

# INVESTIMENTOS

## TRANSPARÊNCIA EM NÚMEROS: RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS – 3º TRI/2024

### Resumo

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

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

Versão 1.0 – outubro 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**

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  
Mário José Piccarelli de Castro  
Patrícia Nato Toninato Bartolomei  
Wilclem de Lazari Araújo

**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 Hernandez 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.....	6
MENSAGEM DOS MEMBROS DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS.....	7
ANÁLISE DO MERCADO FINANCEIRO E EXPECTATIVAS DE MERCADO .....	8
MERCADOS INTERNACIONAIS.....	8
CENÁRIO DOMÉSTICO.....	9
PRINCIPAIS INDICADORES ECONÔMICOS.....	10
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 TERCEIRO 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> .....	17
DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DA CARTEIRA E COMENTÁRIOS SOBRE A PERFORMANCE DOS FUNDOS E RESPECTIVOS SEGMENTOS .....	18
RENDA FIXA: .....	18
RENDA VARIÁVEL: .....	19
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR: .....	19
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS:.....	20
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA.....	20
PRINCIPAIS INDICADORES DOS INVESTIMENTOS DA RIOPRETOPREV NO ANO .....	20
RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL no 3º TRIMESTRE:.....	21
RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL no 2º TRIMESTRE:.....	21
RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL no 1º TRIMESTRE:.....	21

**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

RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL ANUAL: .....	22
PERFORMANCE NOS ÚLTIMOS PERÍODOS: .....	22
DO ANEXO I – DEMONSTRAÇÕES FINANCEIRAS DOS INVESTIMENTOS DETALHADAS.....	23

## APRESENTAÇÃO

Com entusiasmo, apresentamos o **"TRANSPARÊNCIA EM NÚMEROS: RELATÓRIO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS – 3º TRI/2024"** da RIOPRETOPREV, uma análise minuciosa do desempenho dos investimentos ao longo do terceiro trimestre do ano de 2024. Este documento gerencial não apenas presta contas de maneira transparente aos colegas, segurados e beneficiários, mas também destaca as estratégias, a gestão de riscos eficiente e o compromisso contínuo com a responsabilidade previdenciária.

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

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

## MENSAGEM DOS MEMBROS DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Ao analisarmos o desempenho do terceiro trimestre de 2024, temos o prazer de compartilhar nossas reflexões sobre os investimentos da Riopretoprev. Embora o período tenha registrado resultados positivos, seguimos em um ambiente de desafios relevantes, com os principais *benchmarks* locais – que concentram a maior parte dos ativos dos RPPS – apresentando rendimentos abaixo da meta atuarial e, em alguns casos, retornos negativos. O mercado continua marcado pela volatilidade, mas, ao mesmo tempo, oferece oportunidades estratégicas para alocações. Nossa estratégia, alicerçada na busca por resiliência e solidez, tem sido crucial para a construção de uma carteira diversificada, permitindo navegar por cenários adversos e capturar valor ao longo do tempo.

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 terceiro 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 3º 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 expectativa do início do ciclo de redução dos juros americanos, o qual se concretizou em setembro. Além disso, houve depreciação do dólar frente às demais moedas. Já, como contraponto, as tensões geopolíticas aumentaram.

Nos EUA, a inflação mostrou uma tendência positiva. Além disso, a atividade econômica começou a apresentar sinais de desaceleração, reforçada pela redução no número de vagas criadas, o que resultou no aumento da expectativa de cortes de juros. Diante desse cenário e em acordo com as expectativas de mercado, em setembro, o FED iniciou o ciclo de redução de juros com um corte de 0,50%.

No terceiro trimestre, na Zona do Euro, a inflação de núcleo continuou resiliente, mas a deterioração dos indicadores qualitativos de atividade e a perspectiva de desaceleração dos salários sugerem novos cortes da taxa básica pelo Banco Central Europeu.

Na China, no terceiro trimestre persistiu um cenário de cautela. Onde, o setor imobiliário apresentou deterioração e a indústria começou a perder força. Diante desse cenário, com o intuito de impulsionar o crescimento econômico, no fim do período, o governo anunciou um pacote de estímulos monetários e fiscais, contando com um programa de recapitalização de bancos e introduziu ações para reequilibrar o mercado imobiliário.

O cenário eleitoral Norte-Americano foi marcado por reviravoltas na corrida presidencial nos EUA, com o atentado contra o candidato Donald Trump e a desistência do atual presidente Joe Biden em favor de sua vice, Kamala Harris.

Por fim, o agravamento do conflito no Oriente Médio levanta um ponto de atenção. Onde, a depender das estratégias utilizadas nesse confronto, há o risco de aumento de pressão sobre os preços do petróleo e fretes, o que consequentemente pode acabar gerando o risco de elevação da inflação e reduzindo o crescimento global.

Olhando para o mercado acionário americano, os principais índices apresentaram retornos positivos no período. Onde, no 3º trimestre de 2024 o MSCI ACWI e o S&P 500 respectivamente renderam +6,21% e +5,53%. Assim, no acumulado dos últimos 12 meses obtiveram retorno de +29,68% e +34,38%, todos em “moeda original”, ou seja, considerando apenas a performance dos índices estrangeiros, sem considerar a variação cambial.

<sup>1</sup> Texto extraído e adaptado do Relatório Macroeconômico do 3º trimestre de 2024 da LDB Consultoria – 15.10.2024.

Considerando esses mesmos índices, mas, agora sem proteção cambial, devido a desvalorização do Dólar frente ao Real, o MSCI ACWI e o S&P 500 apresentaram rendimentos positivos, respectivamente, de +4,09% e +3,43% no 3º trimestre de 2024, enquanto, no acumulado dos últimos 12 meses apresentaram retornos positivos de +41,09% e +46,21%.

**O Comitê de Investimentos da RIOPRETOPREV**, em uma análise resumida, conclui que para o cenário internacional do terceiro trimestre de 2024, apesar do cenário geopolítico ainda tenso, as reações positivas de desempenho da economia americana, deixando de lado a ideia de recessão, com inflação convergindo para a meta e o início de corte de juros pelo Federal Reserve (FED – Banco Central Americano) mantiveram o otimismo nos mercados encerrando o período com ganhos. 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

Localmente, seguindo na direção oposta dos juros americanos, ao longo do trimestre as curvas de juros apresentaram alta devido às inseguranças em relação à condução da política fiscal, além de refletir o aumento da probabilidade do Banco Central iniciar um novo ciclo de elevação da taxa Selic, o que se concretizou em setembro.

A economia local continuou forte, com o PIB em crescimento e um mercado de trabalho aquecido. Esse cenário indica cada vez mais a necessidade de uma política econômica mais restritiva.

Além disso, a inflação segue dentro dos parâmetros esperados, entretanto, alguns de seus núcleos apresentam pressão devido a alteração de bandeira tarifárias do setor de energia e as queimadas ocorridas no fim do período. Além disso, o câmbio, por sua vez, é um ponto de atenção. Onde, na performance anual apresenta um nível relativamente depreciado.

No terceiro trimestre, houve a adoção de um discurso cada vez mais conservador por parte do Copom devido a preocupação com nível do câmbio e à desancoragem das expectativas de inflação. Por fim, em setembro, houve o início do ciclo de aperto monetário com a elevação da taxa selic em 0,25%, ficando assim em 10,75%. Além disso, a comunicação destacou a assimetria no balanço de riscos associados à inflação, com ênfase no impacto da taxa de câmbio depreciada e do desequilíbrio fiscal.

Em relação à política fiscal, o anúncio de alterações no programa auxílio-gás, que seria ampliado, mas não seria contabilizado dentro das estatísticas fiscais do governo federal, contribuiu para elevar as dúvidas em relação ao arcabouço atual e o compromisso com a consolidação fiscal. O envio do projeto do orçamento para 2025, com receitas incertas e despesas subestimadas, reforçaram as inseguranças em relação à condução da política fiscal. Adicionalmente, no fim do período, foi promovida uma liberação de despesas do orçamento para 2024, em movimento oposto ao que era esperado pelo mercado.

Na renda variável, os índices Ibovespa e SMLL seguiram o movimento observado nos índices internacionais, fechando o trimestre em território positivo. Respectivamente, apresentando um retorno de +6,38% e +1,39% no 3º trimestre de 2024, e de +13,08% e -3,75% no acumulado dos últimos 12 meses.

Em sua análise, o **Comitê de Investimentos** conclui que a bolsa brasileira mantém um nível elevado de volatilidade, mesmo após um desempenho positivo no terceiro trimestre. Esse período foi predominantemente caracterizado pela alteração nas expectativas em relação à taxa Selic, que passou de um cenário de manutenção para um ciclo de alta, com o objetivo de convergir a inflação para a meta estabelecida. Ademais, as questões fiscais continuam a suscitar preocupações, provocando flutuações na curva de juros, com os ativos de mais longo prazo, avaliados a mercado, apresentando desvalorização.

## PRINCIPAIS INDICADORES ECONÔMICOS

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

Indicadores	2024			Acumulado Trimestre	Acumulado 12 Meses
	Julho	Agosto	Setembro		
<b>Índices Financeiros</b>					
<b>Renda Fixa</b>					
IMA-S	0.94%	0.90%	0.87%	2.73%	11.25%
CDI	0.91%	0.87%	0.83%	2.63%	11.06%
IRF-M 1	0.94%	0.77%	0.82%	2.55%	10.28%
IMA-GERAL	1.36%	0.79%	0.34%	2.51%	8.98%
IRF-M	1.34%	0.66%	0.34%	2.36%	8.45%
IMA-B5	0.91%	0.59%	0.40%	1.92%	8.43%
IDkA IPCA 2A	0.75%	0.60%	0.39%	1.75%	8.05%
IRF-M 1+	1.55%	0.60%	0.11%	2.27%	7.67%
IMA-B	2.09%	0.52%	-0.67%	1.94%	5.61%
IMA-B5+	3.24%	0.77%	-1.42%	2.55%	3.64%
IDkA IPCA 20A	6.19%	0.42%	-3.07%	3.35%	0.20%
<b>Renda Variável</b>					
IDIV	1.89%	6.69%	-0.72%	7.93%	19.48%
IBRX - 50	3.15%	6.51%	-3.26%	6.28%	14.18%
IBrX - 100	2.90%	6.60%	-2.97%	6.43%	13.53%
Ibovespa	3.02%	6.54%	-3.08%	6.38%	13.08%
IVBX-2	4.28%	5.09%	-4.07%	5.13%	9.71%
ISE	2.83%	5.99%	-2.62%	6.13%	8.67%
IFIX	0.52%	0.86%	-2.58%	-1.24%	2.69%
SMLL	1.49%	4.51%	-4.41%	1.39%	-3.75%
<b>Investimentos no Exterior</b>					
Global BDRX	0.29%	0.55%	-0.21%	0.63%	52.98%
S&P 500	3.01%	2.18%	-1.73%	3.43%	46.21%
MSCI ACWI	3.40%	2.29%	-1.59%	4.09%	41.09%
S&P 500 (M. Orig.)	1.13%	2.28%	2.02%	5.53%	34.38%
MSCI ACWI (M.Orig.)	1.51%	2.40%	2.17%	6.21%	29.68%
<b>Índices Econômicos</b>					
SELIC	0.91%	0.87%	0.83%	2.63%	11.05%
DÓLAR	1.86%	-0.10%	-3.68%	-1.99%	8.80%
IGP-M	0.61%	0.29%	0.62%	1.52%	4.53%
IPCA	0.38%	-0.02%	0.44%	0.80%	4.42%
INPC	0.26%	-0.14%	0.48%	0.60%	4.09%
<b>Meta Atuarial</b>					
IPCA + 6% a.a.	0.92%	0.49%	0.93%	2.35%	10.66%
INPC + 6% a.a.	0.79%	0.37%	0.97%	2.15%	10.31%
IPCA + 5% a.a.	0.83%	0.41%	0.85%	2.10%	9.62%
INPC + 5% a.a.	0.71%	0.29%	0.89%	1.89%	9.27%
IPCA + 4% a.a.	0.74%	0.32%	0.77%	1.84%	8.58%
INPC + 4% a.a.	0.62%	0.20%	0.81%	1.64%	8.24%

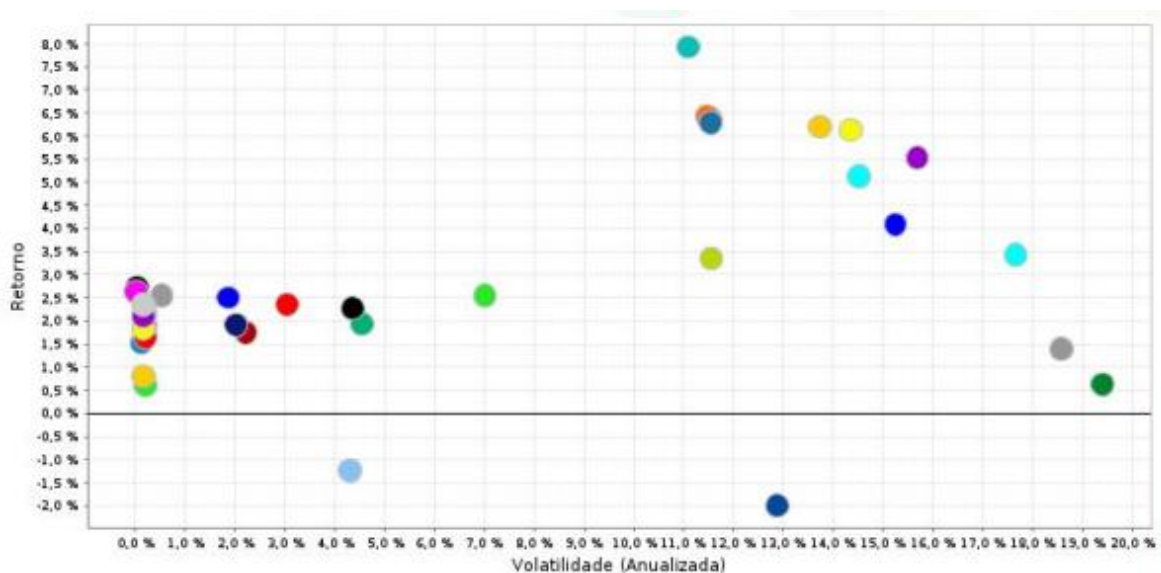
RIOPRETOPREV – Regime Próprio de Previdência Social do Município de São José do Rio Preto

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

Em síntese, ao analisar a tabela, observa-se que, na maioria das vezes, os indicadores financeiros, tanto nacionais quanto internacionais, no terceiro trimestre de 2024, superaram as metas de rentabilidade estabelecidas para o período ou estiveram muito próximas dessas metas. No entanto, ao considerar o ano como um todo, apenas o CDI e os índices internacionais conseguiram atingir os objetivos estipulados. Nesse contexto, enfatiza-se a importância da diversificação da carteira, uma estratégia que reduz o risco e potencializa o retorno, especialmente quando associada a um horizonte de longo prazo para os investimentos.

