0,77	2,24	11.897.828,93	2,16
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,045000%)	0,43	0,03	0,78	2,28	5.843.374,11	1,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,45	0,04	0,80	2,36	5.848.518,13	1,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,46	0,04	0,83	2,44	1.511.371,89	0,27



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,235000%)	4,23	0,04	0,48	0,48	15.069.867,83	2,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,330000%)	4,27	0,04	0,44	0,44	12.054.187,09	2,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,351500%)	4,28	0,04	0,40	0,40	12.910.080,47	2,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,690000%)	0,52	0,04	0,83	2,44	5.657.813,69	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,750000%)	2,89	0,04	0,83	2,45	2.225.967,89	0,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,854000%)	0,53	0,04	0,84	2,48	5.538.189,38	1,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,895000%)	0,53	0,04	0,84	2,49	21.472.619,67	3,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,275000%)	4,26	0,04	0,48	0,48	15.070.000,40	2,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,362000%)	4,30	0,04	0,44	0,44	12.051.154,72	2,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,381500%)	4,31	0,04	0,40	0,40	12.910.778,73	2,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,421000%)	0,56	0,04	0,88	2,61	5.408.204,32	0,98
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,760000%)	0,58	0,04	0,83	2,45	1.149.547,87	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,832500%)	0,58	0,04	0,84	2,47	5.978.642,93	1,09
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,042000%)	0,59	0,04	0,85	2,52	10.931.387,08	1,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,351000%)	0,60	0,04	0,88	2,60	10.758.051,23	1,96
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,352000%)	0,61	0,04	0,88	2,60	5.439.558,38	0,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,351000%)	0,64	0,04	0,88	2,60	10.757.693,12	1,96
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,43</b>	<b>0,04</b>	<b>0,84</b>	<b>2,46</b>	<b>273.151.485,75</b>	<b>49,70</b>

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,61	-0,08	0,38	1,40	13.988.019,76	2,54	6.543.333.888,45	0,21
BB	BB	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,81	0,00	-1,25	-1,59	0,00	0,00	4.649.802.742,18	0,00
BB	BB	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,86	0,05	1,16	2,85	596.395,27	0,11	197.669.973,94	0,30
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,87	0,05	1,16	2,85	1.033.434,36	0,19	243.525.255,41	0,42
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,72	-0,18	-0,17	-0,17	4.991.639,72	0,91	7.303.046.549,52	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,89	0,00	-1,33	-2,71	0,00	0,00	1.144.374.704,79	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,80	-0,51	-1,00	-1,35	4.228.831,28	0,77	4.133.113.700,82	0,10
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,11	0,03	0,78	2,39	5.884.995,30	1,07	11.312.134.510,29	0,05
CAIXA DTVM	CEF	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,42	-0,14	0,17	0,55	10.944.597,93	1,99	4.858.229.912,84	0,23
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,72	-0,18	0,37	1,18	10.068.285,77	1,83	1.312.208.437,83	0,77
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	4,80	0,00	-0,97	-2,00	0,00	0,00	150.880.927,99	0,00
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,81	-0,33	-0,08	0,00	11.022.290,72	2,01	364.688.708,04	3,02
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,75</b>	<b>-0,17</b>	<b>-0,27</b>	<b>-0,27</b>	<b>62.758.490,11</b>	<b>11,42</b>		

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.				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,64	2,02	29.241,16	0,01	5.048.562.747,13	0,00
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,73	-0,18	0,36	1,16	8.615.195,86	1,57	827.438.439,72	1,04
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	3,85	0,00	-1,28	-1,73	0,00	0,00	496.040.994,80	0,00
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,12	0,03	0,79	2,47	1.219.098,01	0,22	5.436.885.879,50	0,02
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,09	0,04	0,82	2,57	10.856.969,02	1,98	16.508.104.382,05	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,06	0,04	0,71	2,27	1.061.243,06	0,19	976.883.009,20	0,11
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	3,91	-0,54	-1,08	-1,50	20.956.507,28	3,81	1.103.980.003,66	1,90
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>2,49</b>	<b>-0,34</b>	<b>-0,51</b>	<b>-0,35</b>	<b>42.738.254,39</b>	<b>7,78</b>		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	3,45	1,07	1,07	3,07	6.262.380,36	1,14		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>3,45</b>	<b>1,07</b>	<b>1,07</b>	<b>3,07</b>	<b>6.262.380,36</b>	<b>1,14</b>		

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	1,86	-0,37	-0,43	-0,22	3.081.804,42	0,56	282.732.605,04	1,09
<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>			<b>1,86</b>	<b>-0,37</b>	<b>-0,43</b>	<b>-0,22</b>	<b>3.081.804,42</b>	<b>0,56</b>		
Renda Fixa			1,32	-0,02	0,29	1,15	387.992.415,03	70,59		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

REND A VARIÁVEL

12,70%

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 ALOCAÇÃO FIA	13,25	-0,37	0,65	-4,13	18.851.231,58	3,43	314.142.041,59	6,00
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	13,49	-0,32	1,90	-3,95	2.157.725,62	0,39	1.108.199.259,35	0,19
BRAM	BEM	BRDESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	19,36	-1,35	-0,04	-8,16	11.035.123,30	2,01	572.598.578,35	1,93
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL FI DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I	13,54	-0,70	-0,71	-3,13	2.050.457,82	0,37	83.282.495,43	2,46
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	13,33	-0,32	1,44	-3,20	4.641.427,29	0,84	70.654.149,17	6,57
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	14,09	-0,38	1,37	-5,44	14.206.626,91	2,58	748.046.356,69	1,90
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,59	-0,97	-0,11	-7,64	4.908.050,21	0,89	660.651.400,16	0,74
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	15,57	-0,58	1,13	-0,91	4.458.835,27	0,81	603.162.953,92	0,74
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	16,07	0,02	0,20	-5,29	4.615.547,44	0,84	512.193.916,08	0,90
XP	SANTANDER	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	13,52	-0,31	2,18	-6,85	2.861.775,50	0,52	317.857.676,48	0,90
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>14,27</b>	<b>-0,56</b>	<b>0,75</b>	<b>-5,44</b>	<b>69.786.800,94</b>	<b>12,70</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>14,27</b>	<b>-0,56</b>	<b>0,75</b>	<b>-5,44</b>	<b>69.786.800,94</b>	<b>12,70</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR 8,01%

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	13,39	1,88	6,01	10,70	2.942.190,74	0,54	404.308.410,77	0,73
BB	BB	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	12,98	1,61	10,57	15,78	930.766,59	0,17	1.564.931.574,84	0,06
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	18,09	1,17	11,56	10,28	7.720.375,22	1,40	820.358.590,52	0,94
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS IS MULTIMERCADO IE - FIF RESP LIMITADA	11,24	-0,28	4,36	4,89	8.155.540,97	1,48	439.813.206,88	1,85
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>11,62</b>	<b>0,69</b>	<b>7,61</b>	<b>8,29</b>	<b>19.748.873,52</b>	<b>3,59</b>		

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.				
BB	BB	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	13,62	0,05	9,68	13,97	3.059.904,08	0,56	866.496.887,76	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,96	0,88	12,73	21,34	8.529.231,63	1,55	2.736.870.167,13	0,31
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	15,17	0,71	11,90	15,32	12.694.604,21	2,31	1.797.571.340,76	0,71
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>14,30</b>	<b>0,68</b>	<b>11,91</b>	<b>17,19</b>	<b>24.283.739,92</b>	<b>4,42</b>		

Investimentos no Exterior 11,80 0,69 9,94 13,02 44.032.613,44 8,01



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,70%

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	11,07	-0,28	3,99	5,19	26.212.066,20	4,77	705.926.006,88	3,71
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,06	-0,28	3,90	5,01	7.277.998,60	1,32	1.972.213.735,46	0,37
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>10,88</b>	<b>-0,28</b>	<b>3,97</b>	<b>5,15</b>	<b>33.490.064,80</b>	<b>6,09</b>		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	11,57	8,69	-12,96	-17,48	466.892,97	0,08	100.318.489,19	0,47
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	3,37	-0,65	-0,24	-0,60	11.687.302,87	2,13	372.824.928,44	3,13
KINEA	INTRAG	KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	31,88	-0,71	-0,71	-2,05	1.228.678,86	0,22	134.171.731,67	0,92
PÁTRIA	XP	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	11,03	9,05	8,44	6,77	961.165,85	0,17	160.194.308,40	0,60
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>2,93</b>	<b>0,22</b>	<b>0,14</b>	<b>-0,47</b>	<b>14.344.040,55</b>	<b>2,61</b>		

Investimentos Estruturados			7,65	-0,13	2,83	3,45	47.834.105,35	8,70		
Total			3,04	-0,04	1,27	1,30	549.645.934,76	100,00		

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
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	273.151.485,75	49,70	0,00	32,00	60,00	42,53	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	62.758.490,11	11,42	10,00	19,50	70,00	10,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	42.738.254,39	7,78	0,00	13,50	60,00	18,82	80,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	6.262.380,36	1,14	0,00	1,40	10,00	1,14	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	3.081.804,42	0,56	0,00	0,60	5,00	0,57	20,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>387.992.415,03</b>	<b>70,59</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	69.786.800,94	12,70	0,00	13,00	30,00	1,94	50,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>69.786.800,94</b>	<b>12,70</b>					50,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	19.748.873,52	3,59	0,00	5,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	24.283.739,92	4,42	0,00	4,00	10,00	5,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>44.032.613,44</b>	<b>8,01</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	33.490.064,80	6,09	0,00	7,50	15,00	12,44	15,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	14.344.040,55	2,61	0,00	3,50	8,00	2,56	15,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>47.834.105,35</b>	<b>8,70</b>					20,00
<b>Total</b>		<b>549.645.934,76</b>	<b>100,00</b>					