Prosseguindo na análise, direcionamos agora nossa atenção ao gráfico de dispersão que ilustra o comportamento dos principais indicadores ao longo do 3º trimestre de 2024. Destaca-se imediatamente que nem todos os indicadores superaram o indicador da meta atuarial. Um enfoque especial é dedicado à volatilidade, cujas flutuações significativas do ano se refletem no gráfico e na tabela a seguir:

**Gráfico de Retorno x Volatilidade (no 3º trimestre):**



**Tabela de Retorno x Volatilidade (no 3º trimestre)**

Ativo	Retorno	Volatilidade (Anualizada)
IDIV	7,93%	11,09%
IBX	6,43%	11,47%
Ibovespa	6,38%	11,53%
IBX-50	6,28%	11,54%
MSCI ACWI (Moeda Original)	6,21%	13,74%
ISE	6,13%	14,35%
S&P 500 (Moeda Original)	5,53%	15,69%
IVBX-2	5,13%	14,52%
MSCI ACWI	4,09%	15,25%
S&P 500	3,43%	17,66%
IDkA IPCA 20 Anos	3,35%	11,55%
IMA-5	2,73%	0,03%
CDI	2,63%	0,00%
Selic	2,63%	0,00%
IMA-B 5+	2,55%	7,01%
IRF-M 1	2,55%	0,52%
IMA Geral	2,51%	1,86%
IRF-M	2,36%	3,04%
IPCA + 6,00%	2,35%	0,15%
IRF-M 1+	2,27%	4,35%
INPC + 6,00%	2,15%	0,19%
IPCA + 5,00%	2,10%	0,15%
IMA-B	1,94%	4,54%
IMA-B 5	1,92%	2,01%
INPC + 5,00%	1,89%	0,19%
IPCA + 4,00%	1,84%	0,15%
IDkA IPCA 2 Anos	1,75%	2,21%
INPC + 4,00%	1,64%	0,19%
IGP-M	1,52%	0,11%
SMLL	1,39%	18,58%
IPCA	0,80%	0,15%
Global BDRX	0,63%	19,40%
INPC	0,60%	0,19%
IFIX	-1,24%	4,30%
Dólar	-1,99%	12,87%

Em conclusão, ao analisar o gráfico de dispersão, ressalta-se que, apesar da robusta diversificação da carteira da RIOPRETOPREV e da consecução da meta atuarial no trimestre, os principais índices de renda fixa locais, que correspondem à maior parte dos recursos alocados pelo RPPS, como os índices Anbima IMA-B, apresentaram desempenho inferior às metas estabelecidas. Esse fato explica o motivo pelo qual o desempenho da carteira ao longo do ano ficou próximo do atingimento da meta atuarial, considerando que uma parte da carteira de renda fixa está alocada nesses índices. Além disso, no segmento de renda variável, os principais indicadores como o Ibovespa, permanecem no campo negativo.

## 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.

Com base no estudo de Asset Liability Management (ALM) elaborado pela LDB Consultoria Financeira em 17/05/2024, 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:

**ALOCAÇÃO EM (NTN-Bs) IMA-B = 67,84% = R\$ 363.628.212,64**

NTN-B	15/08/2024	15/08/2026	15/05/2035	15/08/2050	15/05/2055
ALOCAÇÃO (%)	4,84%	6,13%	7,93%	9,32%	3,00%
ALOCAÇÃO (R\$)	17.597.905,17	22.298.840,51	28.824.005,14	33.904.526,88	10.914.448,04
ATUAL RIO PRETO PREV	17.395.753,84	22.067.275,67	28.564.549,45	33.659.353,93	10.892.601,64
DIFERENÇA	<b>202.151,33</b>	<b>231.564,84</b>	<b>259.455,69</b>	<b>245.172,95</b>	<b>21.846,40</b>
PU's NTNBS em 16/05/2024	4.300,72	4.327,60	4.251,75	4.285,79	4.228,05
QUANTIDADES de NTNBS	<b>47</b>	<b>54</b>	<b>61</b>	<b>57</b>	<b>5</b>

**LIÇÃO DE CASA FEITA!**

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 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. Movimento que continuou no terceiro trimestre com novas alocações no segmento no mês 08/2024.

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 terceiro trimestre de 2024, que registrou uma rentabilidade de 2,94%, e meta atuarial de 2,1%, alcançando um cumprimento de meta de 140,00%, reforçamos à abordagem estratégica adotada na gestão de ativos da Riopretoprev. Fato que também se evidencia ao olharmos para o desempenho anual que acumula rentabilidade de 6,75%, e meta atuarial de 7,19%, atingimento de 93,88%, diante de um cenário de alta volatilidade e mudanças de cenário. 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 no trimestre — sendo 2,23% em Renda Fixa, 5,28% em Renda Variável, 3,15% em Investimentos no Exterior e 4,42% em Investimentos Estruturados — refletem a eficácia da estratégia de alocação de recursos

**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

diversificada, evidenciando a capacidade do Comitê de Investimentos em aproveitar as oportunidades de mercado.

Este desempenho, 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 TERCEIRO 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 terceiro 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 6,6%, sendo atribuído ao fundo FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA. Os dois seguintes, com 6,41% e 3,75% do PL, são, respectivamente, BB PREV AÇÕES ALOCAÇÃO FIA e WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF.

No que diz respeito aos limites em relação ao PL da Riopretoprev, o maior percentual é do fundo FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP, representando 5,35% do PL. Os fundos BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO e FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RF REF IMA-B LP ocupam o 2º e 3º lugares, com 4,99% e 3,83% do PL, respectivamente.

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

- ✓ Renda Fixa: 50,21% do PL (Limite 100%);
- ✓ Renda Variável: 12,14% do PL (Limite 50%, Art. 8, § 3º);
- ✓ Investimentos no Exterior: 9,08% do PL (Limite 10%);
- ✓ Investimentos Estruturados: 9,44% do PL (Limite 20%, Art. 10, § 2º).

Adicionalmente, a análise de Artigos específicos, como o Art. 14 (que representa 21,58% 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.

**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

## 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.

Em virtude da alteração no cenário macroeconômico, com a manutenção da taxa Selic, o Comitê de Investimentos realizou uma reunião extraordinária em 02/08/2024. Durante este encontro, os membros apresentaram uma proposta para revisar a Política de Investimentos do ano vigente, ajustando a tabela de alocação de ativos. Esta proposta foi aprovada pelo Conselho Municipal de Previdência em 08/08/2024.

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 => 50,21% do PL (Objetivo: 48,35%; Limite entre 0% e 100%);
- ✓ Art. 7º, I, b => 6,75% do PL (Objetivo: 7%; Limite entre 0% e 70%);
- ✓ Art. 7º, III, a => 11,23% do PL (Objetivo: 12%; Limite entre 0% e 60%);
- ✓ Art. 7º, IV => 1,15% do PL (Objetivo: 1,4%; Limite entre 0% e 10%);
- ✓ Art. 7º, V, b => 0% do PL (Objetivo: 0%; Limite entre 0% e 5%).

### ***Renda Variável:***

- ✓ Art. 8º, I => 12,14% do PL (Objetivo: 11%; Limite entre 0% e 30%).

### ***Investimentos no Exterior:***

- ✓ Art. 9º, II => 3,72% do PL (Objetivo: 4%; Limite entre 0% e 10%);
- ✓ Art. 9º, III => 5,36% do PL (Objetivo: 6%; Limite entre 0% e 10%).

### ***Investimentos Estruturados:***

- ✓ Art. 10º, I => 6,37% do PL (Objetivo: 7,5%; Limite entre 0% e 15%);
- ✓ Art. 10º, II => 3,06% do PL (Objetivo: 3%; 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\$ 29,05 mi; 5,19% do PL):***

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

### ***Caixa (R\$ 117,21 mi; 20,96% do PL):***

- ✓ 12 fundos: 3 RV, 1 Multimercado Bolsa Americana, 1 Invest. Exterior, 07 RF.
- ✓ Notáveis: fundos DI vinculados a contas, múltiplos IMAs e estratégias alinhadas ao cenário econômico.

### ***Bradesco (R\$ 8,77 mi; 1,57% do PL):***

- ✓ 01 fundo: 1 RF IMA-B5.

### ***XP Investimentos (R\$ 12,66 mi; 2,27% do PL):***

- ✓ 03 fundos: RV dividendos, Invest. Exterior e FIP Pátria Investimentos.
- ✓ Custódia das NTN-Bs (R\$ 280,798 mi; 50,21% do PL)
- ✓ Custódia LF BTG Pactual (R\$ 6,43 mi; 1,15% do PL)

### ***Santander (R\$ 18,88 mi; 3,38% do PL):***

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

### ***Western Asset (R\$ 24,15 mi; 4,32% do PL):***

- ✓ 02 fundos: IMA-B5 ATIVO e Invest. Exterior Ações BDR.

### ***Kinea/Lions (R\$ 11,75 mi; 2,1% do PL):***

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

### ***Kinea/Intrag (R\$ 2,78 mi; 0,5% do PL):***

- ✓ 01 fundo: FIP em captação inicial.

### ***BTG Pactual (R\$ 31,82 mi; 5,69% do PL):***

- ✓ 04 fundos: RV de ações valor, Multimercado S&P 500 e FIP Economia Real em captação inicial e FIP Infraestrutura também em fase de captação de recursos

**Banco Daycoval (R\$ 14,42 mi; 2,58% do PL):**

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

**Vinci (R\$ 0,41 mi; 0,08% do PL):**

- ✓ 01 fundo: FIP em captação inicial

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

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

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

### **RENDA FIXA:**

Ao final do terceiro trimestre, 69,34% dos recursos (R\$ 387,76 milhões) foram alocados em Renda Fixa, conforme a Resolução n.º 4.963/2021 (art. 7º). O segmento registrou uma valorização de 2,23% no 3º trimestre e 5,48% no ano. No Brasil, as curvas de juros tiveram alta, impulsionadas pela elevação da taxa Selic e pelo aumento das incertezas fiscais. Durante o 3º trimestre foram feitas alterações de estratégia no segmento, com o desinvestimento dos fundos de renda fixa alocação ativa e de crédito privado com realocação em fundos de benchmark CDI. Também ocorreu o vencimento dos fundos de títulos públicos e NTN-Bs com vértice 2024 e houve pagamento de cupom de NTN-Bs de vencimento par, sendo que os recursos foram realocados em NTN-B com vencimento em 2026, com remuneração acima da meta atuarial e marcação na curva, diminuindo a volatilidade dos ativos da carteira e em linha com a sugestão trazida pelo estudo de Asset Liability Management-ALM 2024. O segmento de Títulos públicos federais valorizou-se em 2,19% no 3º trimestre e 7,93% no ano, superando a meta atuarial. Os fundos 100% títulos públicos, apresentaram valorização média de 1,82% no trimestre e rentabilidade média de 2,36% no ano. Fundos de renda fixa geral alcançaram rendimento médio de 3,04% no trimestre e 3,74% no ano. Destaque para ativos emitidos por instituições financeiras, como a Letra Financeira Subordinada do Banco BTG Pactual SA, com rendimento de 2,73% no trimestre e 9,93% no ano. O fundo de renda fixa de crédito privado, BB Prev CP IPCA III, apresentou rendimento de 3,50% no trimestre e 5,74% no ano, tendo seu resgate total cotizado e liquidado em 13/09/2024 para alocação dos recursos em fundo de benchmark CDI,

que tende a capturar melhores resultados em período de elevação da taxa Selic e com reduzido risco. O FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP foi o fundo que se destacou, rendendo 2,73% no trimestre e 8,24% no ano. Em sua maioria, 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, fato pelo qual o Comitê de Investimentos tem acompanhado os fundos de benchmark IMA-B que diante do cenário de alta volatilidade e elevação da taxa Selic não entregam o resultado esperado. No geral, a Renda Fixa performou no 3º trimestre de 2024 com valorização de R\$ 8.570.602,07, rendimento médio de 2,23%, acima da meta atuarial trimestral de 2,1%, e o ano de 2024 com valorização de R\$ 20.773.956,32, rendimento médio de 5,48%, abaixo da meta atuarial de 7,19%.

### **RENDA VARIÁVEL:**

No trimestre, 12,14% (R\$ 67,87 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\$ 67,87 milhões (12,14% do PL) se valorizaram em média 5,28% no 3º trimestre, seguindo o principal índice do setor, o Ibovespa, que se valorizou 6,38% no período. Entretanto, no ano, o segmento acumula desvalorização de -4,7%. 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.

O segmento segue com elevado nível de volatilidade, impactado pelos riscos fiscais e início de ciclo de elevação de juros.

No trimestre, houve mudança de estratégia dentro do segmento, tendo sido feito o desinvestimento total do fundo Bradesco FIA Mid Small Caps, que além de não estar performando bem, as mudanças recentes de cenário macroeconômico também não trazem boas perspectivas para o setor. Cerca de 51,4% dos recursos resgatados do fundo foram realocados em outros fundos pertencentes a carteira no mesmo segmento, mas em "ações valor" (Tarpon, Guepardo, BTG Oportunidades Listadas) e o restante, seguindo indicação do estudo de ALM, foram alocados em Investimentos no Exterior BDR.

No trimestre todos os fundos do segmento tiveram valorização e fecharam acima da meta do período, contudo, no ano apenas os fundos TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES, XP DIVIDENDOS FI DE ACOES e GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA, estão em campo positivo, porém abaixo da meta. Os membros continuam monitorando os fundos de renda variável no sentido de buscar melhores opções, diversificar e otimizar o segmento minimizando os riscos. No geral, a Renda Variável se valorizou R\$ 3.746.051,52 no trimestre e o ano com desvalorização de R\$ -3.605.037,17, que corresponde a -4,7%.

### **INVESTIMENTOS NO EXTERIOR:**

No trimestre, 9,08% (R\$ 50,8 milhões) dos recursos foram destinados a Investimentos no Exterior, seguindo a Resolução n.º 4.963/2021 (art. 9º). Nesse 3º trimestre, o segmento teve valorização de 3,15%. Nos fundos de Investimento no Exterior GLOBAL (Art. 9º, II), ficaram 3,72% do PL da Riopretoprev, R\$ 20,81 milhões, com rentabilidade média de 5,38% no trimestre e 28,23% no ano. Os fundos BDR (Art. 9º, III) somam R\$ 29,99 milhões (5,36% do

PL), com desempenho médio de 1,55% no trimestre e 37,53% no ano. Em agosto, o fundo Caixa Institucional BDR recebeu R\$ 5,276 milhões, parte do resgate do Bradesco FIA Mid Small Caps, conforme detalhado na estratégia de RV.

A redução dos juros no mundo em virtude da acomodação dos dados de inflação e início do ciclo de redução dos juros americanos, concretizado em setembro, traz boas perspectivas para o segmento, apesar das tensões geopolíticas que tem aumentado e das eleições americanas que podem trazer volatilidade aos ativos.

Os fundos fecharam o trimestre com rentabilidades mistas, sendo alguns acima da meta atuarial e outros abaixo, porém todos em campo positivo. Já no ano, todos os fundos estão entregando bem acima da meta atuarial. O destaque do trimestre foi o fundo MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA IE com 6,73% e, no ano, o fundo FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I com 40,56% de rentabilidade. No geral, os Investimentos no Exterior fecharam o trimestre com valorização de R\$ 1.494.775,09 e o ano com valorização de R\$ 11.350.442,49, rentabilidade de 32,95%.

### **INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS:**

No trimestre, 9,44% (R\$ 52,78 milhões) dos recursos foram alocados em Investimentos Estruturados. Em fundos Multimercados (art. 10º, I), ficaram 6,37% do PL da Riopretoprev, R\$ 35,64 milhões, com valorização média de 6,41% no trimestre e 24,03% no ano, representados por fundos de benchmark S&P-500. Não foram feitas movimentações na estratégia.

Em fundos de participação (art. 10º, II), ficaram 3,06% do PL, R\$ 17,14 milhões, aplicados em FIP Kinea IV, FIP Kinea V, FIP BTG Pactual Economia Real II, PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP ME CLASSE C e VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP ME. Valorizaram-se 0,33% no trimestre e 2,91% no ano, apesar de, em sua maioria, estarem em período de integralização de capital.

Foram feitas integralizações nos FIP's Kinea V, BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III, BTG Economia Real II, Pátria PE VII e VCP IV, que juntas somam cerca de R\$ 2,76 mi.

No geral, o segmento de Investimentos Estruturados teve valorização no trimestre de R\$ 2.183.267,90, média de 4,42% e o ano com valorização de 17,12%, R\$ 7.333.660,01.

### **DISPONIBILIDADE FINANCEIRA**

No fechamento do 3º 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 no trimestre tenha superado a meta atuarial, no ano esse percentual ficou muito próximo do cumprimento do objetivo, 93,88%.

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 valorizou apenas 0,82% no ano. 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 3º TRIMESTRE:**

- ✓ RENDIMENTO no 3º tri-2024 (em R\$): R\$ 15.994.696,58
- ✓ RENDIMENTO no 3º tri-2024 (em %): 2,94%
- ✓ META ATUARIAL no 3º tri-2024 (%): 2,1%
- ✓ RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL (%) NO 3º tri-2024: 140,00%

#### **RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL no 2º TRIMESTRE:**

- ✓ RENDIMENTO no 2º sem-2024 (em R\$): R\$ 7.110.841,55
- ✓ RENDIMENTO no 2º sem-2024 (em %): 1,30%
- ✓ META ATUARIAL no 2º sem-2024 (%): 2,30%
- ✓ RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL (%) NO 2º sem-2024: 56,52%

#### **RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL no 1º TRIMESTRE:**

- ✓ RENDIMENTO no 1º tri-2024 (em R\$): R\$ 12.747.483,52
- ✓ RENDIMENTO no 1º tri-2024 (em %): 2,36%
- ✓ META ATUARIAL no 1º tri-2024 (%): 2,63%
- ✓ RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL (%) NO 1º tri-2024: 89,73%

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

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

## **RAZÃO: RENDIMENTO FINANCEIRO x META ATUARIAL ANUAL:**

- ✓ RENDIMENTO ano (em R\$): R\$ 35.853.021,65
- ✓ RENDIMENTO ano (em %): 6,75%
- ✓ META ATUARIAL ano (%): 7,19%
- ✓ META GERENCIAL (IMA-B) (%): 0,82%
- ✓ CDI (%): 7,99%
- ✓ IBOVESPA (%): -1,77%
- ✓ IBX-50 (%): -0,22%
- ✓ IRF M1 (%): 7,18%
- ✓ S&P 500 (%): 35,95%
- ✓ MSCI ACWI (%): 31,85%

## **PERFORMANCE NOS ÚLTIMOS PERÍODOS:**

- ✓ NOS ÚLTIMOS 3 MESES: 140,00%
- ✓ NOS ÚLTIMOS 6 MESES: 96,18%
- ✓ NOS ÚLTIMOS 12 MESES: 129,64%
- ✓ DO ANO EM CURSO: 93,88%
- ✓ DESDE O INÍCIO DA ADMINISTRAÇÃO DA CARTEIRA: 62,24%
- ✓ DESDE O INÍCIO DA RIOPRETOPREV: 86,62%

Com base nos resultados apresentados, o desempenho do portfólio de investimentos ao final do terceiro 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 6,75% superou significativamente a meta gerencial (IMA-B) de 0,82%, 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 35,95% e 31,85%, 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 93,88%.

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 terceiro 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)*

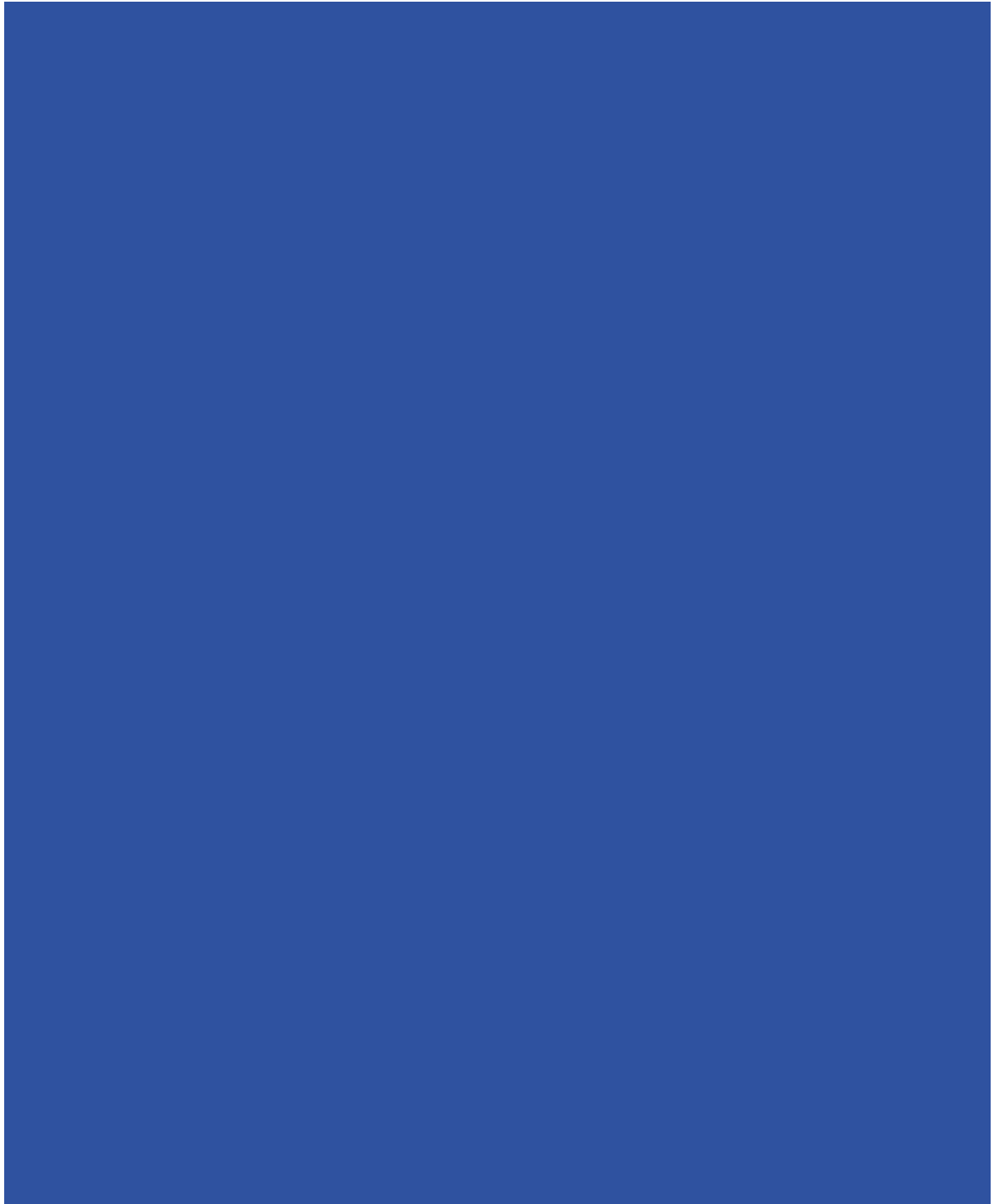
**ADRIANO ANTONIO PAZIANOTO**  
Diretor Executivo

*(assinatura digital)*

**PATRÍCIA NATO TONINATO  
BARTOLOMEI**  
Coordenadora do Comitê de Investimentos

*(assinatura digital)*

**FABIANO LUIS MEDEIROS SANCHES**  
Presidente do Conselho Fiscal





# SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO

3º TRIMESTRE 2024

Prezados Senhores,

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

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

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

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 30.09.2024.

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**

**69,34%**

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 150826 (5,525000%)	0,26	0,04	0,64	2,09	11.502.987,36	2,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,320000%)	4,15	0,05	0,71	0,98	20.194.913,27	3,61
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,563000%)	0,27	0,05	0,73	2,35	10.790.129,40	1,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150826 (6,670000%)	4,18	0,05	0,73	0,94	3.463.896,48	0,62
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150529 (6,081000%)	4,14	0,05	0,69	2,23	2.340.009,38	0,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,825000%)	0,37	0,04	0,59	1,91	5.813.863,31	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,875000%)	0,37	0,04	0,59	1,92	5.869.004,35	1,05
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (4,965000%)	0,37	0,04	0,60	1,95	5.776.443,84	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,320000%)	0,39	0,04	0,63	2,04	5.787.226,44	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,100000%)	0,42	0,05	0,69	2,23	5.567.071,35	1,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,830000%)	0,42	0,04	0,59	1,91	11.877.781,47	2,12
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (4,873000%)	0,42	0,04	0,59	1,92	11.815.896,35	2,11
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,045000%)	0,43	0,04	0,61	1,97	5.802.966,18	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,360000%)	0,45	0,04	0,63	2,05	5.807.684,57	1,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,690000%)	0,46	0,04	0,66	2,13	1.500.682,25	0,27

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Trim.		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,235000%)	2,98	0,05	0,70	2,27	14.960.355,50	2,68
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,330000%)	3,01	0,05	0,71	2,29	11.966.102,01	2,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,351500%)	3,02	0,05	0,71	2,30	12.815.618,44	2,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,690000%)	0,52	0,04	0,66	2,13	5.778.276,85	1,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,750000%)	2,88	0,04	0,66	2,14	2.273.700,40	0,41
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,854000%)	0,53	0,04	0,67	2,17	5.658.407,94	1,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,895000%)	0,53	0,04	0,67	2,18	21.940.941,09	3,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,275000%)	4,24	0,05	0,70	2,28	15.413.120,86	2,76
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,362000%)	4,28	0,05	0,71	2,30	12.328.182,29	2,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,381500%)	4,29	0,05	0,71	2,30	13.208.204,87	2,36
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,421000%)	0,56	0,05	0,71	2,31	5.533.328,66	0,99
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,760000%)	0,58	0,04	0,66	2,15	1.141.654,57	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,832500%)	0,58	0,04	0,67	2,17	5.937.104,25	1,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,042000%)	0,59	0,05	0,68	2,22	10.852.786,09	1,94
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,351000%)	0,60	0,05	0,71	2,30	10.676.663,19	1,91
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,352000%)	0,61	0,05	0,71	2,30	5.398.397,00	0,97
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,351000%)	0,64	0,05	0,71	2,30	11.004.695,23	1,97
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,43</b>	<b>0,04</b>	<b>0,68</b>	<b>2,19</b>	<b>280.798.095,24</b>	<b>50,21</b>

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21



**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.				
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,76	-0,08	0,38	1,87	5.084.792,16	0,91	6.913.810.528,18	0,07
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,92	-0,25	-0,69	1,88	4.308.197,00	0,77	3.720.203.081,78	0,12
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,10	0,04	0,83	2,64	6.893.716,06	1,23	11.229.374.861,63	0,06
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	1,76	-0,08	0,38	1,86	10.255.873,27	1,83	1.002.000.548,73	1,02
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,92	-0,13	0,11	1,39	11.175.961,41	2,00	297.648.327,50	3,75
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>2,51</b>	<b>-0,09</b>	<b>0,26</b>	<b>1,82</b>	<b>37.718.539,90</b>	<b>6,75</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	0,04	0,04	0,57	2,16	17.016,14	0,00	3.861.447.255,05	0,00
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	1,78	-0,08	0,38	1,84	8.773.856,74	1,57	721.455.054,23	1,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,10	0,04	0,85	2,70	1.757.623,52	0,31	5.910.577.806,47	0,03
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06	0,04	0,86	2,73	29.912.635,18	5,35	19.144.855.193,98	0,16
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,04	0,04	0,75	2,36	940.245,85	0,17	1.178.841.947,20	0,08
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	4,03	-0,23	-0,64	2,14	21.404.928,44	3,83	1.021.358.141,89	2,10
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>2,49</b>	<b>-0,08</b>	<b>0,28</b>	<b>3,04</b>	<b>62.806.305,87</b>	<b>11,23</b>		

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

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Trim.				
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,46% a.a	3,52	0,66	0,66	2,73	6.433.520,38	1,15		
<b>Sub-total Artigo 7º IV</b>			<b>3,52</b>	<b>0,66</b>	<b>0,66</b>	<b>2,73</b>	<b>6.433.520,38</b>	<b>1,15</b>		

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

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	2,49	0,00	0,40	3,50	0,00	0,00	233.440.994,18	0,00
		<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea b</b>	<b>2,49</b>	<b>0,00</b>	<b>0,40</b>	<b>3,50</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>		
		<b>Renda Fixa</b>	<b>1,16</b>	<b>0,02</b>	<b>0,57</b>	<b>2,23</b>	<b>387.756.461,39</b>	<b>69,34</b>		