**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	0,84 106,59	2,46 97,39	2,46 97,39	5,61 107,54	10,21 87,34	1.949.123,84	4.982.667,53
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,27 -34,04	-0,27 -10,71	-0,27 -10,71	0,54 10,28	5,35 45,77	-377.741,53	-376.815,47
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,51 -65,21	-0,35 -13,87	-0,35 -13,87	0,68 12,96	5,79 49,54	-487.245,56	-331.354,68
Artigo 7º IV % do CDI	1,07 135,99	3,07 121,52	3,07 121,52	7,01 134,24	12,62 107,93	66.421,63	186.802,25
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	-0,43 -55,06	-0,22 -8,65	-0,22 -8,65	2,16 41,46	7,39 63,19	-13.434,65	-6.762,44
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	0,75 -0,73	-5,44 -2,16	-5,44 -2,16	-9,48 -1,82	-0,61 -5,54	516.912,37	-3.993.982,52
Artigo 9º II % do CDI	7,61 965,53	8,29 327,55	8,29 327,55	21,68 415,29	34,41 294,33	1.396.873,72	1.511.401,33
Artigo 9º III % do CDI	11,91 1.510,37	17,19 679,36	17,19 679,36	35,44 678,68	48,69 416,47	2.583.743,64	3.561.813,53
Artigo 10º I % do CDI	3,97 503,58	5,15 203,54	5,15 203,54	16,56 317,12	29,40 251,47	1.278.750,04	1.640.221,49
Artigo 10º II % do CDI	0,14 17,98	-0,47 -18,70	-0,47 -18,70	2,58 49,38	3,27 27,97	21.446,34	-63.149,47
<b>SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>6.934.849,84</b>	<b>7.110.841,55</b>

**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 150529 (6,081000%)	2.269.562,28	0,00	0,00	0,00	2.289.008,58	19.446,30	29.014,07
NTN-B 150535 (4,825000%)	5.661.800,77	0,00	0,00	0,00	5.704.920,95	43.120,18	125.868,34
NTN-B 150535 (4,875000%)	5.714.574,46	0,00	0,00	0,00	5.758.312,48	43.738,02	127.728,60
NTN-B 150535 (4,965000%)	5.622.802,74	0,00	0,00	0,00	5.666.223,92	43.421,18	126.904,20
NTN-B 150535 (5,320000%)	5.626.812,19	0,00	0,00	0,00	5.671.786,27	44.974,08	131.821,67

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (6,100000%)	5.399.142,87	0,00	0,00	0,00	5.445.483,00	46.340,13	136.613,94
NTN-B 150545 (5,690000%)	5.611.389,29	0,00	0,00	0,00	5.657.813,69	46.424,40	136.433,14
NTN-B 150545 (5,750000%)	2.207.603,16	0,00	0,00	0,00	2.225.967,89	18.364,73	53.995,31
NTN-B 150545 (5,854000%)	5.492.073,96	0,00	0,00	0,00	5.538.189,38	46.115,42	135.707,85
NTN-B 150545 (5,895000%)	21.293.156,51	0,00	0,00	0,00	21.472.619,67	179.463,16	528.262,53
NTN-B 150545 (6,275000%)	0,00	14.997.428,53	0,00	0,00	15.070.000,40	72.571,87	72.571,87
NTN-B 150545 (6,362000%)	0,00	11.998.094,76	0,00	0,00	12.051.154,72	53.059,96	53.059,96
NTN-B 150545 (6,381500%)	0,00	12.859.668,73	0,00	0,00	12.910.778,73	51.110,00	51.110,00
NTN-B 150545 (6,421000%)	5.360.892,45	0,00	0,00	0,00	5.408.204,32	47.311,87	139.800,28
NTN-B 150555 (6,351000%)	10.664.138,02	0,00	0,00	0,00	10.757.693,12	93.555,10	276.324,07
NTN-B 150824 (5,270000%)	7.046.131,56	0,00	0,00	0,00	7.102.179,75	56.048,19	162.105,94
NTN-B 150824 (7,408000%)	10.512.909,68	0,00	0,00	0,00	10.613.457,35	100.547,67	294.250,12
NTN-B 150826 (5,525000%)	11.504.246,72	0,00	0,00	0,00	11.597.990,29	93.743,57	271.575,70
NTN-B 150826 (6,563000%)	10.761.101,97	0,00	0,00	0,00	10.857.221,82	96.119,85	280.144,01
NTN-B 150840 (4,830000%)	11.869.625,14	0,00	0,00	0,00	11.960.063,48	90.438,34	260.740,69
NTN-B 150840 (4,873000%)	11.807.470,02	0,00	0,00	0,00	11.897.828,93	90.358,91	260.576,53
NTN-B 150840 (5,045000%)	5.798.247,59	0,00	0,00	0,00	5.843.374,11	45.126,52	130.317,40
NTN-B 150840 (5,360000%)	5.801.968,89	0,00	0,00	0,00	5.848.518,13	46.549,24	134.712,78
NTN-B 150840 (5,690000%)	1.498.971,07	0,00	0,00	0,00	1.511.371,89	12.400,82	35.966,54
NTN-B 150840 (6,235000%)	0,00	14.997.568,97	0,00	0,00	15.069.867,83	72.298,86	72.298,86
NTN-B 150840 (6,330000%)	0,00	12.001.268,19	0,00	0,00	12.054.187,09	52.918,90	52.918,90
NTN-B 150840 (6,351500%)	0,00	12.859.111,72	0,00	0,00	12.910.080,47	50.968,75	50.968,75
NTN-B 150850 (5,760000%)	1.140.055,31	0,00	0,00	0,00	1.149.547,87	9.492,56	27.542,18
NTN-B 150850 (5,832500%)	5.928.955,02	0,00	0,00	0,00	5.978.642,93	49.687,91	144.236,34
NTN-B 150850 (6,042000%)	10.838.826,06	0,00	0,00	0,00	10.931.387,08	92.561,02	269.009,61
NTN-B 150850 (6,351000%)	10.664.506,73	0,00	0,00	0,00	10.758.051,23	93.544,50	272.363,19
NTN-B 150850 (6,352000%)	5.392.256,55	0,00	0,00	0,00	5.439.558,38	47.301,83	137.724,16
	191.489.221,01	79.713.140,90	0,00	0,00	273.151.485,75	1.949.123,84	

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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	13.934.658,14	0,00	0,00	0,00	13.988.019,76	53.361,62	192.479,15
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	15.733.352,07	0,00	-15.536.720,44	0,00	0,00	-196.631,63	-251.625,93
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	589.580,29	0,00	0,00	0,00	596.395,27	6.814,98	16.546,05
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1.021.615,74	0,00	0,00	0,00	1.033.434,36	11.818,62	28.670,88
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	5.000.000,00	0,00	0,00	4.991.639,72	-8.360,28	-8.360,28
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	18.102.956,11	0,00	-17.862.780,43	0,00	0,00	-240.175,68	-496.753,71
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.027.932,49	243.378,57	0,00	0,00	4.228.831,28	-42.479,78	-53.601,40
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.647.644,18	193.106,55	0,00	0,00	5.884.995,30	44.244,57	129.823,80
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	10.925.974,24	0,00	0,00	0,00	10.944.597,93	18.623,69	59.980,30
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	10.031.142,33	0,00	0,00	0,00	10.068.285,77	37.143,44	117.116,16
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5.520.962,47	0,00	-5.467.562,66	0,00	0,00	-53.399,81	-111.443,74
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	11.030.991,99	0,00	0,00	0,00	11.022.290,72	-8.701,27	353,25
	96.566.810,05	5.436.485,12	-38.867.063,53	0,00	62.758.490,11	-377.741,53	

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	179.226,79	587.887,66	-738.719,25	0,00	29.241,16	845,96	4.354,59
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	8.584.497,78	0,00	0,00	0,00	8.615.195,86	30.698,08	98.590,68
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	25.269.416,64	0,00	-24.945.239,01	0,00	0,00	-324.177,63	-438.070,05
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1.209.484,23	0,00	0,00	0,00	1.219.098,01	9.613,78	29.376,11
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.896.259,20	66.771.563,26	-70.962.683,38	0,00	10.856.969,02	151.829,94	479.164,18
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	1.101.854,32	720.849,25	-766.781,17	0,00	1.061.243,06	5.320,66	17.452,68
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	40.482.290,05	1.737.230,24	-20.901.636,66	0,00	20.956.507,28	-361.376,35	-522.222,87
	91.723.029,01	69.817.530,41	-118.315.059,47	0,00	42.738.254,39	-487.245,56	

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

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	6.195.958,73	0,00	0,00	0,00	6.262.380,36	66.421,63	186.802,25
	6.195.958,73	0,00	0,00	0,00	6.262.380,36	66.421,63	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3.095.239,07	0,00	0,00	0,00	3.081.804,42	-13.434,65	-6.762,44
	3.095.239,07	0,00	0,00	0,00	3.081.804,42	-13.434,65	

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	18.729.187,32	0,00	0,00	0,00	18.851.231,58	122.044,26	-811.901,55
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	2.117.580,08	0,00	0,00	0,00	2.157.725,62	40.145,54	-88.700,08
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	11.039.033,31	0,00	0,00	0,00	11.035.123,30	-3.910,01	-980.265,58
BTG PACTUAL FI DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I	2.065.122,81	0,00	0,00	0,00	2.050.457,82	-14.664,99	-66.258,34
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	4.575.366,01	0,00	0,00	0,00	4.641.427,29	66.061,28	-153.200,71
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	14.014.104,53	0,00	0,00	0,00	14.206.626,91	192.522,38	-978.185,69
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	4.913.437,15	0,00	0,00	0,00	4.908.050,21	-5.386,94	-406.181,48
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	4.409.072,86	0,00	0,00	0,00	4.458.835,27	49.762,41	-41.164,73
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	4.606.398,56	0,00	0,00	0,00	4.615.547,44	9.148,88	-257.598,06
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	2.800.585,94	0,00	0,00	0,00	2.861.775,50	61.189,56	-210.526,30
	69.269.888,57	0,00	0,00	0,00	69.786.800,94	516.912,37	

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	2.775.322,88	0,00	0,00	0,00	2.942.190,74	166.867,86	284.459,49

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	841.818,62	0,00	0,00	0,00	930.766,59	88.947,97	126.872,22
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	6.920.250,37	0,00	0,00	0,00	7.720.375,22	800.124,85	719.709,66
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS IS MULTIMERCADO IE - FIF RESP LIMITADA	7.814.607,93	0,00	0,00	0,00	8.155.540,97	340.933,04	380.359,96
	18.351.999,80	0,00	0,00	0,00	19.748.873,52	1.396.873,72	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	2.789.765,39	0,00	0,00	0,00	3.059.904,08	270.138,69	375.114,65
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	7.565.906,66	0,00	0,00	0,00	8.529.231,63	963.324,97	1.499.956,12
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	11.344.324,23	0,00	0,00	0,00	12.694.604,21	1.350.279,98	1.686.742,76
	21.699.996,28	0,00	0,00	0,00	24.283.739,92	2.583.743,64	

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	25.206.532,64	0,00	0,00	0,00	26.212.066,20	1.005.533,56	1.292.821,48
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7.004.782,12	0,00	0,00	0,00	7.277.998,60	273.216,48	347.400,01
	32.211.314,76	0,00	0,00	0,00	33.490.064,80	1.278.750,04	

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	276.237,66	208.333,31	0,00	0,00	466.892,97	-17.678,00	-32.836,76
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	11.536.923,47	178.683,00	0,00	0,00	11.687.302,87	-28.303,60	-70.726,97
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	1.237.456,58	0,00	0,00	0,00	1.228.678,86	-8.777,72	-25.739,62

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	641.869,97	243.090,22	0,00	0,00	961.165,85	76.205,66	66.153,88
	13.692.487,68	630.106,53	0,00	0,00	14.344.040,55	21.446,34	



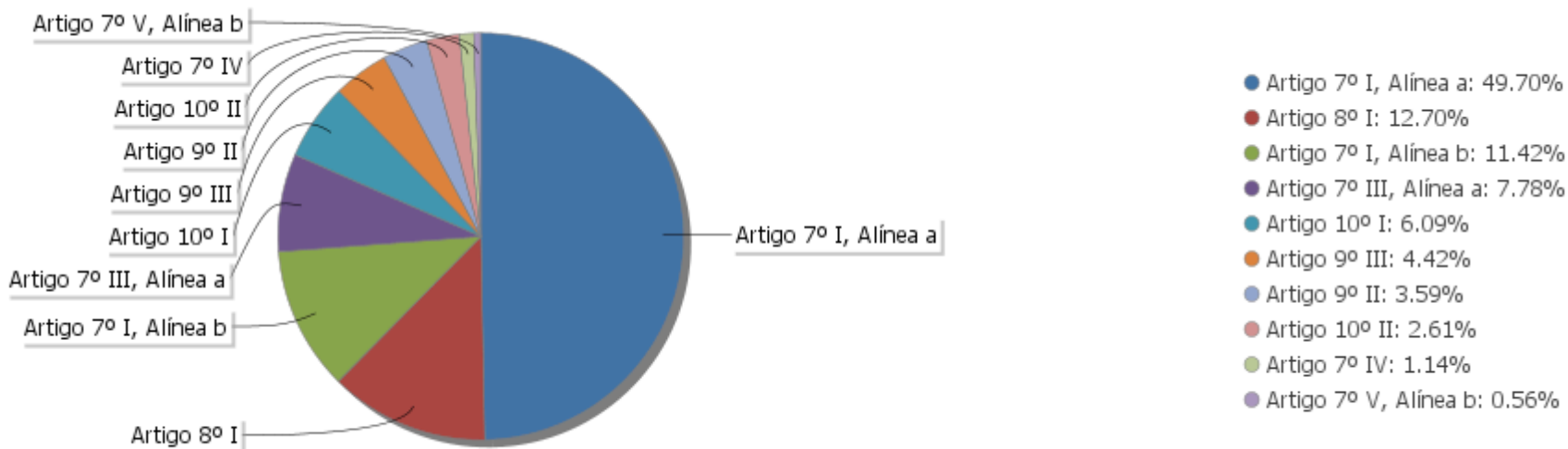
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

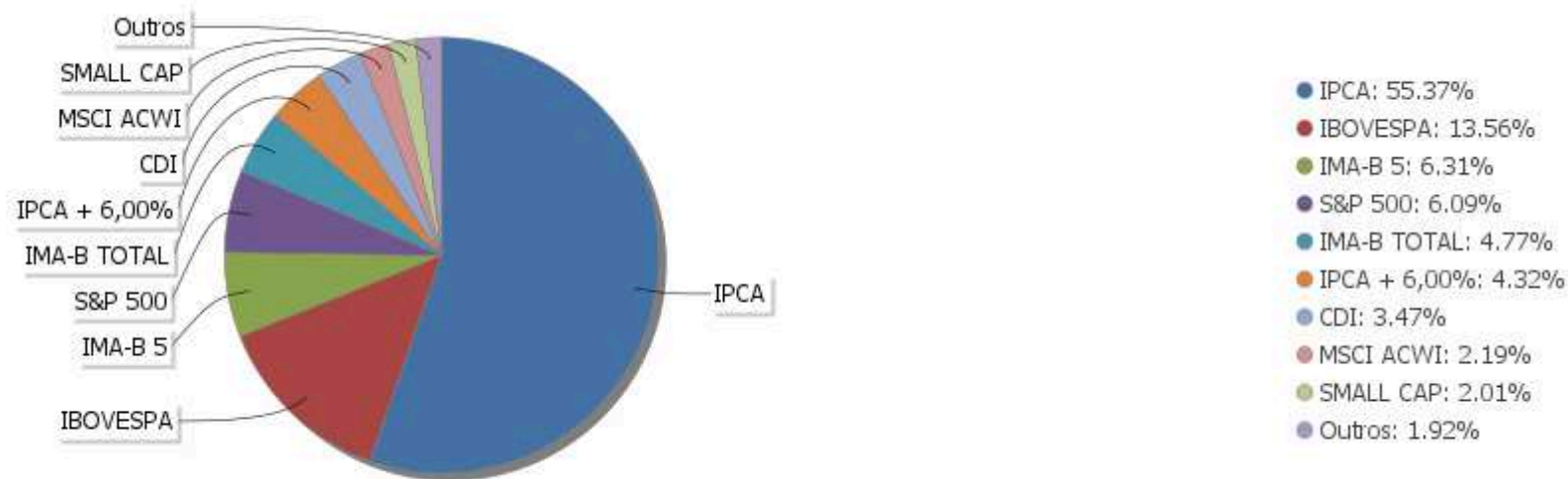
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	228.926.731,03	41,65	40,00	228.926.731,03	41,65	40,00
de 31 dias a 365 dias	42.626.476,35	7,76		271.553.207,38	49,41	40,00
acima de 365 dias	278.092.727,38	50,59		549.645.934,76	100,00	40,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

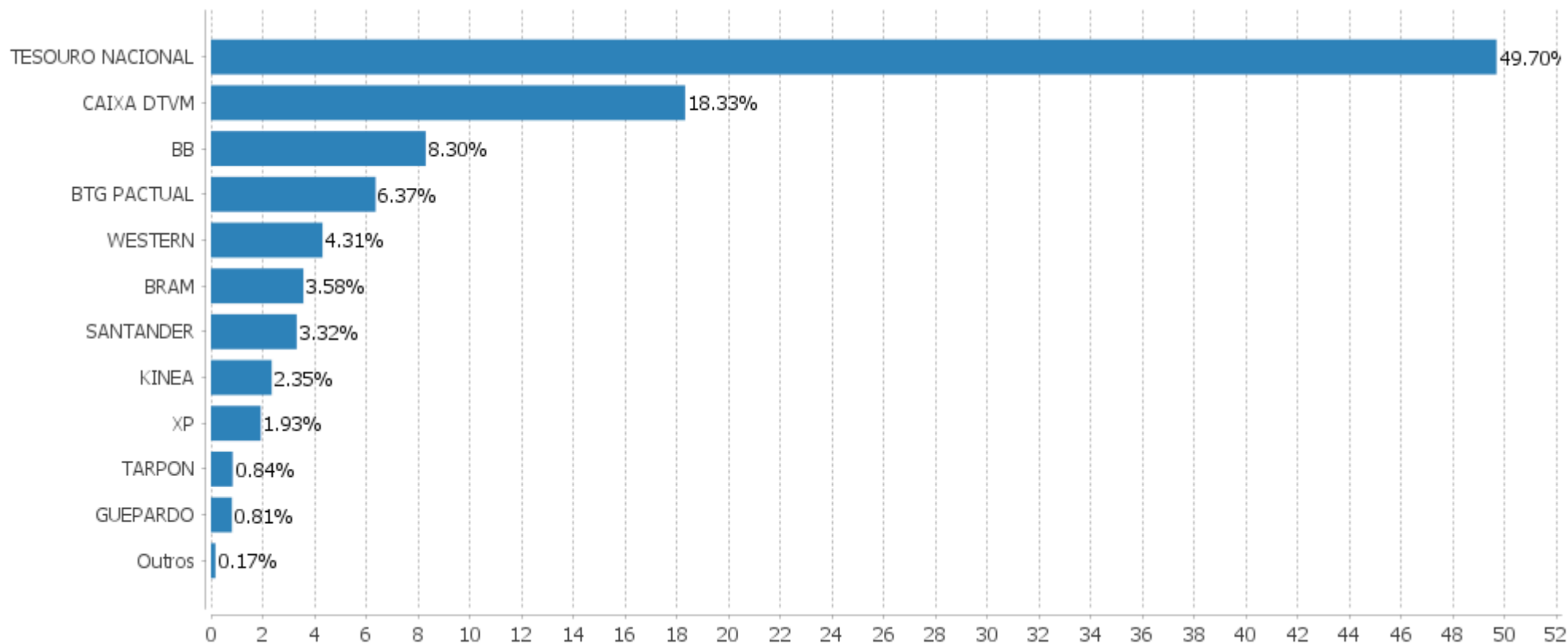


Alocação Por Estratégia



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	-0,94	0,98	1,27							3,70
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60							4,98
p.p. indexador	-0,82	0,33	0,24	-1,75	0,11	0,67							-1,29
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	10,89
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	-1,54	-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