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL

12,14%

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	12,34	-0,55	-2,49	4,82	19.759.165,89	3,53	308.317.813,44	6,41
BB	BB	BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,56	-0,83	-3,14	3,89	2.241.644,09	0,40	1.096.030.531,90	0,20
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL FI DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I	11,73	-0,02	-5,21	2,44	3.032.352,64	0,54	141.134.173,84	2,15
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	12,45	-0,66	-2,53	6,29	4.933.460,52	0,88	74.751.858,15	6,60
CAIXA DTVM	CEF	FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	13,07	-0,68	-3,17	5,99	15.057.438,41	2,69	752.918.243,94	2,00
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,64	-0,59	-3,05	6,95	5.248.924,20	0,94	697.390.245,29	0,75
GUEPARDO	DAYCOVAL	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	14,56	-0,61	-4,07	5,02	7.536.579,76	1,35	666.388.549,62	1,13
TARPON	DAYCOVAL	TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	15,79	-0,37	-0,10	6,11	6.878.657,51	1,23	605.294.623,31	1,14
XP	SANTANDER	XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	14,01	-0,46	-3,04	11,19	3.182.053,90	0,57	353.385.906,82	0,90
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>13,44</b>	<b>-0,56</b>	<b>-2,80</b>	<b>5,28</b>	<b>67.870.276,92</b>	<b>12,14</b>		
<b>Renda Variável</b>			<b>13,44</b>	<b>-0,56</b>	<b>-2,80</b>	<b>5,28</b>	<b>67.870.276,92</b>	<b>12,14</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

9,08%

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	15,23	-0,22	-3,12	2,18	3.006.245,82	0,54	337.371.667,65	0,89
BB	BB	BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	14,78	-0,49	-1,94	0,97	939.751,63	0,17	1.631.637.236,28	0,06
XP	BNP PARIBAS	MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	19,22	-0,38	2,42	6,73	8.239.715,72	1,47	777.550.512,55	1,06
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS IS MULTIMERCADO IE - FIF RESP LIMITADA	12,28	-0,02	1,42	5,75	8.624.830,93	1,54	497.568.118,27	1,73
<b>Sub-total Artigo 9º II</b>			<b>12,65</b>	<b>-0,21</b>	<b>0,97</b>	<b>5,38</b>	<b>20.810.544,10</b>	<b>3,72</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	15,47	0,57	0,09	0,80	3.084.479,47	0,55	891.054.322,04	0,35
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	15,68	0,53	-0,32	0,75	13.934.661,00	2,49	2.640.148.103,06	0,53
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	16,27	0,58	-1,17	2,20	12.973.806,12	2,32	1.754.837.062,13	0,74
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>15,72</b>	<b>0,56</b>	<b>-0,65</b>	<b>1,55</b>	<b>29.992.946,59</b>	<b>5,36</b>		

Investimentos no Exterior

13,04 0,24 0,01 3,15 50.803.490,69 9,08

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

9,44%

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	12,47	0,39	2,38	6,44	27.900.096,09	4,99	827.774.885,87	3,37
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	12,47	0,39	2,33	6,32	7.737.694,25	1,38	2.032.300.517,82	0,38
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>12,36</b>	<b>0,39</b>	<b>2,37</b>	<b>6,41</b>	<b>35.637.790,34</b>	<b>6,37</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	66,68	-0,87	-0,87	7,07	830.872,63	0,15	178.524.624,70	0,47
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATÉGIA	42,77	-12,74	-12,74	-31,73	59.734,02	0,01	19.022.758,37	0,31
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	3,31	0,03	0,03	0,58	11.754.803,74	2,10	374.978.205,07	3,13
KINEA	INTRAG	KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	28,28	0,41	0,41	7,61	2.778.592,04	0,50	303.422.250,53	0,92
PÁTRIA	XP	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	14,86	-0,32	-0,32	-1,97	1.241.922,57	0,22	206.987.094,90	0,60
VINCI	BTG PACTUAL	VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	56,07	14,57	14,57	14,57	472.079,44	0,08	72.892.065,31	0,65
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>5,12</b>	<b>0,32</b>	<b>0,21</b>	<b>0,33</b>	<b>17.138.004,44</b>	<b>3,06</b>		
<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>8,70</b>	<b>0,36</b>	<b>1,68</b>	<b>4,42</b>	<b>52.775.794,78</b>	<b>9,44</b>		
<b>Total</b>			<b>2,96</b>	<b>0,00</b>	<b>0,20</b>	<b>2,94</b>	<b>559.206.023,78</b>	<b>100,00</b>		



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS

Ativo	Valor (R\$)
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	0,00
<b>Sub-total Disponibilidades Financeiras</b>	<b>0,00</b>
<b>Total</b>	<b>559.206.023,78</b>

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	280.798.095,24	50,21	0,00	48,35	100,00	42,53	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	37.718.539,90	6,75	0,00	7,00	70,00	10,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	62.806.305,87	11,23	0,00	12,00	60,00	18,82	80,00
Artigo 7º IV	Ativos de Renda Fixa (Inst. Financeira)	6.433.520,38	1,15	0,00	1,15	10,00	1,14	20,00
Artigo 7º V, Alínea b	FI RF - Crédito Privado	0,00	0,00	0,00	0,00	5,00	0,57	20,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>387.756.461,39</b>	<b>69,34</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	67.870.276,92	12,14	0,00	11,00	30,00	1,94	50,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>67.870.276,92</b>	<b>12,14</b>					50,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º II	Fundos de Investimento no Exterior	20.810.544,10	3,72	0,00	4,00	10,00	5,00	10,00
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	29.992.946,59	5,36	0,00	6,00	10,00	5,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>50.803.490,69</b>	<b>9,08</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	35.637.790,34	6,37	0,00	7,50	15,00	12,44	15,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	17.138.004,44	3,06	0,00	3,00	8,00	2,56	15,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>52.775.794,78</b>	<b>9,44</b>					20,00
<b>Total</b>		<b>559.206.023,78</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	0,68 81,03	2,19 83,23	2,19 83,23	4,71 90,05	10,51 95,04	1.885.520,03	5.995.538,48
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,26 30,90	1,82 69,06	1,82 69,06	1,54 29,48	6,58 59,51	95.652,83	1.111.728,86
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,28 33,17	3,04 115,55	3,04 115,55	2,68 51,25	7,95 71,92	172.887,46	1.184.383,40
Artigo 7º IV % do CDI	0,66 78,89	2,73 103,85	2,73 103,85	5,89 112,68	13,00 117,62	42.061,98	171.140,02
Artigo 7º V, Alínea b % do CDI	0,40 47,72	3,50 132,94	3,50 132,94	3,27 62,58	8,55 77,37	12.646,87	107.811,31
Artigo 8º I Var. IBOVESPA p.p.	-2,80 0,28	5,28 -1,10	5,28 -1,10	-0,44 -3,34	7,70 -5,39	-1.955.927,74	3.746.051,52
Artigo 9º II % do CDI	0,97 116,38	5,38 204,28	5,38 204,28	14,11 269,85	42,19 381,61	200.111,18	1.061.670,58
Artigo 9º III % do CDI	-0,65 -78,02	1,55 58,88	1,55 58,88	19,00 363,49	51,18 462,95	-196.501,36	433.104,51
Artigo 10º I % do CDI	2,37 283,99	6,41 243,69	6,41 243,69	11,89 227,48	40,13 363,01	824.789,60	2.147.725,54
Artigo 10º II % do CDI	0,21 25,59	0,33 12,44	0,33 12,44	-0,15 -2,82	3,46 31,31	31.305,18	35.542,36
<b>SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO (Total)</b>						<b>1.112.546,03</b>	<b>15.994.696,58</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%)	2.324.021,82	0,00	0,00	0,00	2.340.009,38	15.987,56	51.000,80
NTN-B 150535 (4,825000%)	5.779.875,09	0,00	0,00	0,00	5.813.863,31	33.988,22	108.942,36
NTN-B 150535 (4,875000%)	5.834.464,68	0,00	0,00	0,00	5.869.004,35	34.539,67	110.691,87
NTN-B 150535 (4,965000%)	5.742.037,74	0,00	0,00	0,00	5.776.443,84	34.406,10	110.219,92
NTN-B 150535 (5,320000%)	5.751.139,73	0,00	0,00	0,00	5.787.226,44	36.086,71	115.440,17

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
NTN-B 150535 (6,100000%)	5.528.952,72	0,00	0,00	0,00	5.567.071,35	38.118,63	121.588,35
NTN-B 150545 (5,690000%)	5.740.568,27	0,00	0,00	0,00	5.778.276,85	37.708,58	120.463,16
NTN-B 150545 (5,750000%)	2.258.754,48	0,00	0,00	0,00	2.273.700,40	14.945,92	47.732,51
NTN-B 150545 (5,854000%)	5.620.750,98	0,00	0,00	0,00	5.658.407,94	37.656,96	120.218,56
NTN-B 150545 (5,895000%)	21.794.232,75	0,00	0,00	0,00	21.940.941,09	146.708,34	468.321,42
NTN-B 150545 (6,275000%)	15.305.487,76	0,00	0,00	0,00	15.413.120,86	107.633,10	343.120,46
NTN-B 150545 (6,362000%)	12.241.268,77	0,00	0,00	0,00	12.328.182,29	86.913,52	277.027,57
NTN-B 150545 (6,381500%)	13.114.875,55	0,00	0,00	0,00	13.208.204,87	93.329,32	297.426,14
NTN-B 150545 (6,421000%)	5.494.061,90	0,00	0,00	0,00	5.533.328,66	39.266,76	125.124,34
NTN-B 150555 (6,351000%)	10.927.190,20	0,00	0,00	0,00	11.004.695,23	77.505,03	247.002,11
NTN-B 150826 (5,525000%)	11.429.413,43	0,00	0,00	0,00	11.502.987,36	73.573,93	239.126,79
NTN-B 150826 (6,320000%)	20.053.186,94	0,00	0,00	0,00	20.194.913,27	141.726,33	196.302,55
NTN-B 150826 (6,563000%)	10.712.368,56	0,00	0,00	0,00	10.790.129,40	77.760,84	251.855,38
NTN-B 150826 (6,670000%)	3.438.643,84	0,00	0,00	0,00	3.463.896,48	25.252,64	32.370,93
NTN-B 150840 (4,830000%)	11.808.296,74	0,00	0,00	0,00	11.877.781,47	69.484,73	226.076,73
NTN-B 150840 (4,873000%)	11.746.371,77	0,00	0,00	0,00	11.815.896,35	69.524,58	226.171,00
NTN-B 150840 (5,045000%)	5.768.036,33	0,00	0,00	0,00	5.802.966,18	34.929,85	113.580,07
NTN-B 150840 (5,360000%)	5.771.287,25	0,00	0,00	0,00	5.807.684,57	36.397,32	118.257,60
NTN-B 150840 (5,690000%)	1.490.888,77	0,00	0,00	0,00	1.500.682,25	9.793,48	31.794,21
NTN-B 150840 (6,235000%)	14.856.351,62	0,00	0,00	0,00	14.960.355,50	104.003,88	337.269,75
NTN-B 150840 (6,330000%)	11.882.029,23	0,00	0,00	0,00	11.966.102,01	84.072,78	272.581,09
NTN-B 150840 (6,351500%)	12.725.362,67	0,00	0,00	0,00	12.815.618,44	90.255,77	292.613,02
NTN-B 150850 (5,760000%)	1.134.141,10	0,00	0,00	0,00	1.141.654,57	7.513,47	24.384,22
NTN-B 150850 (5,832500%)	5.897.698,70	0,00	0,00	0,00	5.937.104,25	39.405,55	127.886,39
NTN-B 150850 (6,042000%)	10.778.968,91	0,00	0,00	0,00	10.852.786,09	73.817,18	239.453,76
NTN-B 150850 (6,351000%)	10.601.471,96	0,00	0,00	0,00	10.676.663,19	75.191,23	243.811,14
NTN-B 150850 (6,352000%)	5.360.374,95	0,00	0,00	0,00	5.398.397,00	38.022,05	123.288,10
	278.912.575,21	0,00	0,00	0,00	280.798.095,24	1.885.520,03	

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21



**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\$)
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5.065.448,55	0,00	0,00	0,00	5.084.792,16	19.343,61	93.152,44
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4.338.044,06	0,00	0,00	0,00	4.308.197,00	-29.847,06	79.365,72
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	6.346.604,53	492.134,50	0,00	0,00	6.893.716,06	54.977,03	162.775,22
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	10.216.654,36	0,00	0,00	0,00	10.255.873,27	39.218,91	187.587,50
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	11.164.001,07	0,00	0,00	0,00	11.175.961,41	11.960,34	153.670,69
	37.130.752,57	492.134,50	0,00	0,00	37.718.539,90	95.652,83	

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	42.203,28	116.192,38	-141.618,79	0,00	17.016,14	239,27	1.524,80
BRDESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	8.740.892,62	0,00	0,00	0,00	8.773.856,74	32.964,12	158.660,88
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	1.509.083,20	233.769,00	0,00	0,00	1.757.623,52	14.771,32	41.409,61
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	29.462.184,46	10.013.892,97	-9.820.279,29	0,00	29.912.635,18	256.837,04	517.247,87
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	1.081.505,74	703.729,04	-850.590,96	0,00	940.245,85	5.602,03	17.119,08
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	21.542.454,76	0,00	0,00	0,00	21.404.928,44	-137.526,32	448.421,16
	62.378.324,06	11.067.583,39	-10.812.489,04	0,00	62.806.305,87	172.887,46	

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

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
LETRA FINANCEIRA - BPAC - BCO BTG PACTUAL SA 8,46% a.a	6.391.458,40	0,00	0,00	0,00	6.433.520,38	42.061,98	171.140,02
	6.391.458,40	0,00	0,00	0,00	6.433.520,38	42.061,98	

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	3.176.968,86	0,00	-3.189.615,73	0,00	0,00	12.646,87	107.811,31

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
	3.176.968,86	0,00	-3.189.615,73	0,00	0,00	12.646,87	

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	20.263.619,68	0,00	0,00	0,00	19.759.165,89	-504.453,79	907.934,31
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	2.314.417,97	0,00	0,00	0,00	2.241.644,09	-72.773,88	83.918,47
BTG PACTUAL FI DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I	3.199.026,09	0,00	0,00	0,00	3.032.352,64	-166.673,45	-18.105,18
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	5.061.419,29	0,00	0,00	0,00	4.933.460,52	-127.958,77	292.033,23
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	15.549.706,58	0,00	0,00	0,00	15.057.438,41	-492.268,17	850.811,50
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	5.414.056,89	0,00	0,00	0,00	5.248.924,20	-165.132,69	340.873,99
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	7.856.524,63	0,00	0,00	0,00	7.536.579,76	-319.944,87	77.744,49
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	6.885.614,23	0,00	0,00	0,00	6.878.657,51	-6.956,72	263.110,07
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	3.281.819,30	0,00	0,00	0,00	3.182.053,90	-99.765,40	320.278,40
	69.826.204,66	0,00	0,00	0,00	67.870.276,92	-1.955.927,74	