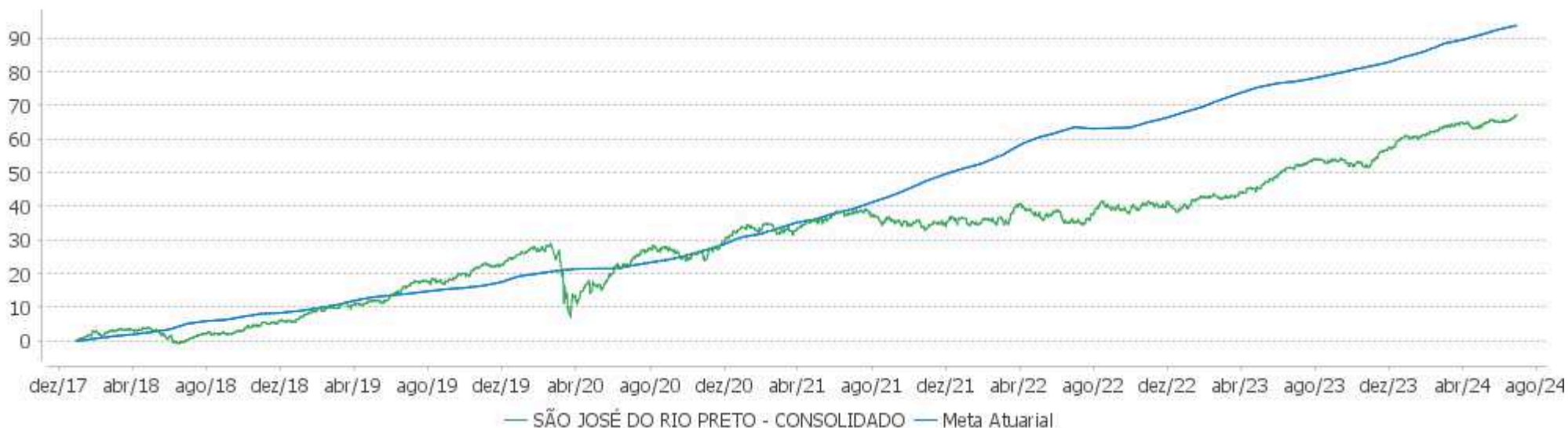
	Quantidade	Perc. (%)
Meses acima - Meta Atuarial	37	47,44
Meses abaixo - Meta Atuarial	41	52,56
	Rentabilidade	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,93	2020-12
Menor rentabilidade da Carteira	-9,41	2020-03

Relatório

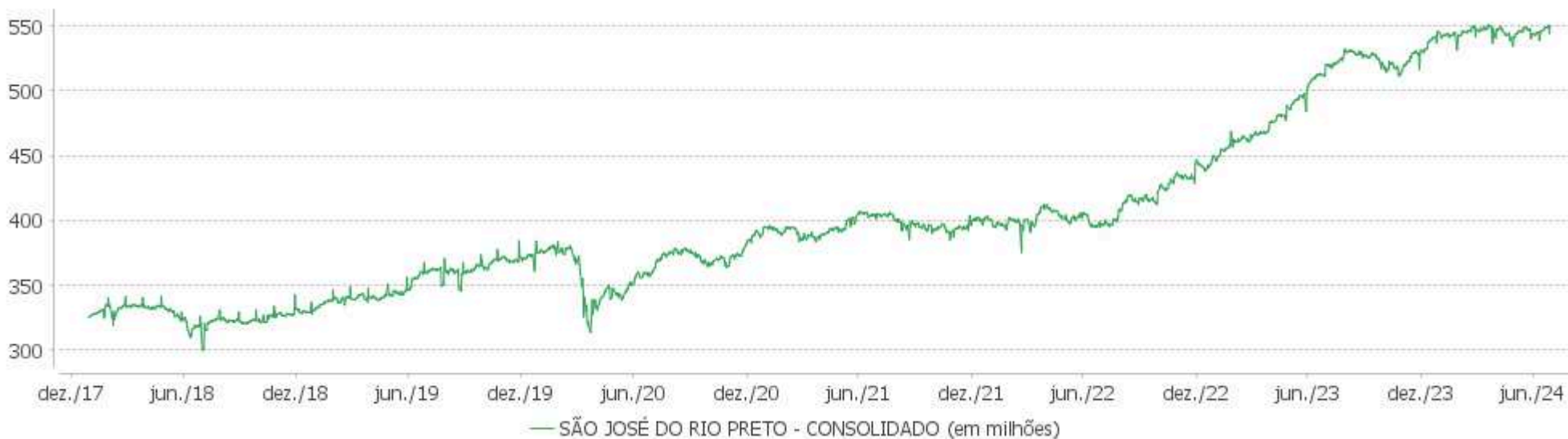
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	1,30	2,30	-1,00	2,47
06 meses	3,70	4,98	-1,29	2,51
12 meses	9,83	9,40	0,44	3,04
24 meses	23,63	18,40	5,23	3,83
36 meses	21,13	39,28	-18,15	4,65
48 meses	35,57	59,40	-23,83	5,04
60 meses	43,62	72,52	-28,90	7,40
Desde 29/12/2017	67,04	99,45	-32,40	6,79

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

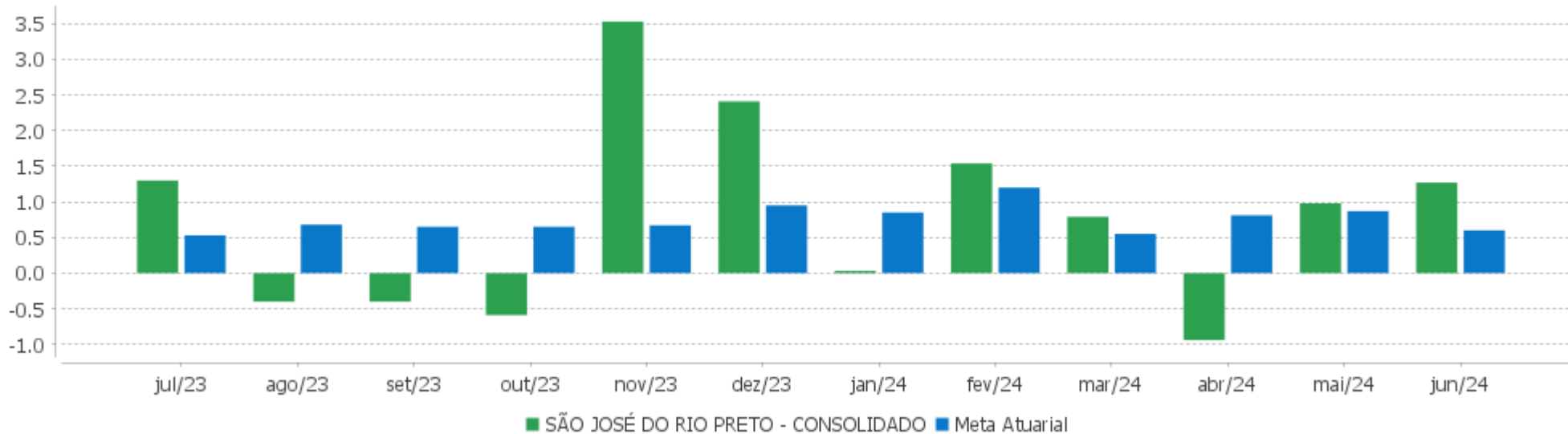


Patrimônio Líquido



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.	1,07 0,86	3,07 2,02	3,07 2,02	7,01 4,53	12,62 8,39		
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,43 -1,11	-0,22 -2,76	-0,22 -2,76	2,16 -3,30	7,39 -3,02	17,81 -2,89	29,57 -13,58
NTN-B 150529 (6,081000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	-0,42 -1,47	-0,42 -1,47	2,72 0,23	4,10 -0,12		
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	2,44 1,38	2,44 1,38	5,57 3,08	10,14 5,91	20,49 12,97	34,58 14,28
NTN-B 150545 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	2,45 1,40	2,45 1,40	5,60 3,11	7,17 2,94	10,87 3,34	
NTN-B 150824 (5,270000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,59	2,34 1,28	2,34 1,28	5,36 2,88	9,53 5,30	19,35 11,82	36,50 16,19
NTN-B 150545 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	2,44 1,38	2,44 1,38	5,57 3,08	10,17 5,95	20,53 13,00	38,48 18,17
NTN-B 150850 (6,351000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	2,60 1,54	2,60 1,54	5,89 3,41	10,90 6,67	22,07 14,55	36,58 16,27
NTN-B 150545 (6,381500%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	-0,46 -1,51	-0,46 -1,51	2,75 0,26	4,16 -0,06		
NTN-B 150535 (4,875000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,56	2,24 1,19	2,24 1,19	5,17 2,68	9,25 5,02	18,59 11,07	39,05 18,74
NTN-B 150826 (6,563000%) Var. IPCA p.p.	0,89 0,68	2,65 1,60	2,65 1,60	6,00 3,51	10,91 6,68	18,75 11,23	
NTN-B 150545 (6,362000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	-0,46 -1,51	-0,46 -1,51	2,74 0,26	4,16 -0,07		
NTN-B 150850 (5,832500%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	2,47 1,42	2,47 1,42	5,64 3,15	10,35 6,12	14,20 6,68	
NTN-B 150840 (6,351500%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	2,60 1,54	2,60 1,54	2,76 0,27	4,18 -0,05		
NTN-B 150535 (4,825000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,55	2,23 1,17	2,23 1,17	5,14 2,66	9,19 4,97	18,48 10,96	38,85 18,54
NTN-B 150535 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	0,86 0,65	2,54 1,48	2,54 1,48	5,77 3,29	10,54 6,31	17,88 10,36	31,86 11,55
NTN-B 150850 (6,352000%)	0,88	2,60	2,60	5,89	10,90	14,88	

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385

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.	0,67	1,54	1,54	3,41	6,67	7,35	
NTN-B 150545 (6,275000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	-0,45 -1,50	-0,45 -1,50	2,73 0,25	4,14 -0,09		
NTN-B 150840 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,59	2,36 1,30	2,36 1,30	5,41 2,92	9,79 5,56	19,73 12,21	37,26 16,96
NTN-B 150840 (5,045000%) Var. IPCA p.p.	0,78 0,57	2,28 1,23	2,28 1,23	5,25 2,77	9,46 5,23	19,02 11,49	36,16 15,85
NTN-B 150840 (6,330000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	2,59 1,54	2,59 1,54	2,75 0,27	4,17 -0,05		
NTN-B 150535 (5,320000%) Var. IPCA p.p.	0,80 0,59	2,35 1,29	2,35 1,29	5,39 2,90	9,71 5,49	19,61 12,08	40,83 20,52
NTN-B 150545 (5,854000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	2,48 1,42	2,48 1,42	5,65 3,17	10,35 6,12	20,90 13,38	39,05 18,74
NTN-B 150545 (6,421000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	2,61 1,56	2,61 1,56	5,93 3,44	10,95 6,72	18,53 11,01	
NTN-B 150850 (6,042000%) Var. IPCA p.p.	0,85 0,64	2,52 1,47	2,52 1,47	5,74 3,26	10,57 6,34	17,87 10,34	31,80 11,50
NTN-B 150555 (6,351000%) Var. IPCA p.p.	0,88 0,67	2,60 1,54	2,60 1,54	5,89 3,41	10,92 6,69	22,09 14,57	36,58 16,27
NTN-B 150824 (7,408000%) Var. IPCA p.p.	0,96 0,75	2,85 1,80	2,85 1,80	6,41 3,93	11,73 7,50	17,03 9,50	
NTN-B 150545 (5,895000%) Var. IPCA p.p.	0,84 0,63	2,49 1,43	2,49 1,43	5,67 3,19	10,39 6,16	21,00 13,47	35,25 14,95
NTN-B 150840 (4,873000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,56	2,24 1,19	2,24 1,19	5,17 2,68	9,28 5,05	18,62 11,10	35,56 15,25
NTN-B 150840 (4,830000%) Var. IPCA p.p.	0,76 0,55	2,23 1,18	2,23 1,18	5,15 2,66	9,23 5,00	18,53 11,00	38,91 18,60
NTN-B 150840 (6,235000%) Var. IPCA p.p.	0,87 0,66	2,57 1,52	2,57 1,52	2,74 0,25	4,14 -0,09		
NTN-B 150850 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,83 0,62	2,45 1,40	2,45 1,40	5,60 3,12	10,27 6,05	20,72 13,19	34,91 14,61
NTN-B 150535 (4,965000%) Var. IPCA p.p.	0,77 0,56	2,26 1,21	2,26 1,21	5,21 2,73	9,34 5,11	18,80 11,28	39,41 19,10
NTN-B 150826 (5,525000%) Var. IPCA p.p.	0,81 0,60	2,40 1,34	2,40 1,34	5,49 3,00	9,83 5,61	19,97 12,44	37,54 17,24
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	-0,08	0,00	0,00	1,56	6,06	15,94	23,58

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,47	-1,24	-1,24	-1,76	-2,17	-3,35	-7,72
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-1,00	-1,35	-1,35	-1,22	2,87	16,57	20,68
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,03	-0,08	-0,08	-0,13	-0,19	-0,43	-0,75
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,37	1,18	1,18	3,21	8,00	18,98	30,69
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,06	-0,06	-0,11	-0,23	-0,31	-0,61
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	0,37	1,18	1,18	3,19	7,97	18,76	30,43
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,02	-0,06	-0,06	-0,13	-0,26	-0,54	-0,87
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	-1,48	-2,51	-2,51	-2,79	1,08	13,59	13,76
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,52	-1,24	-1,24	-1,69	-1,99	-3,42	-7,67
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,17	0,55	0,55	2,36	7,39	23,06	27,65
Var. IPCA p.p.	-0,04	-0,50	-0,50	-0,12	3,17	15,54	7,35
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,38	1,40	1,40	3,84	9,79	25,12	31,72
Var. IPCA p.p.	0,17	0,34	0,34	1,35	5,56	17,60	11,41
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	-0,99	-1,33	-1,33	-1,23	2,76	16,42	20,47
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,02	-0,06	-0,06	-0,13	-0,30	-0,59	-0,95
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,16	2,85	2,85	5,70	11,31	21,59	34,95
Var. INPC + 6,00% p.p.	0,44	0,29	0,29	0,04	1,46	1,70	-7,29
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,78	2,39	2,39	5,00	11,34	26,39	37,56
% do CDI	98,34	94,30	94,30	95,75	96,98	98,42	99,38
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,16	2,85	2,85	5,71	11,31	20,68	31,70
Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,12	4,12	4,12	6,81	8,25	3,68	10,28
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-2,25	-3,61	-3,61	-5,08	-1,41	14,09	11,11
Var. IMA-B 5+ p.p.	0,00	-0,03	-0,03	-0,04	0,02	-0,59	-1,08
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	-1,03	-1,48	-1,48	-1,38	2,47	16,13	19,83
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,06	-0,20	-0,20	-0,29	-0,59	-0,88	-1,59
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	0,36	1,16	1,16	3,15	7,88	18,60	29,83
Var. IMA-B 5 p.p.	-0,03	-0,08	-0,08	-0,17	-0,35	-0,70	-1,47
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	-1,08	-1,50	-1,50	-1,30	2,86	16,46	20,54
Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,12	-0,22	-0,22	-0,20	-0,21	-0,54	-0,88
BB PREV RF FLUXO FIC	0,71	2,27	2,27	4,71	10,59	24,34	33,64
% do CDI	90,20	89,82	89,82	90,16	90,55	90,76	89,02
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,79	2,47	2,47	5,23	12,03	27,30	39,04
% do CDI	100,83	97,59	97,59	100,25	102,93	101,78	103,30
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82	2,57	2,57	5,36	12,19	27,40	39,10
% do CDI	103,84	101,69	101,69	102,72	104,28	102,16	103,45
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,71	2,27	2,27	4,70	10,59	23,51	32,30

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
% do CDI	89,74	89,81	89,81	90,00	90,59	87,67	85,47
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	0,20 -1,28	-5,49 -2,21	-5,49 -2,21	-3,21 4,45	20,35 15,43	79,38 53,64	57,67 59,95
BTG PACTUAL FI DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I Var. IBOVESPA p.p.	-0,71 -2,19	-3,49 -0,22	-3,49 -0,22	-7,84 -0,18	13,72 8,80	46,38 20,64	
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-0,11 -1,59	-7,64 -4,37	-7,64 -4,37	-6,86 0,80	4,76 -0,17	26,67 0,93	7,51 9,79
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	1,13 -0,35	-8,25 -4,97	-8,25 -4,97	-5,60 2,06	9,73 4,80	53,18 27,44	30,30 32,58
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	0,65 -0,83	-4,13 -0,85	-4,13 -0,85	-9,36 -1,70	2,49 -2,44	19,19 -6,55	-8,06 -5,78
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	1,37 -0,11	-5,44 -2,16	-5,44 -2,16	-8,82 -1,16	2,40 -2,53	17,87 -7,87	-7,48 -5,20
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	1,90 0,41	-3,95 -0,67	-3,95 -0,67	-11,11 -3,45	0,53 -4,40	13,12 -12,62	-7,05 -4,76
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA Var. IBOVESPA p.p.	1,44 -0,04	-3,20 0,08	-3,20 0,08	-7,49 0,17	4,86 -0,07	25,30 -0,44	-1,96 0,32
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	2,18 0,70	-6,85 -3,57	-6,85 -3,57	-8,04 -0,38	1,67 -3,26	23,41 -2,33	13,07 15,36
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. SMALL CAP p.p.	-0,04 0,36	-8,16 3,07	-8,16 3,07	-12,82 2,03	-13,42 -1,46	-5,00 -10,47	-34,26 2,03
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	12,73 -0,06	21,34 -0,40	21,34 -0,40	39,52 -1,55	52,18 -2,61	72,57 -4,56	50,01 -5,70
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	9,68 8,20	13,97 17,25	13,97 17,25	29,53 37,19	40,96 36,04	54,12 28,38	37,01 39,29
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	11,90 10,42	15,32 18,60	15,32 18,60	34,25 41,91	48,31 43,39	77,01 51,27	34,33 36,62
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	6,01 -2,26	10,70 -3,24	10,70 -3,24	22,20 -4,47	26,37 -9,11	31,91 -10,72	16,31 -7,49
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	10,57 2,29	15,78 1,84	15,78 1,84	31,47 4,80	46,24 10,77	65,37 22,75	49,33 25,54
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS IS MULTIMERCADO IE - FIF RESP LIMITADA Var. MSCI ACWI p.p.	4,36 -3,91	4,89 -9,05	4,89 -9,05	15,86 -10,81	28,02 -7,46	54,77 12,15	42,28 18,48
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	11,56 10,89	10,28 7,74	10,28 7,74	27,09 21,62	44,10 33,70	81,41 60,71	0,75 -42,41
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,90	5,01	5,01	16,70	29,37	66,02	56,49