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	3.103.042,14	0,00	0,00	0,00	3.006.245,82	-96.796,32	64.055,08
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI	958.348,79	0,00	0,00	0,00	939.751,63	-18.597,16	8.985,04
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	8.045.364,87	0,00	0,00	0,00	8.239.715,72	194.350,85	519.340,50
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS IS MULTIMERCADO IE - FIF RESP LIMITADA	8.503.677,12	0,00	0,00	0,00	8.624.830,93	121.153,81	469.289,96
	20.610.432,92	0,00	0,00	0,00	20.810.544,10	200.111,18	

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

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Ativo	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Amortização	Saldo	Resultado Financ. Mês (R\$)	Resultado Financeiro Trimestre (R\$)
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	3.081.799,87	0,00	0,00	0,00	3.084.479,47	2.679,60	24.575,39
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13.980.006,12	0,00	0,00	0,00	13.934.661,00	-45.345,12	129.327,21
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	13.127.641,96	0,00	0,00	0,00	12.973.806,12	-153.835,84	279.201,91
	30.189.447,95	0,00	0,00	0,00	29.992.946,59	-196.501,36	

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	27.251.398,83	0,00	0,00	0,00	27.900.096,09	648.697,26	1.688.029,89
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7.561.601,91	0,00	0,00	0,00	7.737.694,25	176.092,34	459.695,65
	34.813.000,74	0,00	0,00	0,00	35.637.790,34	824.789,60	

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 - MULTISTRATÉGIA	838.197,23	0,00	0,00	0,00	830.872,63	-7.324,60	-22.493,72
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTISTRATÉGIA	68.454,62	0,00	0,00	0,00	59.734,02	-8.720,60	-27.757,62
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	11.751.704,08	0,00	0,00	0,00	11.754.803,74	3.099,66	67.500,87
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	2.353.512,01	453.007,95	0,00	0,00	2.778.592,04	-27.927,92	-37.964,24
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	945.244,28	284.544,48	0,00	0,00	1.241.922,57	12.133,81	-3.787,76
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTISTRATÉGIA	0,00	412.034,61	0,00	0,00	472.079,44	60.044,83	60.044,83
	15.957.112,22	1.149.587,04	0,00	0,00	17.138.004,44	31.305,18	

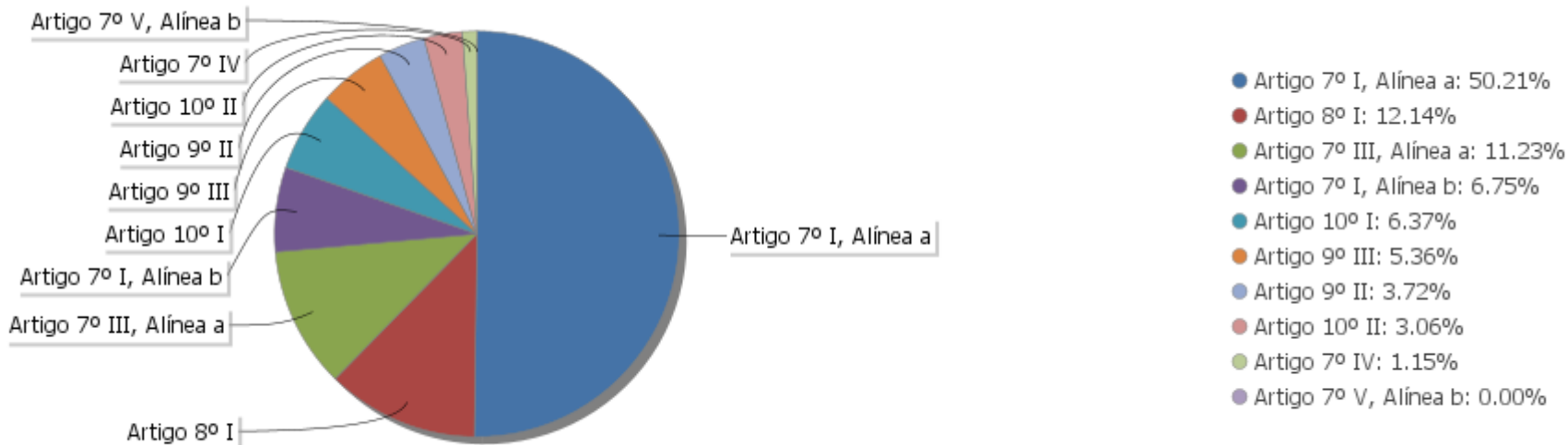
## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise de Liquidez

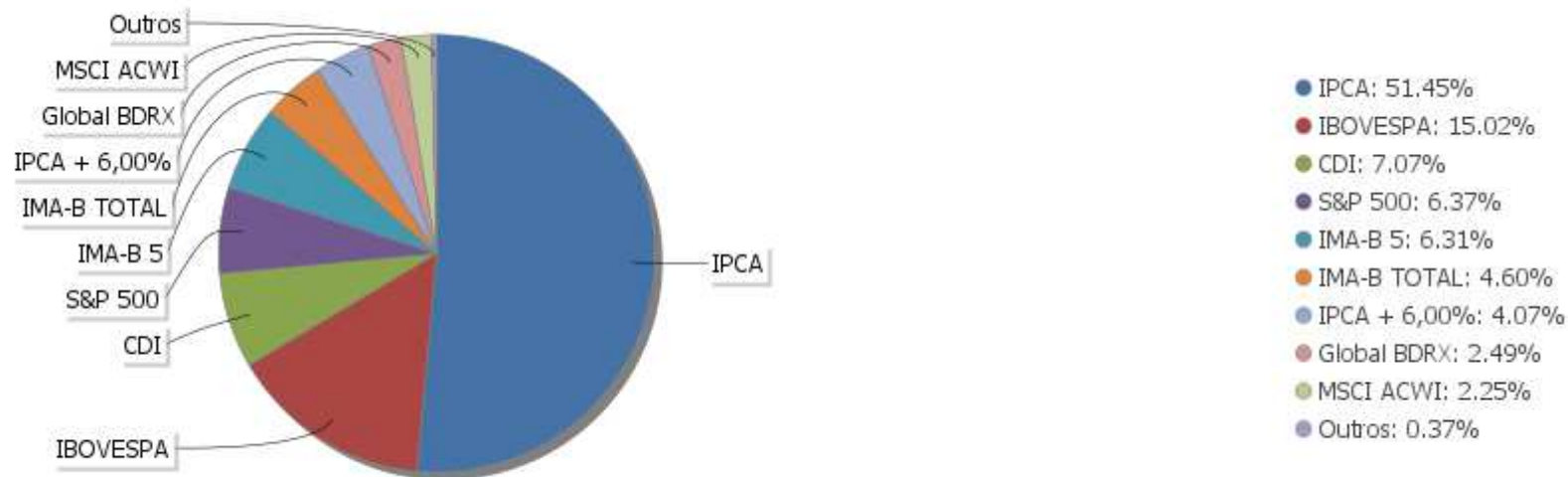
Período	Valor (R\$)	(%)	(%) Limite Mínimo P.I.	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.	(%) Limite Mínimo Acum.
de 0 a 30 dias	222.331.375,40	39,76	30,00	222.331.375,40	39,76	30,00
de 31 dias a 365 dias	29.472.675,68	5,27		251.804.051,08	45,03	30,00
acima de 365 dias	307.401.972,70	54,97		559.206.023,78	100,00	30,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

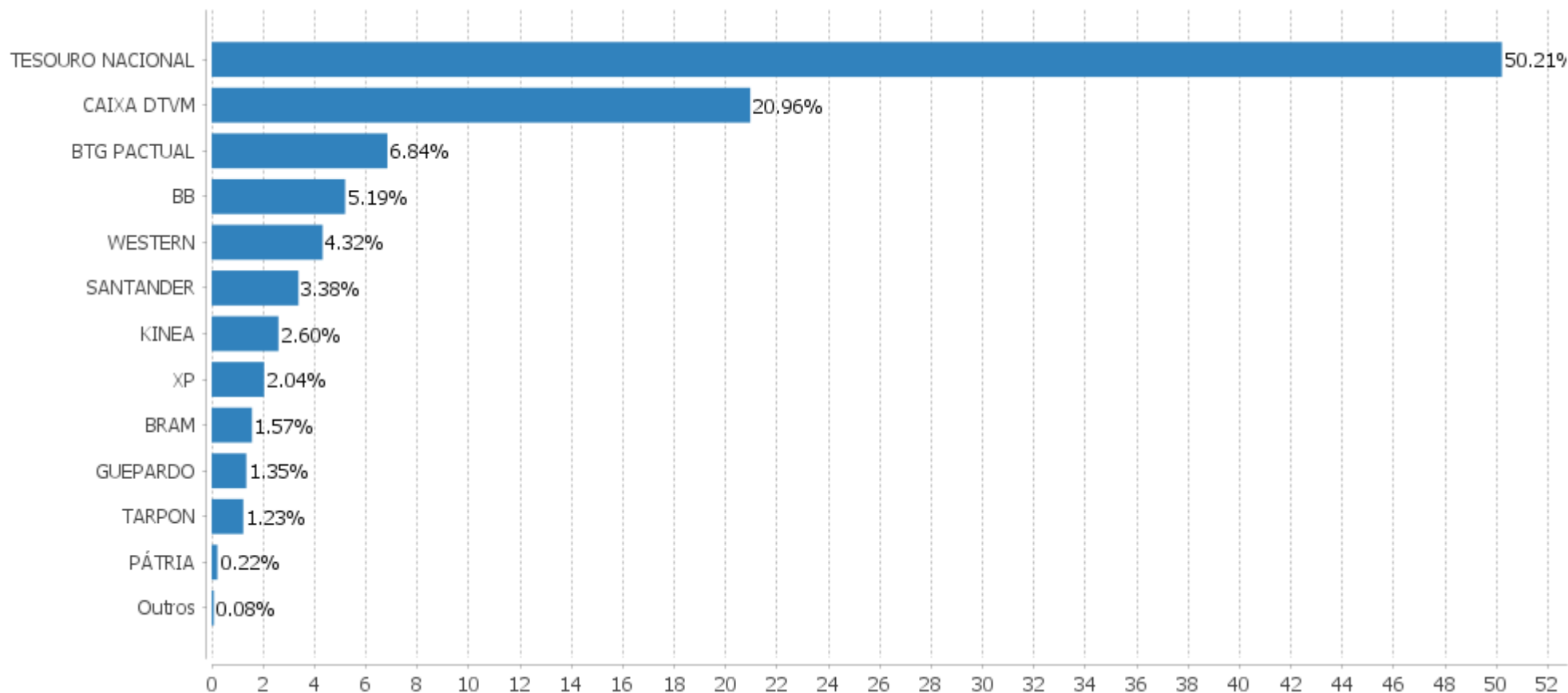


Alocação Por Estratégia



## 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	1,04	1,68	0,20				6,75
IPCA + 5,02%	0,85	1,20	0,55	0,81	0,87	0,60	0,83	0,41	0,85				7,19
p.p. indexador	-0,82	0,33	0,24	-1,75	0,11	0,67	0,21	1,27	-0,65				-0,45
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	39	48,15
Meses abaixo - Meta Atuarial	42	51,85

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

**Relatório**

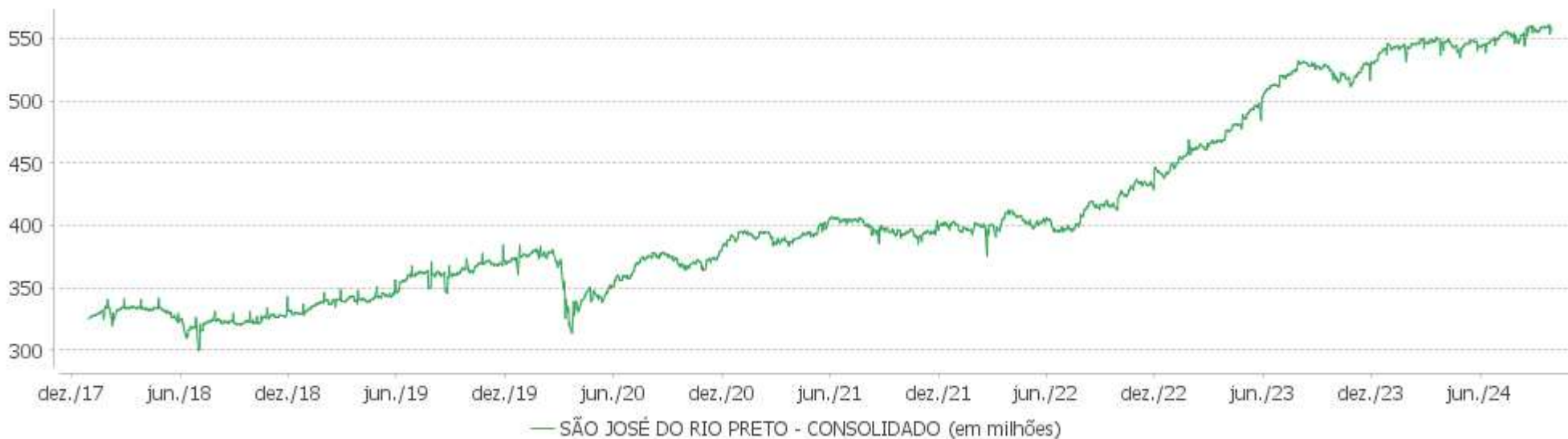
Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
03 meses	2,94	2,10	0,84	2,84
06 meses	4,28	4,45	-0,17	2,66
12 meses	12,51	9,65	2,86	2,96
24 meses	24,35	21,03	3,32	3,48
36 meses	27,99	36,17	-8,19	4,43
48 meses	38,05	58,39	-20,34	4,78
60 meses	43,15	73,03	-29,88	7,36
Desde 29/12/2017	71,95	103,64	-31,69	6,67