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. S&P 500 p.p.	-5,83	-10,61	-10,61	-14,75	-12,16	12,93	15,29
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	3,99 -5,74	5,19 -10,44	5,19 -10,44	17,03 -14,42	30,05 -11,48	74,59 21,50	65,17 23,97
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,65 -1,32	-1,01 -3,55	-1,01 -3,55	1,94 -3,53	3,72 -6,69	-2,88 -23,58	16,11 -27,04
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C Var. IPCA + 7,00% p.p.	1,14 0,39	-0,42 -3,20	-0,42 -3,20	1,79 -4,16			
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 8,00% p.p.	8,69 7,87	3,04 0,02	3,04 0,02	-4,03 -10,47	-16,22 -28,69		
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	-0,71 -1,38	-2,05 -4,59	-2,05 -4,59	4,81 -0,65	4,14 -6,27	-6,29 -27,00	
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,02% p.p.	1,27 0,67	1,30 -1,00	1,30 -1,00	3,70 -1,29	9,83 0,44	23,63 5,13	21,13 -18,11
CDI	0,79	2,53	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79
IBOVESPA	1,48	-3,28	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28
INPC + 6,00%	0,71	2,57	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24
IPCA + 6,00%	0,67	2,54	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15

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 FI DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I	D+1	D+1	D+365	D+367	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa de performance sera paga no(s) mes(es) de Dezembro	2,00
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 IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	D+0	D+0	D+0	D+0		0,20

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	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 BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
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
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	D+1 du	D+0	D+30	D+32		1,90
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	Não se aplica	Não se aplica				2,00
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se aplica	Não se aplica				1,85
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 MULTIESTRATÉGIA CLASSE C						0,08
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS IS MULTIMERCADO IE - FIF RESP LIMITADA	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
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	D+1	D+1	D+90	D+92	O fundo cobrara 20.00 % do que exceder 100.00 % o índice IBOV_FEC. A taxa	2,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	Administração
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	0,63	2,00	2,00	4,51	10,95	26,28	35,36	38,12	46,42
IRF-M 1+	-0,72	-1,14	-1,14	0,22	6,61	26,65	25,36	23,98	38,61
IRF-M TOTAL	-0,29	-0,17	-0,17	1,51	7,89	25,94	28,16	28,34	40,94
IMA-B 5	0,39	1,24	1,24	3,32	8,23	19,30	31,30	39,26	51,54
IMA-B 5+	-2,25	-3,58	-3,58	-5,04	-1,43	14,67	12,20	21,76	24,16
IMA-B TOTAL	-0,97	-1,27	-1,27	-1,10	3,07	17,01	21,42	30,44	36,89
IMA-GERAL TOTAL	0,05	0,77	0,77	2,42	8,23	23,40	29,99	34,60	43,37
IDKA 2	0,18	0,95	0,95	3,21	8,37	18,43	30,40	39,61	51,85
IDKA 20	-5,03	-7,87	-7,87	-12,09	-8,64	12,55	-2,74	9,26	4,14
CDI	0,79	2,53	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

Renda Variável

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	1,48	-3,28	-3,28	-7,66	4,93	25,74	-2,28	30,35	22,72
IBRX 100	1,51	-3,03	-3,03	-7,20	5,59	24,17	-4,44	30,28	24,20
IBRX 50	1,63	-2,15	-2,15	-6,12	7,39	26,37	-2,31	34,31	25,00
SMALL CAP	-0,39	-11,23	-11,23	-14,85	-11,96	5,47	-36,29	-11,04	-6,45
Índice Consumo - ICON	0,69	-7,46	-7,46	-14,03	-15,14	-8,69	-50,90	-42,61	-34,58
Índice Dividendos - IDIV	1,99	0,42	0,42	-3,41	12,09	31,97	26,56	56,67	56,43

### 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	9,73	15,63	15,63	31,45	41,53	53,09	41,20	78,79	169,26

#### Investimentos Imobiliários

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-1,04	-1,78	-1,78	1,08	6,09	19,73	21,51	19,28	27,46

#### Investimentos no Exterior

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	8,28	13,94	13,94	26,67	35,48	42,62	23,79	55,10	122,26

#### Indicadores Econômicos

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,21	1,05	1,05	2,48	4,23	7,52	20,30	30,35	33,12
INPC	0,25	1,08	1,08	2,68	3,70	6,81	19,54	30,56	33,63
IGPM	0,81	2,03	2,03	1,10	2,45	-4,57	5,64	43,41	53,90
SELIC	0,79	2,53	2,53	5,22	11,69	26,82	37,79	40,92	47,43

#### Meta Atuarial

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,52	2,05	2,05	4,48	8,35	16,22	35,24	52,37	61,87
IPCA + 5,00%	0,60	2,29	2,29	4,97	9,38	18,45	39,16	58,28	69,77
IPCA + 5,50%	0,64	2,42	2,42	5,22	9,89	19,57	41,15	61,30	73,84
IPCA + 5,89%	0,67	2,51	2,51	5,41	10,29	20,45	42,71	63,69	77,07
IPCA + 6,00%	0,67	2,54	2,54	5,46	10,40	20,70	43,15	64,37	77,99
INPC + 4,00%	0,56	2,08	2,08	4,68	7,80	15,45	34,38	52,62	62,48
INPC + 6,00%	0,71	2,57	2,57	5,66	9,84	19,90	42,24	64,64	78,66

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Curva x Mercado

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150529 (6,081000%)	2.289.008,58	6,081000	2.250.085,37	6,510000	-38.923,21
NTN-B 150535 (4,825000%)	5.704.920,95	4,825000	5.011.830,57	6,510700	-693.090,38
NTN-B 150535 (4,875000%)	5.758.312,48	4,875000	5.078.599,34	6,510700	-679.713,14
NTN-B 150535 (4,965000%)	5.666.223,92	4,965000	5.032.695,81	6,510700	-633.528,11
NTN-B 150535 (5,320000%)	5.671.786,27	5,320000	5.178.752,49	6,510700	-493.033,78
NTN-B 150535 (6,100000%)	5.445.483,00	6,100000	5.278.905,64	6,510700	-166.577,36
NTN-B 150545 (5,690000%)	5.657.813,69	5,690000	5.161.425,57	6,496800	-496.388,12
NTN-B 150545 (5,750000%)	2.225.967,89	5,750000	2.044.860,73	6,496800	-181.107,16
NTN-B 150545 (5,854000%)	5.538.189,38	5,854000	5.149.107,13	6,496800	-389.082,25
NTN-B 150545 (5,895000%)	21.472.619,67	5,895000	20.058.523,40	6,496800	-1.414.096,27
NTN-B 150545 (6,275000%)	15.070.000,40	6,275000	14.700.002,82	6,496800	-369.997,58
NTN-B 150545 (6,362000%)	12.051.154,72	6,362000	11.870.868,20	6,496800	-180.286,52
NTN-B 150545 (6,381500%)	12.910.778,73	6,381500	12.745.477,31	6,496800	-165.301,42
NTN-B 150545 (6,421000%)	5.408.204,32	6,421000	5.362.626,73	6,496800	-45.577,59
NTN-B 150555 (6,351000%)	10.757.693,12	6,351000	10.580.260,62	6,477700	-177.432,50
NTN-B 150824 (5,270000%)	7.102.179,75	5,270000	7.077.687,39	7,999900	-24.492,36
NTN-B 150824 (7,408000%)	10.613.457,35	7,408000	10.605.588,46	7,999900	-7.868,89
NTN-B 150826 (5,525000%)	11.597.990,29	5,525000	11.379.043,33	6,539400	-218.946,96
NTN-B 150826 (6,563000%)	10.857.221,82	6,563000	10.862.011,57	6,539400	4.789,75
NTN-B 150840 (4,830000%)	11.960.063,48	4,830000	10.197.986,29	6,439600	-1.762.077,19
NTN-B 150840 (4,873000%)	11.897.828,93	4,873000	10.189.547,75	6,439600	-1.708.281,18
NTN-B 150840 (5,045000%)	5.843.374,11	5,045000	5.092.664,24	6,439600	-750.709,87
NTN-B 150840 (5,360000%)	5.848.518,13	5,360000	5.261.435,21	6,439600	-587.082,92
NTN-B 150840 (5,690000%)	1.511.371,89	5,690000	1.405.018,38	6,439600	-106.353,51
NTN-B 150840 (6,235000%)	15.069.867,83	6,235000	14.775.899,05	6,439600	-293.968,78
NTN-B 150840 (6,330000%)	12.054.187,09	6,330000	11.927.888,81	6,439600	-126.298,28
NTN-B 150840 (6,351500%)	12.910.080,47	6,351500	12.801.278,62	6,439600	-108.801,85
NTN-B 150850 (5,760000%)	1.149.547,87	5,760000	1.048.061,43	6,504300	-101.486,44

Assinado por 5 pessoas: PATRICIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (5,832500%)	5.978.642,93	5,832500	5.501.286,85	6,504300	-477.356,08
NTN-B 150850 (6,042000%)	10.931.387,08	6,042000	10.327.340,45	6,504300	-604.046,63
NTN-B 150850 (6,351000%)	10.758.051,23	6,351000	10.559.322,42	6,504300	-198.728,81
NTN-B 150850 (6,352000%)	5.439.558,38	6,352000	5.339.727,97	6,504300	-99.830,41

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
91	01/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	4.873.157,00	1.749.954,52504800	2,7847335060
92	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.477.474,55	287.922,21007800	5,1315060000
93	01/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	965.554,47	188.162,00724800	5,1315060000
94	01/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	947.433,33	0,00	385.799,20008700	2,4557680000
97	02/04/2024	BTG PACTUAL FI DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I	2.116.716,16	0,00	1.544.008,39668100	1,3709227000
98	02/04/2024	TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	4.873.145,50	0,00	2.177.772,65082728	2,2376741200
95	02/04/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	156.942,20	0,00	35.087,16783100	4,4729230000
96	02/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	160.807,20	65.457,73216200	2,4566570000
99	03/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	2.094,40	852,23259100	2,4575450000
100	04/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.713,60	697,02934000	2,4584330000
101	05/04/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	708.733,07	0,00	149.022,61328900	4,7558760000
102	08/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6.526,20	0,00	2.339,34501700	2,7897552310
103	09/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	20.976,42	8.523,18535000	2,4611010000
104	10/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	12.651,33	5.138,65600800	2,4619920000
105	11/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	5.201,98	2.112,15238600	2,4628810000
106	12/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.478,29	0,00	5.898,19183100	2,7937867180
107	12/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	18.600,55	7.549,62307000	2,4637720000
108	15/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.319,63	0,00	829,97548200	2,7948174950
109	15/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	21.780,45	8.837,09051100	2,4646630000
110	16/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	31.055,78	0,00	6.025,19673700	5,1543180000
111	16/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	19.343,26	0,00	3.752,82627100	5,1543180000
112	17/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	14.980,00	6.073,51381800	2,4664470000
113	18/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	14.089,80	0,00	5.035,92160600	2,7978592800
114	19/04/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	167.318,34	0,00	30.240,92853500	5,5328440000
115	19/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	11.603,32	4.701,06723800	2,4682310000
116	22/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	134.978,86	0,00	48.209,05348500	2,7998653830
117	22/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	461,95	187,09047800	2,4691260000
118	23/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	56.359,61	0,00	20.122,05841600	2,8008869090