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução

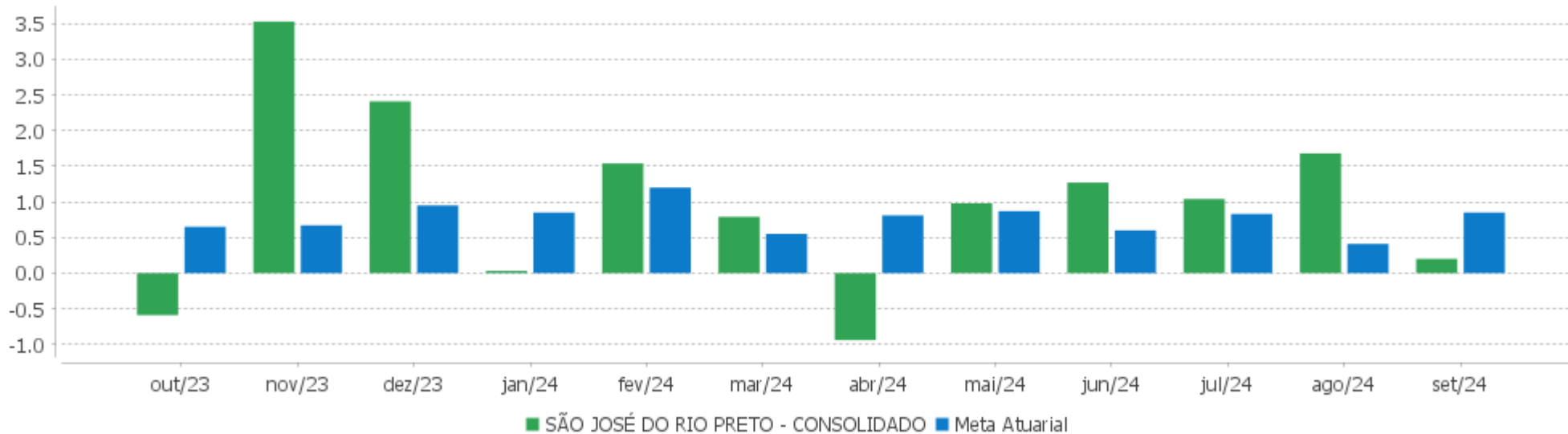


Patrimônio Líquido



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.	0,66 0,22	2,73 1,93	2,73 1,93	5,89 4,03	13,00 8,58	28,19 18,35	
BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,02 -0,91	3,11 0,75	3,11 0,75	2,88 -2,07	8,14 -2,52	21,07 -2,26	32,20 -7,90
NTN-B 150840 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	2,13 1,33	2,13 1,33	4,62 2,76	10,39 5,96	22,39 12,55	35,65 17,93
NTN-B 150529 (6,081000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,25	2,23 1,43	2,23 1,43	1,80 -0,06	4,34 -0,08		
NTN-B 150545 (5,750000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	2,14 1,34	2,14 1,34	4,65 2,79	7,41 2,99	12,62 2,78	
NTN-B 150545 (5,690000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	2,13 1,33	2,13 1,33	4,62 2,76	10,42 6,00	22,43 12,59	35,71 17,99
NTN-B 150850 (6,351000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	2,30 1,49	2,30 1,49	4,95 3,09	11,16 6,73	24,01 14,17	37,98 20,27
NTN-B 150545 (6,381500%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	2,30 1,50	2,30 1,50	1,84 -0,03	4,40 -0,02		
NTN-B 150535 (4,875000%) Var. IPCA p.p.	0,59 0,15	1,92 1,12	1,92 1,12	4,20 2,34	9,49 5,06	20,47 10,63	36,26 18,55
NTN-B 150826 (6,563000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,29	2,35 1,55	2,35 1,55	5,06 3,20	11,17 6,74	24,27 14,43	34,58 16,87
NTN-B 150545 (6,362000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	2,30 1,50	2,30 1,50	1,83 -0,03	4,40 -0,03		
NTN-B 150850 (5,832500%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	2,17 1,36	2,17 1,36	4,69 2,83	10,60 6,18	19,35 9,51	
NTN-B 150840 (6,351500%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	2,30 1,49	2,30 1,49	4,95 3,09	7,61 3,19		
NTN-B 150535 (4,825000%) Var. IPCA p.p.	0,59 0,15	1,91 1,11	1,91 1,11	4,18 2,32	9,44 5,01	20,35 10,51	36,06 18,35
NTN-B 150545 (6,275000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	2,28 1,48	2,28 1,48	1,82 -0,04	4,38 -0,05		
NTN-B 150535 (6,100000%) Var. IPCA p.p.	0,69 0,25	2,23 1,43	2,23 1,43	4,83 2,96	10,79 6,37	19,75 9,91	29,22 11,51
NTN-B 150850 (6,352000%)	0,71	2,30	2,30	4,95	11,16	20,30	29,84

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21

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.	0,27	1,49	1,49	3,09	6,73	10,46	12,13
NTN-B 150826 (6,670000%) Var. IPCA p.p.	0,73 0,29	-0,60 -1,40	-0,60 -1,40	2,06 0,20	4,85 0,43		
NTN-B 150840 (5,360000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,19	2,05 1,24	2,05 1,24	4,45 2,59	10,04 5,61	21,63 11,79	38,21 20,49
NTN-B 150840 (5,045000%) Var. IPCA p.p.	0,61 0,17	1,97 1,16	1,97 1,16	4,29 2,43	9,70 5,28	20,89 11,06	36,97 19,25
NTN-B 150840 (6,330000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	2,29 1,49	2,29 1,49	4,94 3,08	7,60 3,17		
NTN-B 150535 (5,320000%) Var. IPCA p.p.	0,63 0,19	2,04 1,23	2,04 1,23	4,43 2,57	9,96 5,54	21,50 11,66	38,01 20,29
NTN-B 150545 (5,854000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	2,17 1,37	2,17 1,37	4,70 2,84	10,60 6,17	22,81 12,98	36,26 18,55
NTN-B 150850 (6,042000%) Var. IPCA p.p.	0,68 0,24	2,22 1,42	2,22 1,42	4,80 2,93	10,83 6,40	23,28 13,44	32,99 15,28
NTN-B 150545 (6,421000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	2,31 1,51	2,31 1,51	4,99 3,13	11,20 6,78	20,41 10,57	30,01 12,30
NTN-B 150555 (6,351000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	2,30 1,49	2,30 1,49	4,95 3,09	11,17 6,75	24,03 14,19	33,85 16,13
NTN-B 150545 (5,895000%) Var. IPCA p.p.	0,67 0,23	2,18 1,38	2,18 1,38	4,72 2,86	10,64 6,22	22,91 13,07	32,54 14,83
NTN-B 150840 (4,873000%) Var. IPCA p.p.	0,59 0,15	1,92 1,12	1,92 1,12	4,20 2,34	9,52 5,09	20,50 10,66	36,29 18,58
NTN-B 150826 (6,320000%) Var. IPCA p.p.	0,71 0,27	-0,66 -1,47	-0,66 -1,47	1,91 0,04	4,55 0,13		
NTN-B 150840 (4,830000%) Var. IPCA p.p.	0,59 0,15	1,91 1,11	1,91 1,11	4,18 2,32	9,47 5,05	20,40 10,56	36,12 18,41
NTN-B 150840 (6,235000%) Var. IPCA p.p.	0,70 0,26	2,27 1,47	2,27 1,47	4,89 3,03	7,53 3,11		
NTN-B 150850 (5,760000%) Var. IPCA p.p.	0,66 0,22	2,15 1,35	2,15 1,35	4,65 2,79	10,52 6,10	22,62 12,79	35,99 18,28
NTN-B 150535 (4,965000%) Var. IPCA p.p.	0,60 0,16	1,95 1,14	1,95 1,14	4,25 2,39	9,58 5,16	20,67 10,83	36,61 18,90
NTN-B 150826 (5,525000%) Var. IPCA p.p.	0,64 0,20	2,09 1,29	2,09 1,29	4,54 2,67	10,08 5,66	21,86 12,02	38,69 20,98
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	-0,69	1,88	1,88	0,50	5,37	16,71	25,05

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 TOTAL p.p.	-0,02	-0,06	-0,06	-0,14	-0,25	-0,57	-0,73
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF Var. IMA-B 5 p.p.	0,11 -0,30	1,39 -0,52	1,39 -0,52	1,40 -1,78	6,44 -1,99	16,83 -4,23	25,59 -6,66
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,02	1,86 -0,05	1,86 -0,05	3,06 -0,12	8,17 -0,26	20,51 -0,55	31,38 -0,87
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,02	1,87 -0,05	1,87 -0,05	3,07 -0,11	8,21 -0,23	20,61 -0,45	31,64 -0,61
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do CDI	0,83 99,84	2,64 100,14	2,64 100,14	5,08 97,24	10,77 97,44	25,55 98,32	39,49 99,44
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5 Var. IMA-B 5 p.p.	0,38 -0,03	1,84 -0,08	1,84 -0,08	3,02 -0,16	8,10 -0,33	20,32 -0,74	30,90 -1,36
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,64 0,03	2,14 0,20	2,14 0,20	0,61 -0,03	5,61 -0,00	16,86 -0,42	25,18 -0,60
BB PREV RF FLUXO FIC % do CDI	0,75 90,22	2,38 90,26	2,38 90,26	4,70 89,93	9,96 90,07	23,52 90,51	35,60 89,66
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,86 102,52	2,73 103,92	2,73 103,92	5,38 102,87	11,42 103,33	26,66 102,58	40,82 102,79
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI % do CDI	0,85 102,25	2,70 102,71	2,70 102,71	5,24 100,20	11,26 101,82	26,47 101,86	40,76 102,64
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES % do CDI	0,75 89,83	2,36 89,66	2,36 89,66	4,69 89,61	9,94 89,96	22,88 88,05	34,20 86,12
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES Var. IBOVESPA p.p.	-0,10 2,98	6,11 -0,27	6,11 -0,27	0,29 -2,61	14,52 1,44	51,40 31,61	80,56 61,78
BTG PACTUAL FI DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I Var. IBOVESPA p.p.	-5,21 -2,13	2,44 -3,94	2,44 -3,94	-1,14 -4,03	3,14 -9,94	37,10 17,31	
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE Var. IBOVESPA p.p.	-3,05 0,03	6,95 0,56	6,95 0,56	-1,23 -4,13	13,96 0,87	26,32 6,53	29,10 10,33
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA Var. IBOVESPA p.p.	-4,07 -0,99	5,02 -1,37	5,02 -1,37	-3,64 -6,54	11,55 -1,54	32,92 13,13	46,61 27,83
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIA Var. IBOVESPA p.p.	-2,49 0,59	4,82 -1,57	4,82 -1,57	0,49 -2,41	7,22 -5,86	12,41 -7,39	12,21 -6,56
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS Var. IBOVESPA p.p.	-3,17 -0,09	5,99 -0,39	5,99 -0,39	0,22 -2,67	10,49 -2,59	11,68 -8,11	14,61 -4,17
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI Var. IBOVESPA p.p.	-3,14 -0,07	3,89 -2,49	3,89 -2,49	-0,21 -3,11	5,18 -7,90	7,22 -12,58	5,63 -13,15
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	-2,53	6,29	6,29	2,90	12,91	19,47	18,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IBOVESPA p.p.	0,55	-0,09	-0,09	-0,00	-0,17	-0,32	0,09
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-3,04 0,04	11,19 4,81	11,19 4,81	3,57 0,68	15,55 2,46	22,05 2,25	40,40 21,63
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. Global BDRX p.p.	-0,32 -0,12	0,75 0,12	0,75 0,12	22,25 -0,25	51,31 -1,67	81,77 -4,63	40,30 -4,59
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	0,09 3,17	0,80 -5,58	0,80 -5,58	14,89 11,99	40,17 27,08	60,67 40,88	26,62 7,84
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-1,17 1,91	2,20 -4,18	2,20 -4,18	17,86 14,96	53,75 40,67	85,12 65,33	25,24 6,47
BB AÇÕES NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	-3,12 -1,53	2,18 -1,91	2,18 -1,91	13,11 -5,48	31,95 -9,14	36,51 -18,60	6,79 -13,46
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI Var. MSCI ACWI p.p.	-1,94 -0,35	0,97 -3,12	0,97 -3,12	16,90 -1,70	43,66 2,57	66,83 11,72	36,96 16,72
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS IS MULTIMERCADO IE - FIF RESP LIMITADA Var. MSCI ACWI p.p.	1,42 3,01	5,75 1,67	5,75 1,67	10,93 -7,67	37,08 -4,01	70,64 15,54	51,48 31,24
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR Var. IPCA + 6,00% p.p.	2,42 1,49	6,73 4,38	6,73 4,38	17,70 12,75	52,26 41,60	90,58 67,25	4,14 -35,96
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP Var. S&P 500 p.p.	2,33 4,06	6,32 2,89	6,32 2,89	11,65 -7,94	40,19 -6,02	81,31 19,37	64,51 30,52
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO Var. S&P 500 p.p.	2,38 4,11	6,44 3,01	6,44 3,01	11,96 -7,63	40,91 -5,30	83,25 21,30	73,44 39,45
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,03 -0,90	0,58 -1,77	0,58 -1,77	-0,44 -5,39	3,60 -7,07	-3,51 -26,84	20,46 -19,65
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA p.p.	-7,26 -7,70	-10,97 -11,77	-10,97 -11,77				
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C Var. IPCA + 7,00% p.p.	-0,32 -1,33	-1,97 -4,57	-1,97 -4,57	5,26 -0,20	8,87 -2,84		
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 8,00% p.p.	-0,87 -1,96	7,07 4,21	7,07 4,21	10,32 4,37	-4,76 -17,50		
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA Var. IPCA + 6,00% p.p.	0,41 -0,52	7,61 5,26	7,61 5,26	5,40 0,45	10,67 0,01	0,82 -22,51	
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATÉGIA Var. IBOVESPA p.p.	-12,74 -9,66	-31,73 -37,42					
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO Var. IPCA + 5,02% p.p.	0,20 -0,65	2,94 0,84	2,94 0,84	4,28 -0,17	12,51 2,86	24,35 3,28	27,99 -8,28
CDI	0,83	2,63	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IBOVESPA	-3,08	6,38	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78
INPC + 6,00%	0,97	2,15	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78
IPCA + 6,00%	0,93	2,35	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10

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 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
BRDESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	D+0	D+0	D+1 du	D+1 du		0,20
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIESTRATÉGIA						
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 INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATÉGIA						
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
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 IBOVESPA	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,50

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+3 du		0,70
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	D+0	D+0	D+0	D+0		0,80
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA 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	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 Janeiro e Julho	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 de performance sera paga no(s) mes(es) de Janeiro	2,00
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA						
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	D+1 du	D+0	D+1 du	D+4 du		1,50



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo	Aplicação		Resgate		Taxas	
	Cotização	Liquidação	Cotização	Liquidação	Performance	Administração
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	0,82	2,55	2,55	4,60	10,28	25,21	37,49	40,92	47,32
IRF-M 1+	0,11	2,27	2,27	1,11	7,67	22,81	31,70	27,56	37,27
IRF-M TOTAL	0,34	2,36	2,36	2,19	8,45	23,17	33,03	31,68	40,32
IMA-B 5	0,40	1,92	1,92	3,18	8,43	21,06	32,25	40,12	50,27
IMA-B 5+	-1,42	2,55	2,55	-1,13	3,64	14,16	20,09	23,93	21,86
IMA-B TOTAL	-0,67	1,94	1,94	0,64	5,61	17,28	25,78	31,70	34,48
IMA-GERAL TOTAL	0,34	2,51	2,51	3,30	8,98	22,61	33,94	37,26	43,22
IDKA 2	0,39	1,75	1,75	2,72	8,05	20,40	31,12	39,27	50,42
IDKA 20	-3,07	3,35	3,35	-4,78	0,20	8,96	10,04	12,27	2,29
CDI	0,83	2,63	2,63	5,23	11,06	25,98	39,71	43,89	49,01