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
119	23/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	339,75	65,78135400	5,1648370000
120	24/04/2024	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	0,00	4.500.000,00	2.367.544,81183595	1,9007032000
121	25/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	207.838,05	84.083,37733900	2,4718090000
122	26/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.134,09	1.267,47429000	2,4727050000
123	29/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.445.000,00	1.245.830,23919900	5,1732570000
124	29/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	172.063,12	69.559,82703600	2,4735990000
125	30/04/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	90.759,24	32.345,36759600	2,8059424500
126	30/04/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.062.144,15	0,00	784.899,42456200	5,1753690000
127	30/04/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	290,74	0,00	61,95283300	4,6929250000
128	30/04/2024	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	4.500.000,00	0,00	697.041,63124359	6,4558554300
129	30/04/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	716.516,10	0,00	289.560,65361200	2,4744940000
130	02/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.485.956,54	287.000,32731200	5,1775430000
131	02/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	26.790,65	10.822,79516400	2,4753910000
132	03/05/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	279.541,37	0,00	63.057,45025700	4,4331220000
133	03/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	281.254,97	113.579,40126100	2,4762850000
134	06/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	810,72	327,27523200	2,4771810000
135	07/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	2.776,94	1.120,60325900	2,4780760000
136	08/05/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	531.590,20	0,00	112.575,07525700	4,7220950000
137	08/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	630,50	254,33940300	2,4789710000
138	09/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	42.023,13	16.945,71242300	2,4798680000
139	10/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	14.676,51	5.916,17301900	2,4807440000
140	13/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	5.516,71	2.223,02958400	2,4816180000
141	15/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.778,17	1.924,06767600	2,4833690000
142	16/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	41.131,29	0,00	7.912,86274000	5,1980290000
143	16/05/2024	NTN-B 150529 (6,081000%)	2.259.994,51	0,00	530,00000000	4.264,1405910000
144	16/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.302,34	524,23999000	2,4842440000
145	17/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.919,11	0,00	1.745,61722100	2,8179774690
146	17/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.161,10	1.272,01101500	2,4851200000
147	20/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.847,76	0,00	1.010,21130400	2,8189745910
148	20/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	522,20	100,37923800	5,2022700000

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
149	20/05/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	186.788,34	0,00	33.497,98344900	5,5761070000
150	20/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.929,91	776,31225900	2,4859970000
151	21/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	20.384,59	0,00	7.228,78832300	2,8199179570
152	21/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	73,20	29,43453200	2,4868750000
153	22/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	2.796,00	1.123,90634500	2,4877520000
154	23/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.847,82	0,00	2.072,30827100	2,8218871110
155	23/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.446,65	1.621,71670000	5,2084620000
156	24/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	184.701,95	74.192,17924500	2,4895070000
157	27/05/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	3.544,98	0,00	1.255,35625900	2,8238836380
158	27/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.444,93	1.383,29157500	2,4903860000
159	28/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.710.000,00	1.286.713,52297300	5,2148360000
160	28/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	175.614,17	70.491,99548300	2,4912640000
161	29/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.730.327,29	0,00	715.049,33503300	5,2168810000
162	29/05/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	712.355,49	0,00	285.840,53563500	2,4921430000
163	31/05/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	416.358,39	0,00	79.778,97062100	5,2188990000
164	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.518.871,18	290.917,59688400	5,2209670000
165	03/06/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	243.378,57	0,00	54.512,30263300	4,4646540000
166	03/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	275.120,90	110.317,44766800	2,4939020000
167	05/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	14.953,46	5.991,78563700	2,4956600000
168	06/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.367,42	1.749,38853200	2,4965410000
169	07/06/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	1.737.230,24	0,00	367.887,65179400	4,7221760000
170	07/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	2.851,39	1.141,73430300	2,4974200000
171	10/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	179.609,37	63.401,45572400	2,8328903170
172	10/06/2024	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA	208.333,31	0,00	208.333,31000000	1,0000000000
173	10/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	24.527,23	4.688,24335400	5,2316460000
174	10/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	12.651,33	5.063,97524000	2,4983000000
175	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,00	17.862.780,43	5.818.491,46309900	3,0700020000
176	11/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	32.034.938,22	0,00	6.120.804,53148600	5,2337790000
177	11/06/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,00	15.901.636,66	3.369.663,32329900	4,7190580000
178	11/06/2024	WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	0,00	5.467.562,66	1.313.754,99212000	4,1617826000

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
184	12/06/2024	NTN-B 150545 (6,275000%)	14.997.428,53	0,00	3.580,00000000	4.189,2258463687
185	12/06/2024	NTN-B 150840 (6,235000%)	14.997.568,97	0,00	3.502,00000000	4.282,5725214163
179	12/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	400.592,95	0,00	141.307,07392900	2,8349108000
180	12/06/2024	BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	0,00	15.536.720,44	1.993.119,73543500	7,7951766589
181	12/06/2024	BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	0,00	24.945.239,01	4.114.655,18346520	6,0625345000
182	12/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	28.053.370,61	0,00	5.358.079,26292300	5,2357140000
183	12/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	13.089.684,21	2.500.076,24456700	5,2357140061
190	13/06/2024	NTN-B 150545 (6,362000%)	11.998.094,76	0,00	2.891,00000000	4.150,1538429609
191	13/06/2024	NTN-B 150840 (6,330000%)	12.001.268,19	0,00	2.827,00000000	4.245,2310541210
186	13/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	380.426,88	134.147,53932600	2,8358841460
187	13/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.366.656,48	0,00	451.814,44626200	5,2381160000
188	13/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	23.616.899,42	4.508.662,92764800	5,2381160000
189	13/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.511,88	604,52419300	2,5009420000
196	14/06/2024	NTN-B 150545 (6,381500%)	12.859.668,73	0,00	3.104,00000000	4.142,9345135309
197	14/06/2024	NTN-B 150840 (6,351500%)	12.859.111,72	0,00	3.034,00000000	4.238,3360975610
192	14/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	168.483,15	0,00	59.389,80868300	2,8369033970
193	14/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	25.718.780,44	4.907.824,21713500	5,2403630000
194	14/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	879,37	167,80700200	5,2403630000
195	14/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	7.987,72	3.192,75871800	2,5018240000
198	17/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	2.085,76	833,40161400	2,5027070000
199	19/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.522,41	0,00	536,07357400	2,8399273390
200	20/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.557,69	487,26450400	5,2490780000
201	20/06/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	193.106,55	0,00	34.346,42971100	5,6223180000
203	20/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	178.683,00	62.896,19002100	2,8409192980
202	20/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.609,35	642,36407700	2,5053550000
204	20/06/2024	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	178.683,00	0,00	178.683,00000000	1,0000000000
205	21/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	2.699,44	0,00	949,86774000	2,8419114410
206	21/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	16.537,79	6.598,64884500	2,5062390000
207	24/06/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	14.589,71	0,00	5.131,92619600	2,8429305960
208	24/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	198.056,81	78.997,67587000	2,5071220000

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
209	26/06/2024	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.000.000,00	0,00	1.169.434,17161400	4,2755720000
210	26/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	240.483,84	45.741,50140600	5,2574540000
211	26/06/2024	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	0,00	5.000.000,00	1.057.048,26131200	4,7301530000
212	26/06/2024	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	243.090,22	0,00	243,09022000	1.000,0000000000
213	27/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.750.000,00	1.283.390,24950500	5,2595070000
214	27/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	229.047,36	91.262,07336900	2,5097760000
215	28/06/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.316.597,95	0,00	820.393,32943000	5,2616200000
216	28/06/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	720.849,25	0,00	287.115,43976400	2,5106600000
<b>Total</b>			<b>182.323.285,12</b>	<b>185.145.521,76</b>		

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco

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

Value-At-Risk (R\$): 6.366.115,11

Value-At-Risk: 1,16%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,88	0,28	5,00	0,10	-0,32	0,51	387.992.415,03	70,59
Artigo 8º	13,47	6,53	15,00	0,68	-0,00	0,75	69.786.800,94	12,70
Artigo 9º	12,49	5,38	15,00	0,16	0,74	9,98	44.032.613,44	8,01
Artigo 10º	5,00	3,36	15,00	0,22	0,41	2,82	47.834.105,35	8,70
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	2,47	1,16		1,16	-0,50	1,30	549.645.934,76	100,00