**Renda Variável**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IBOVESPA	-3,08	6,38	6,38	2,90	13,08	19,79	18,78	39,34	25,84
IBRX 100	-2,97	6,43	6,43	3,20	13,53	19,31	17,72	38,71	26,80
IBRX 50	-3,26	6,28	6,28	4,00	14,18	20,25	20,95	43,28	28,92
SMALL CAP	-4,41	1,39	1,39	-9,99	-3,75	-6,59	-23,80	-11,80	-13,37
Índice Consumo - ICON	-4,71	3,27	3,27	-4,43	-0,29	-18,06	-40,81	-41,80	-42,40
Índice Dividendos - IDIV	-0,72	7,93	7,93	8,38	19,48	36,40	46,24	74,87	57,72



**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	-1,73	3,43	3,43	19,59	46,21	61,94	33,99	65,50	153,26

**Investimentos Imobiliários**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IFIX	-2,58	-1,24	-1,24	-3,00	2,69	10,54	21,74	18,29	23,16

**Investimentos no Exterior**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
MSCI ACWI	-1,59	4,09	4,09	18,60	41,09	55,11	20,24	45,57	114,03

**Indicadores Econômicos**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA	0,44	0,80	0,80	1,86	4,42	9,84	17,71	29,77	33,84
INPC	0,48	0,60	0,60	1,69	4,09	8,78	16,60	29,18	34,20
IGPM	0,62	1,52	1,52	3,58	4,53	-1,71	6,40	32,85	56,68
SELIC	0,83	2,63	2,63	5,23	11,05	25,98	39,71	43,89	49,01

**Meta Atuarial**

Indexador	No Mês	No Trimestre	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses	48 meses	60 meses
IPCA + 4,00%	0,77	1,84	1,84	3,93	8,58	18,75	32,35	51,72	62,74
IPCA + 5,00%	0,85	2,10	2,10	4,44	9,62	21,03	36,19	57,62	70,69
IPCA + 5,50%	0,89	2,22	2,22	4,69	10,14	22,18	38,14	60,63	74,78
IPCA + 5,89%	0,92	2,32	2,32	4,89	10,55	23,08	39,67	63,01	78,02
IPCA + 6,00%	0,93	2,35	2,35	4,95	10,66	23,33	40,10	63,69	78,95
INPC + 4,00%	0,81	1,64	1,64	3,75	8,24	17,60	31,10	51,03	63,17
INPC + 6,00%	0,97	2,15	2,15	4,77	10,31	22,14	38,78	62,93	79,42

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%)	2.340.009,38	6,081000	2.292.274,30	6,630800	-47.735,08
NTN-B 150535 (4,825000%)	5.813.863,31	4,825000	5.133.593,45	6,498200	-680.269,86
NTN-B 150535 (4,875000%)	5.869.004,35	4,875000	5.201.984,37	6,498200	-667.019,98
NTN-B 150535 (4,965000%)	5.776.443,84	4,965000	5.154.965,62	6,498200	-621.478,22
NTN-B 150535 (5,320000%)	5.787.226,44	5,320000	5.304.570,75	6,498200	-482.655,69
NTN-B 150535 (6,100000%)	5.567.071,35	6,100000	5.407.157,14	6,498200	-159.914,21
NTN-B 150545 (5,690000%)	5.778.276,85	5,690000	5.316.645,86	6,436600	-461.630,99
NTN-B 150545 (5,750000%)	2.273.700,40	5,750000	2.106.356,11	6,436600	-167.344,29
NTN-B 150545 (5,854000%)	5.658.407,94	5,854000	5.303.956,96	6,436600	-354.450,98
NTN-B 150545 (5,895000%)	21.940.941,09	5,895000	20.661.746,23	6,436600	-1.279.194,86
NTN-B 150545 (6,275000%)	15.413.120,86	6,275000	15.142.078,10	6,436600	-271.042,76
NTN-B 150545 (6,362000%)	12.328.182,29	6,362000	12.227.862,51	6,436600	-100.319,78
NTN-B 150545 (6,381500%)	13.208.204,87	6,381500	13.128.773,86	6,436600	-79.431,01
NTN-B 150545 (6,421000%)	5.533.328,66	6,421000	5.523.897,76	6,436600	-9.430,90
NTN-B 150555 (6,351000%)	11.004.695,23	6,351000	10.884.800,39	6,435900	-119.894,84
NTN-B 150826 (5,525000%)	11.502.987,36	5,525000	11.252.279,86	6,835800	-250.707,50
NTN-B 150826 (6,320000%)	20.194.913,27	6,320000	20.021.238,70	6,835800	-173.674,57
NTN-B 150826 (6,563000%)	10.790.129,40	6,563000	10.741.007,88	6,835800	-49.121,52
NTN-B 150826 (6,670000%)	3.463.896,48	6,670000	3.454.308,14	6,835800	-9.588,34
NTN-B 150840 (4,830000%)	11.877.781,47	4,830000	10.142.124,51	6,420000	-1.735.656,96
NTN-B 150840 (4,873000%)	11.815.896,35	4,873000	10.133.732,18	6,420000	-1.682.164,17
NTN-B 150840 (5,045000%)	5.802.966,18	5,045000	5.064.768,01	6,420000	-738.198,17
NTN-B 150840 (5,360000%)	5.807.684,57	5,360000	5.232.614,51	6,420000	-575.070,06
NTN-B 150840 (5,690000%)	1.500.682,25	5,690000	1.397.322,08	6,420000	-103.360,17
NTN-B 150840 (6,235000%)	14.960.355,50	6,235000	14.694.960,71	6,420000	-265.394,79
NTN-B 150840 (6,330000%)	11.966.102,01	6,330000	11.862.551,09	6,420000	-103.550,92
NTN-B 150840 (6,351500%)	12.815.618,44	6,351500	12.731.156,71	6,420000	-84.461,73
NTN-B 150850 (5,760000%)	1.141.654,57	5,760000	1.046.021,11	6,456600	-95.633,46

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Financeiro Curva (R\$)	Taxa Curva (%)	Financeiro Mercado (R\$)	Taxa Mercado (%)	Diferença (R\$)
NTN-B 150850 (5,832500%)	5.937.104,25	5,832500	5.490.577,20	6,456600	-446.527,05
NTN-B 150850 (6,042000%)	10.852.786,09	6,042000	10.307.235,67	6,456600	-545.550,42
NTN-B 150850 (6,351000%)	10.676.663,19	6,351000	10.538.766,03	6,456600	-137.897,16
NTN-B 150850 (6,352000%)	5.398.397,00	6,352000	5.329.332,84	6,456600	-69.064,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
217	01/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	41.561,65	0,00	14.593,33974700	2,8479875560
218	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.551.130,32	294.680,48937800	5,2637700000
219	01/07/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	216.081,75	0,00	105.743,95762400	2,0434430000
220	01/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	234.509,64	93.372,62325600	2,5115460000
221	02/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	4.903,05	0,00	1.720,97229000	2,8489999670
222	02/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	277,17	0,00	110,31935900	2,5124330000
223	03/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	12.810,62	0,00	4.494,93725000	2,8500108650
224	04/07/2024	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATÉGIA	87.491,64	0,00	87.491,64000000	1,0000000000
225	04/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	86.757,30	16.460,16818600	5,2707420000
226	04/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	103,05	0,00	40,98709400	2,5142060000
227	05/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	700.869,18	0,00	132.915,35504400	5,2730490000
228	05/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	16.449,31	6.540,23906800	2,5150930000
229	10/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	25.097,11	9.968,05441700	2,5177540000
230	11/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	8.383,17	3.328,44726200	2,5186430000
231	12/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	5.701,73	0,00	1.995,62588300	2,8571136740
232	12/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	14.323,22	5.684,87823100	2,5195300000
233	15/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	5.073,33	2.012,89087400	2,5204200000
234	16/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	24.673,10	0,00	8.629,60967600	2,8591212030
235	18/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	332,40	0,00	131,74337600	2,5230870000
236	19/07/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	169.771,85	0,00	29.945,42608300	5,6693750000
237	19/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.886,91	747,59402300	2,5239770000
238	22/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	43,83	17,35932600	2,5248670000
239	23/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	18.039,24	0,00	3.404,11832600	5,2992400000
240	23/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	71,98	0,00	28,49837500	2,5257580000
242	25/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	379.576,17	150.176,18572700	2,5275390000
243	25/07/2024	KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	1.134.869,47	0,00	1.134,86946886	1.000,0000000000
241	25/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.134.869,47	213.969,79440700	5,3038770000
244	26/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	119.579,50	41.705,50268100	2,8672355520

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
245	26/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	119.579,50	0,00	22.535,28479100	5,3063230000
248	29/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	5.164,36	2.041,79616900	2,5293220000
246	29/07/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	1.674,06	0,00	583,65253900	2,8682476080
247	29/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.871.493,86	0,00	352.563,64628300	5,3082440000
250	30/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	199.528,33	78.858,25178900	2,5302150000
249	30/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.650.000,00	1.252.260,89550700	5,3103950000
252	31/07/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	712.711,03	0,00	281.580,64768400	2,5311080000
251	31/07/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.507.969,30	0,00	472.063,99142800	5,3127740000
253	01/08/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	47.265,15	0,00	22.907,89518900	2,0632690000
254	01/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	63.808,40	25.200,78931800	2,5320000000
255	01/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.570.236,92	295.447,09792200	5,3147820000
256	02/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.934,44	1.553,33780000	2,5328940000
257	02/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	6.917,61	0,00	2.408,32801100	2,8723703610
258	05/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	12.069,15	4.763,28519500	2,5337870000
259	06/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.070,50	422,34127000	2,5346800000
260	06/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	17.733,40	3.332,99941600	5,3205530000
261	07/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	1.700,00	670,45987700	2,5355730000
262	07/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	24.928,62	0,00	8.669,44880000	2,8754561650
263	07/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	480.153,93	0,00	90.202,98746600	5,3230380000
264	07/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	7.432,24	1.396,24025100	5,3230380000
265	08/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	810,72	319,62557200	2,5364680000
266	12/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	29.053,26	11.446,14555500	2,5382570000
267	13/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	131,72	51,87556300	2,5391530000
268	13/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.136.731,05	0,00	1.901.254,62314200	5,3316010000
269	13/08/2024	FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	0,00	11.113.751,32	5.621.395,22823200	1,9770450000
270	14/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	830,00	326,76562000	2,5400470000
271	15/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	7.275,70	2.863,38597000	2,5409430000
272	15/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	605.115,86	0,00	209.998,71182300	2,8815217710
273	15/08/2024	BRASESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	0,00	11.662.575,54	1.282.308,96473920	9,0949809000
274	15/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.123.299,79	0,00	210.515,82101700	5,3359400000

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
275	15/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.780.454,50	0,00	333.672,13649300	5,3359400000
276	15/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	32.683,40	6.125,14380300	5,3359400000
277	15/08/2024	NTN-B 150824 (5,270000%)	0,00	7.184.456,32	1.617,00000000	4.443,0775015461
278	15/08/2024	NTN-B 150824 (7,408000%)	0,00	10.765.576,79	2.423,00000000	4.443,0775030953
279	15/08/2024	NTN-B 150826 (6,320000%)	19.998.610,72	0,00	4.660,00000000	4.291,5473648069
280	15/08/2024	BB PREV RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,00	605.115,86	188.337,74974700	3,2129292400
281	16/08/2024	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	0,00	1.049.009,19	599.044,23000000	1,7511381300
282	16/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	597.030,21	207.122,29563500	2,8825009310
283	16/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	608.162,16	0,00	113.931,44130100	5,3379660000
284	19/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.373,00	1.326,53366400	2,5427170000
285	19/08/2024	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	0,00	14.229.748,24	9.996.519,74406500	1,4234702281
286	19/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	433.809,92	0,00	150.446,40518200	2,8834847830
287	19/08/2024	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP - MULTIELSTRATÉGIA	386.473,38	0,00	386.473,38000000	1,0000000000
288	19/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.121.049,67	0,00	4.891.391,80908300	5,3402080000
289	20/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	18.315,95	7.200,79809400	2,5436000000
290	20/08/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	433.809,92	150.395,20941200	2,8844663450
291	20/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	433.809,92	0,00	81.202,29053300	5,3423360000
292	20/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.730.634,96	1.634.235,46577600	5,3423360000
293	20/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.000.000,00	187.184,03328300	5,3423360000
294	20/08/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	184.039,19	0,00	32.186,19632100	5,7179540000
295	20/08/2024	NTN-B 150826 (6,670000%)	3.431.525,55	0,00	804,00000000	4.268,0666044776
296	21/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	3.018,05	1.186,11239400	2,5444890000
297	21/08/2024	BTG PACTUAL FI DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I	1.000.000,00	0,00	684.988,22950500	1,4598791000
298	21/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	3.000.000,00	561.333,75925500	5,3444140000
299	21/08/2024	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5.276.102,16	0,00	621.423,15724196	8,4903533100
300	22/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.000.000,00	374.067,61286300	5,3466270000
301	22/08/2024	GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	3.000.000,00	0,00	424.835,30009868	7,0615600900
302	23/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	177.929,59	69.878,11514600	2,5462850000
303	23/08/2024	TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	2.000.000,00	0,00	880.837,61032843	2,2705660800
304	26/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	6.261,06	2.458,03301700	2,5471830000

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
305	26/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	5.919,07	1.106,15648300	5,3510240000
306	27/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	49,00	19,23013200	2,5480830000
307	27/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	75.786,50	0,00	14.157,09553700	5,3532520000
308	28/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	4.346,23	1.705,08393900	2,5489830000
309	29/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	193.138,02	75.743,90489200	2,5498820000
310	29/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	4.699.759,34	877.231,89363600	5,3574880000
311	30/08/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	712.400,17	0,00	279.286,96768200	2,5507820000
312	30/08/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.854.562,43	0,00	532.599,51388800	5,3596790000
313	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	1.582.366,42	295.115,81143000	5,3618490000
314	02/09/2024	FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	233.769,00	0,00	112.332,39806600	2,0810470000
315	02/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	254.772,32	99.844,77813400	2,5516840000
316	03/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	61.473,91	11.460,47963700	5,3639910000
317	03/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	271.200,00	0,00	50.559,36894700	5,3639910000
318	04/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	82.167,75	0,00	15.312,22932100	5,3661520000
319	05/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	2.410,72	943,75933500	2,5543800000
320	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	8.085,65	1.505,63661500	5,3702520000
321	06/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	550.461,89	0,00	102.502,05949300	5,3702520000
322	06/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	630,50	246,74388900	2,5552810000
323	09/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	9.976,48	3.902,88329200	2,5561820000
324	10/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	103.759,95	0,00	19.305,88284500	5,3745250000
325	10/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	27.787,10	10.866,72214000	2,5570820000
326	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	343.844,93	63.951,43445200	5,3766570000
327	11/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	343.844,93	0,00	59.748,96030700	5,7548270000
328	12/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	5.207,75	2.035,16298100	2,5588860000
329	13/09/2024	BB PREV RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	0,00	3.189.615,73	1.000.297,05921700	3,1886685080
330	13/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	99.200,97	0,00	34.171,38081300	2,9030424770
331	13/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.267.496,64	0,00	607.231,67487200	5,3809720000
332	13/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	564,78	220,63555700	2,5597870000
333	16/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	99.200,97	34.159,14092400	2,9040826940
334	16/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	279.623,35	0,00	51.944,66942800	5,3831000000

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
 Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
335	16/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	6.272,97	2.449,71870900	2,5606900000
336	17/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	0,00	42.417,82	14.601,28803200	2,9050738550
337	17/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	117.347,58	0,00	21.790,27867900	5,3853180000
338	20/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	284.544,48	52.772,96240300	5,3918610000
339	20/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	179.847,96	0,00	33.355,45185600	5,3918610000
340	20/09/2024	FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	148.289,57	0,00	25.698,56667100	5,7703440000
341	20/09/2024	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTISTRATÉGIA CLASSE C	284.544,48	0,00	284,54448000	1.000,0000000000
342	20/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	2.027,76	790,75693100	2,5643280000
343	23/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	18,05	7,03633400	2,5652560000
344	24/09/2024	BB PREV RF FLUXO FIC	16.991,41	0,00	5.838,28644100	2,9103419590
345	24/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	41.891,42	0,00	7.763,13331600	5,3962000000
346	24/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	42,60	16,60052300	2,5661840000
347	25/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	311.031,42	121.160,09852300	2,5671110000
348	26/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	375.796,97	69.580,34428800	5,4009070000
349	26/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.465,25	0,00	3.233,76240300	5,4009070000
350	26/09/2024	KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTISTRATÉGIA	453.007,95	0,00	453,00794872	1.000,0000000000
351	26/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	2.094,40	815,56360000	2,5680400000
352	27/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	6.754.000,00	1.249.981,95508400	5,4032780000
353	27/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,00	227.754,11	88.655,87582300	2,5689680000
354	27/09/2024	VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTISTRATÉGIA	412.034,61	0,00	412,03461000	1.000,0000000000
355	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	410.166,93	75.879,31533100	5,4055170000
356	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	479.137,97	0,00	88.638,69450400	5,4055170000
357	30/09/2024	FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.623.493,21	0,00	855.328,58559100	5,4055170000
358	30/09/2024	FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	703.729,04	0,00	273.835,39735800	2,5698980000
<b>Total</b>			<b>101.061.488,84</b>	<b>103.667.064,25</b>		

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco**

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

Value-At-Risk (R\$): 7.381.088,12

Value-At-Risk: 1,32%

	Volatilidade <sup>(1)</sup>	VaR <sup>(2)</sup>	Limite <sup>(5)</sup>	CVaR <sup>(3)</sup>	Sharpe	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
Artigo 7º	0,67	0,25	5,00	0,01	-0,39	0,57	387.756.461,39	69,34
Artigo 8º	11,36	5,86	15,00	0,48	-0,32	-2,80	67.870.276,92	12,14
Artigo 9º	15,26	7,18	15,00	0,42	-0,05	0,01	50.803.490,69	9,08
Artigo 10º	11,69	5,02	15,00	0,40	0,07	1,67	52.775.794,78	9,44
SÃO JOSÉ DO RIO PRETO - CONSOLIDADO	2,84	1,32		1,32	0,11	2,94	559.206.023,78	100,00

**Renda Fixa**

Value-At-Risk: 0,25%

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 150826 (5,525000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,77	0,64	11.502.987,36	2,06
NTN-B 150826 (6,320000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,52	0,71	20.194.913,27	3,61
NTN-B 150826 (6,563000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,44	0,73	10.790.129,40	1,93
NTN-B 150826 (6,670000%)	0,25	0,20	-0,00	0,20	-0,40	0,73	3.463.896,48	0,62
NTN-B 150529 (6,081000%)	0,25	0,20	-0,00	0,21	-0,59	0,69	2.340.009,38	0,42
NTN-B 150535 (4,825000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-1,00	0,59	5.813.863,31	1,04
NTN-B 150535 (4,875000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,98	0,59	5.869.004,35	1,05
NTN-B 150535 (4,965000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,95	0,60	5.776.443,84	1,03
NTN-B 150535 (5,320000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,84	0,63	5.787.226,44	1,03
NTN-B 150535 (6,100000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,59	0,69	5.567.071,35	1,00
NTN-B 150840 (4,830000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-1,00	0,59	11.877.781,47	2,12
NTN-B 150840 (4,873000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,98	0,59	11.815.896,35	2,11
NTN-B 150840 (5,045000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,93	0,61	5.802.966,18	1,04
NTN-B 150840 (5,360000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,83	0,63	5.807.684,57	1,04
NTN-B 150840 (5,690000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,72	0,66	1.500.682,25	0,27
NTN-B 150840 (6,235000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,54	0,70	14.960.355,50	2,68

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21

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%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,51	0,71	11.966.102,01	2,14
NTN-B 150840 (6,351500%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,51	0,71	12.815.618,44	2,29
NTN-B 150545 (5,690000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,72	0,66	5.778.276,85	1,03
NTN-B 150545 (5,750000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,70	0,66	2.273.700,40	0,41
NTN-B 150545 (5,854000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,67	0,67	5.658.407,94	1,01
NTN-B 150545 (5,895000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,65	0,67	21.940.941,09	3,92
NTN-B 150545 (6,275000%)	0,25	0,20	-0,00	0,22	-0,53	0,70	15.413.120,86	2,76
NTN-B 150545 (6,362000%)	0,25	0,20	-0,00	0,22	-0,50	0,71	12.328.182,29	2,20
NTN-B 150545 (6,381500%)	0,25	0,20	-0,00	0,22	-0,50	0,71	13.208.204,87	2,36
NTN-B 150545 (6,421000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,48	0,71	5.533.328,66	0,99
NTN-B 150850 (5,760000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,70	0,66	1.141.654,57	0,20
NTN-B 150850 (5,832500%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,67	0,67	5.937.104,25	1,06
NTN-B 150850 (6,042000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,61	0,68	10.852.786,09	1,94
NTN-B 150850 (6,351000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,51	0,71	10.676.663,19	1,91
NTN-B 150850 (6,352000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,51	0,71	5.398.397,00	0,97
NTN-B 150555 (6,351000%)	0,25	0,06	-0,00	0,09	-0,51	0,71	11.004.695,23	1,97
<b>Sub-total</b>	0,25	0,06	-0,00		-0,64	0,68	280.798.095,24	50,21

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
FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	2,03	1,01	0,00	0,01	-0,22	0,38	5.084.792,16	0,91
FI CAIXA BRASIL IMA B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	3,93	2,02	0,00	0,01	-0,39	-0,69	4.308.197,00	0,77
FI CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	0,04	0,04	0,00	0,04	-0,03	0,83	6.893.716,06	1,23
SANTANDER RF IMA-B 5 PREMIUM FIC FI	2,03	1,01	0,00	0,01	-0,22	0,38	10.255.873,27	1,83
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO FI RF	2,87	1,70	0,00	0,81	-0,25	0,11	11.175.961,41	2,00
<b>Sub-total</b>	2,11	1,11	0,01		-0,27	0,26	37.718.539,90	6,75

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	0,02	0,01	-0,00	0,01	-4,25	0,75	17.016,14	0,00

Assinado por 1 pessoa: PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI  
Para verificar a validade das assinaturas, acesse <https://riopretprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21> e informe o código 420C-0FB8-B7E6-8E21

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
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B 5	2,03	1,05	0,00	0,05	-0,23	0,38	8.773.856,74	1,57
FI CAIXA BRASIL MATRIZ RENDA FI	0,06	0,04	0,00	0,04	0,30	0,85	1.757.623,52	0,31
FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,04	0,02	0,00	0,02	0,52	0,86	29.912.635,18	5,35
FIC FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RENDA FIXA SIMPLES	0,01	0,00	-0,00	0,00	-12,17	0,75	940.245,85	0,17
FIC FI CAIXA NOVO BRASIL RENDA FIXA IMA-B LP	3,78	2,09	0,01	0,14	-0,39	-0,64	21.404.928,44	3,83
<b>Sub-total</b>	<b>1,54</b>	<b>0,85</b>	<b>0,01</b>		<b>-0,36</b>	<b>0,28</b>	<b>62.806.305,87</b>	<b>11,23</b>

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	2,27	0,22	0,00	0,23	-0,08	0,66	6.433.520,38	1,15
<b>Sub-total</b>	<b>2,27</b>	<b>0,22</b>	<b>0,00</b>		<b>-0,08</b>	<b>0,66</b>	<b>6.433.520,38</b>	<b>1,15</b>

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	2,89	NaN	0,00	NaN	-0,28	0,02	0,00	0,00
<b>Sub-total</b>	<b>1,48</b>	<b>NaN</b>	<b>0,00</b>		<b>-0,29</b>	<b>0,40</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

Renda Variável

Value-At-Risk: 5,86%

Artigo 8º I

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	11,23	5,64	0,14	1,83	-0,30	-2,49	19.759.165,89	3,53
BB AÇÕES SELEÇÃO FATORIAL FIC DE FI	12,09	6,15	0,02	1,65	-0,33	-3,14	2.241.644,09	0,40
BTG PACTUAL FI DE AÇÕES OPORTUNIDADES LISTADAS I	12,24	6,66	0,01	4,86	-0,49	-5,21	3.032.352,64	0,54
FIA CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	12,53	6,22	0,04	1,07	-0,27	-2,53	4.933.460,52	0,88
FIC FI EM AÇÕES CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS	11,79	6,00	0,11	1,61	-0,34	-3,17	15.057.438,41	2,69
FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	13,79	8,08	0,04	4,88	-0,28	-3,05	5.248.924,20	0,94
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA	13,79	6,21	0,04	3,79	-0,36	-4,07	7.536.579,76	1,35
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FI EM AÇÕES	12,30	7,67	0,05	5,79	-0,08	-0,10	6.878.657,51	1,23

**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
XP DIVIDENDOS FI DE ACOES	12,32	7,01	0,02	3,71	-0,31	-3,04	3.182.053,90	0,57
<b>Sub-total</b>	11,36	5,86	0,48		-0,32	-2,80	67.870.276,92	12,14

**Investimentos Estruturados**

Value-At-Risk: 5,02%

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	13,63	7,44	0,31	6,12	0,11	2,38	27.900.096,09	4,99
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13,63	7,43	0,09	6,12	0,11	2,33	7.737.694,25	1,38
<b>Sub-total</b>	13,63	7,44	0,40		0,11	2,37	35.637.790,34	6,37

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 - MULTIESTRATÉGIA	3,04	4,79	-0,00	4,79	-0,56	-0,87	830.872,63	0,15
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP MULTIESTRATÉGIA	47,21	2,73	-0,00	7,10	-0,29	-12,74	59.734,02	0,01
KINEA PE IV FEEDER INST I FIP ME	0,09	0,01	0,00	0,07	-8,84	0,03	11.754.803,74	2,10
KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	45,43	0,31	-0,00	0,32	-0,01	0,41	2.778.592,04	0,50
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP MULTIESTRATÉGIA CLASSE C	27,67	1,79	-0,00	1,79	-0,04	-0,32	1.241.922,57	0,22
VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA	89,06	0,63	-0,00	0,63	-0,09	-7,26	472.079,44	0,08
<b>Sub-total</b>	7,66	0,28	-0,00		-0,08	0,21	17.138.004,44	3,06

**Investimentos no Exterior**

Value-At-Risk: 7,18%

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	13,03	8,15	0,01	7,99	-0,30	-3,12	3.006.245,82	0,54
BB MULT GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO	13,97	6,84	0,00	7,03	-0,20	-1,94	939.751,63	0,17

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
EXTERIOR FI								
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY FIC FIA INVESTIMENTO NO EXTERIOR	16,52	8,74	0,03	8,75	0,10	2,42	8.239.715,72	1,47
SANTANDER GO GLOBAL EQUITY ESG REAIS IS MULTIMERCADO IE - FIF RESP LIMITADA	11,56	6,22	0,08	5,77	0,05	1,42	8.624.830,93	1,54
<b>Sub-total</b>	11,60	5,98	0,12		0,01	0,97	20.810.544,10	3,72

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	16,76	10,19	0,04	11,48	-0,04	0,09	3.084.479,47	0,55
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	18,83	9,23	0,14	1,21	-0,06	-0,32	13.934.661,00	2,49
WESTERN ASSET FIA BDR NÍVEL I	17,34	8,71	0,12	11,08	-0,12	-1,17	12.973.806,12	2,32
<b>Sub-total</b>	17,79	8,99	0,30		-0,08	-0,65	29.992.946,59	5,36

(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 (%)

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

**Observações**

A primeira integralização do FIP VINCI CAPITAL PARTNERS IV FEEDER B FIP MULTIESTRATÉGIA, inscrito no CNPJ sob o nº 42.847.134/0001-92, ocorreu em 30 de setembro de 2024, no último dia do prazo estabelecido para a chamada de capital. Contudo, em virtude de uma incompatibilidade no cálculo de rentabilidade apresentado pelo sistema ao apurar as variações no mesmo dia do fechamento do mês, fez-se necessário realizar o lançamento com um dia útil de antecedência, a fim de assegurar a correta apuração dos valores.



## VERIFICAÇÃO DAS ASSINATURAS



Código para verificação: 420C-0FB8-B7E6-8E21

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

- ✓ PATRÍCIA NATO TONINATO BARTOLOMEI (CPF 326.XXX.XXX-02) em 11/12/2024 16:14:28 (GMT-03:00)  
Papel: Parte  
Emitido por: Sub-Autoridade Certificadora 1Doc (Assinatura 1Doc)

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

<https://riopretoprev.1doc.com.br/verificacao/420C-0FB8-B7E6-8E21>