Renda Fixa

Value-At-Risk: 0,28%

Artigo 7º I, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150824 (5,270000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,04	0,80	7.102.179,75	1,29
NTN-B 150824 (7,408000%)	0,17	0,09	0,00	0,12	0,99	0,96	10.613.457,35	1,93
NTN-B 150826 (5,525000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,16	0,81	11.597.990,29	2,11
NTN-B 150826 (6,563000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,62	0,89	10.857.221,82	1,98
NTN-B 150529 (6,081000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,40	0,86	2.289.008,58	0,42
NTN-B 150535 (4,825000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	-0,16	0,76	5.704.920,95	1,04
NTN-B 150535 (4,875000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	-0,14	0,77	5.758.312,48	1,05
NTN-B 150535 (4,965000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	-0,09	0,77	5.666.223,92	1,03
NTN-B 150535 (5,320000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,06	0,80	5.671.786,27	1,03
NTN-B 150535 (6,100000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,41	0,86	5.445.483,00	0,99
NTN-B 150840 (4,830000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	-0,16	0,76	11.960.063,48	2,18
NTN-B 150840 (4,873000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	-0,14	0,77	11.897.828,93	2,16
NTN-B 150840 (5,045000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	-0,06	0,78	5.843.374,11	1,06
NTN-B 150840 (5,360000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,08	0,80	5.848.518,13	1,06
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,17	0,08	0,00	0,12	0,23	0,83	1.511.371,89	0,27
NTN-B 150840 (6,235000%)	0,17	0,22	-0,00	0,27	0,47	0,87	15.069.867,83	2,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150840 (6,330000%)	0,17	0,22	-0,00	0,27	0,51	0,88	12.054.187,09	2,19
NTN-B 150840 (6,351500%)	0,17	0,22	-0,00	0,27	0,52	0,88	12.910.080,47	2,35
NTN-B 150545 (5,690000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,23	0,83	5.657.813,69	1,03
NTN-B 150545 (5,750000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,26	0,83	2.225.967,89	0,40
NTN-B 150545 (5,854000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,30	0,84	5.538.189,38	1,01
NTN-B 150545 (5,895000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,32	0,84	21.472.619,67	3,91
NTN-B 150545 (6,275000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,49	0,87	15.070.000,40	2,74
NTN-B 150545 (6,362000%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,53	0,88	12.051.154,72	2,19
NTN-B 150545 (6,381500%)	0,17	0,22	-0,00	0,25	0,54	0,88	12.910.778,73	2,35
NTN-B 150545 (6,421000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,55	0,88	5.408.204,32	0,98
NTN-B 150850 (5,760000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,26	0,83	1.149.547,87	0,21
NTN-B 150850 (5,832500%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,29	0,84	5.978.642,93	1,09
NTN-B 150850 (6,042000%)	0,17	0,08	-0,00	0,12	0,39	0,85	10.931.387,08	1,99
NTN-B 150850 (6,351000%)	0,17	0,07	-0,00	0,12	0,52	0,88	10.758.051,23	1,96
NTN-B 150850 (6,352000%)	0,17	0,07	-0,00	0,12	0,52	0,88	5.439.558,38	0,99
NTN-B 150555 (6,351000%)	0,17	0,07	-0,00	0,12	0,52	0,88	10.757.693,12	1,96
<b>Sub-total</b>	0,17	0,07	-0,00		0,31	0,84	273.151.485,75	49,70

Artigo 7º I, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	1,00	0,42	0,01	0,42	-0,41	0,38	13.988.019,76	2,54
BB PREV RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS FI	3,99	NaN	0,00	NaN	-0,44	-0,99	0,00	0,00
BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	1,01	0,31	0,00	0,33	0,36	1,16	596.395,27	0,11
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	1,01	0,31	0,00	2,17	0,36	1,16	1.033.434,36	0,19
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,71	0,91	0,00	0,01	-0,24	0,37	4.991.639,72	0,91
FI CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6,32	NaN	0,00	NaN	-0,48	-2,25	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,00	2,15	0,01	0,02	-0,45	-1,00	4.228.831,28	0,77
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,07	0,00	0,07	-0,13	0,78	5.884.995,30	1,07
FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	1,85	0,72	0,01	0,72	-0,33	0,17	10.944.597,93	1,99
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,71	0,91	0,01	0,00	-0,24	0,37	10.068.285,77	1,83

Assinado por 5 pessoas: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI, WILCLEM DE LAZARI ARAUJO, FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES, ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO e JAIR MORETTI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385> e informe o código A22A-156D-0334-7385



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RF	5,23	NaN	0,00	NaN	-0,43	-1,48	0,00	0,00
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	3,04	1,56	0,02	0,73	-0,29	-0,08	11.022.290,72	2,01
<b>Sub-total</b>	2,34	0,82	0,05		-0,45	-0,27	62.758.490,11	11,42

Artigo 7º III, Alínea a

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF FLUXO FIC	0,01	0,01	0,00	0,01	-5,87	0,71	29.241,16	0,01
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,77	0,91	0,01	0,02	-0,24	0,36	8.615.195,86	1,57
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B	4,11	NaN	0,00	NaN	-0,44	-1,03	0,00	0,00
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,08	0,05	0,00	0,05	0,09	0,79	1.219.098,01	0,22
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,81	0,82	10.856.969,02	1,98
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	0,01	0,00	0,00	-119,43	0,71	1.061.243,06	0,19
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP	4,23	2,18	0,04	0,09	-0,44	-1,08	20.956.507,28	3,81
<b>Sub-total</b>	2,66	1,23	0,05		-0,49	-0,51	42.738.254,39	7,78

Artigo 7º IV

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,46% a.a	3,79	0,25	-0,00	0,27	0,07	1,07	6.262.380,36	1,14
<b>Sub-total</b>	3,79	0,25	-0,00		0,07	1,07	6.262.380,36	1,14

Artigo 7º V, Alínea b

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,36	1,71	0,00	1,70	-0,36	-0,43	3.081.804,42	0,56
<b>Sub-total</b>	3,36	1,71	0,00		-0,36	-0,43	3.081.804,42	0,56

Renda Variável

Value-At-Risk: 6,53%

Artigo 8º I

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA	12,19	6,68	0,18	1,79	-0,01	0,65	18.851.231,58	3,43
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	10,61	5,88	0,02	1,60	0,10	1,90	2.157.725,62	0,39
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	17,77	8,77	0,14	3,20	-0,05	-0,04	11.035.123,30	2,01
BTG PACTUAL FI DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I	14,43	5,65	0,01	2,36	-0,10	-0,71	2.050.457,82	0,37
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	12,04	5,94	0,04	1,06	0,05	1,44	4.641.427,29	0,84
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	12,62	6,45	0,13	1,40	0,05	1,37	14.206.626,91	2,58
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	18,07	7,60	0,05	3,95	-0,05	-0,11	4.908.050,21	0,89
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	13,70	6,97	0,04	3,43	0,02	1,13	4.458.835,27	0,81
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	18,57	7,14	0,03	5,46	-0,03	0,20	4.615.547,44	0,84
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	14,85	6,50	0,02	3,23	0,09	2,18	2.861.775,50	0,52
<b>Sub-total</b>	<b>13,47</b>	<b>6,53</b>	<b>0,68</b>		<b>-0,00</b>	<b>0,75</b>	<b>69.786.800,94</b>	<b>12,70</b>

Investimentos Estruturados

Value-At-Risk: 3,36%

Artigo 10º I

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6,25	4,80	0,17	4,84	0,51	3,99	26.212.066,20	4,77
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,22	4,79	0,05	4,84	0,50	3,90	7.277.998,60	1,32
<b>Sub-total</b>	<b>6,24</b>	<b>4,80</b>	<b>0,22</b>		<b>0,51</b>	<b>3,97</b>	<b>33.490.064,80</b>	<b>6,09</b>

Artigo 10º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTISTRATÉGIA	29,59	0,07	-0,00	0,14	0,27	8,69	466.892,97	0,08
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	2,31	0,10	0,00	0,13	-0,62	-0,65	11.687.302,87	2,13
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	2,53	0,25	0,00	0,29	-0,59	-0,71	1.228.678,86	0,22
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	4,02	0,15	-0,00	0,19	0,09	1,14	961.165,85	0,17
<b>Sub-total</b>	<b>2,10</b>	<b>0,08</b>	<b>0,00</b>		<b>-0,31</b>	<b>0,14</b>	<b>14.344.040,55</b>	<b>2,61</b>

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Investimentos no Exterior

Value-At-Risk: 5,38%

Artigo 9º II

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	13,80	5,91	-0,00	5,98	0,38	6,01	2.942.190,74	0,54
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	12,88	6,13	-0,00	5,58	0,76	10,57	930.766,59	0,17
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	9,60	7,45	0,02	7,45	1,12	11,56	7.720.375,22	1,40
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS IS MULTIMERCADO IE - FIF RESP LIMITADA	7,01	5,06	0,05	4,56	0,51	4,36	8.155.540,97	1,48
<b>Sub-total</b>	<b>7,76</b>	<b>4,96</b>	<b>0,07</b>		<b>0,88</b>	<b>7,61</b>	<b>19.748.873,52</b>	<b>3,59</b>

Artigo 9º III

Ativo	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	BVaR <sup>(4)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	13,26	7,06	0,02	9,41	0,67	9,68	3.059.904,08	0,56
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17,32	6,46	0,03	0,94	0,69	12,73	8.529.231,63	1,55
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	16,73	6,99	0,04	10,37	0,66	11,90	12.694.604,21	2,31
<b>Sub-total</b>	<b>16,34</b>	<b>6,67</b>	<b>0,09</b>		<b>0,68</b>	<b>11,91</b>	<b>24.283.739,92</b>	<b>4,42</b>

(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: A22A-156D-0334-7385

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

- ✓ **PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI** (CPF 326.XXX.XXX-02) em 27/09/2024 10:53:34 (GMT-03:00)  
Papel: Parte  
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
  
- ✓ **WILCLEM DE LAZARI ARAUJO** (CPF 352.XXX.XXX-01) em 27/09/2024 11:08:05 (GMT-03:00)  
Papel: Parte  
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
  
- ✓ **FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES** (CPF 169.XXX.XXX-39) em 27/09/2024 12:22:43 (GMT-03:00)  
Papel: Parte  
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)
  
- ✓ **ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO** (CPF 327.XXX.XXX-48) em 27/09/2024 13:58:17 (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)
  
- ✓ **JAIR MORETTI** (CPF 275.XXX.XXX-04) em 27/09/2024 14:37:10 (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)

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

<https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/A22A-156D-0334-7385>