RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE SETEMBRO/2021

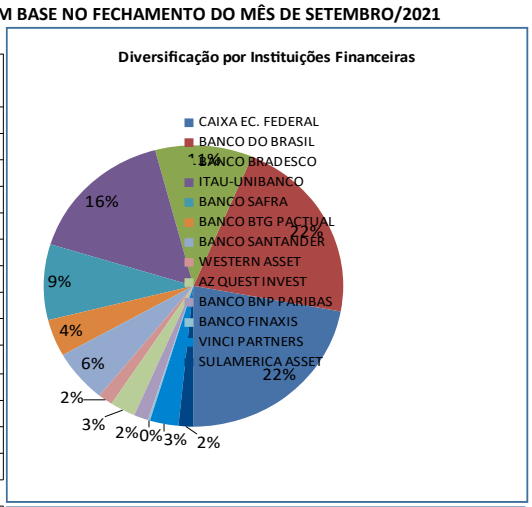
SEGMENTO	INSTITUIÇÃO	CNPJ FUNDO	FUNDO	AGÊNCIA / CONTA CORRENTE	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	SALDO APLICADO	DISPONIBILIDADE DE PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 3922/2010 E 4695/2018	LIMITE LEGAL	% APLICADO	TX ADM	TAXA PERFORMANCE	NÍVEL DE RISCO (Incerteza)
RENDA FIXA	BANCO DO BRASIL	07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍT. PÚBLICOS PREVID FI	6919-1 22.0002-3/113.618-6	IMA-B	PAS		28.236.810,90	D+1	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,31%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA	BANCO DO BRASIL	19.523.305/0001-06	BB FI PREVID TP IPCA VII	6919-1 22.0002-3/113.618-6	IPCA + 6%	VÉRTICE		8.701.797,00	2020 e 2022	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,64%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA	BANCO DO BRASIL	13.322.205/0001-35	BB FI PREVID IDKA-2	6919-1 22.0002-3/113.618-6	IDKA 2	PAS	25.670.043,01	24.129.627,57	D+1	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	9,36%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA	CAIXA EC. FEDERAL	23.215.097/0001-55	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	330-0	ALOCAÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	75.226.130,74		D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	14,14%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA	CAIXA EC. FEDERAL	03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI REF DI LP	0290/006/ 330-9 / 0000066-0	CDI	PAS		1.687.994,92	D+0	ARTIGO 7°, INCISO IV,ALÍNEA "A"	40,00%	0,32%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA	CAIXA EC. FEDERAL	14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL FI IDKA IPCA 2A	0290/006/ 330-9 / 00000009-1	IDKA 2	PAS	9.340.523,50	5.916.370,76	D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	2,87%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA	CAIXA EC. FEDERAL	10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL FI IMA-B TP	0290/006/ 330-9 / 00000009-1	IMA-B	PAS			D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA	CAIXA EC. FEDERAL	20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	0290/006/ 330-9 / 00000009-1	IPCA + 6%	VÉRTICE	17.962.816,97		2024	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	3,38%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA	BANCO BRADESCO	24.022.566/0001-82	BRADESCO FI IDKA PRÉ 2	13 28.703-2 ATIVO/28.707-5 INATIVO	IDKA 2	PAS			D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA	BANCO BRADESCO	03.399.411/0001-90	BRADESCO FI REF DI PREMIUM	13 28.703-2 ATIVO/28.707-5 INATIVO	CDI	PAS		36.139.914,56	D+0	ARTIGO 7°, INCISO IV,ALÍNEA "A"	40,00%	6,80%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA	BANCO BRADESCO	24.022.566/0001-82	BRADESCO FI IDKA PRÉ 2	344079-6/344069-9	IDKA-2	PAS			D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA	ITAÚ-UNIBANCO	21.838.150/0001-49	ITAU ALOCAÇÃO DINAMICA FIC FI	0075/46710-0	ALOCAÇÃO ATIVA/DI	ATIVO		73.755.377,16	D+1	ARTIGO 7°, INCISO IV,ALÍNEA "A"	40,00%	13,87%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA	BANCO SANTANDER	26.507.132/0001-06	SANTANDER RF ATIVO FIC FI	0680/450000175	ALOCAÇÃO ATIVA/DI	ATIVO		22.653.822,43	D+1	ARTIGO 7°, INCISO IV, ALÍNEA "A"	40,00%	4,26%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA	BANCO BTG PACTUAL	23.176.675/0001-91	BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	0001/000160730	IPCA + 6%	VÉRTICE		9.140.445,90	2024	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,72%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA	BANCO PETRA	06.018.364/0001-85	FIDC PREMIUM	n/a	FIDC	M LIQUIDAÇÃ		1.190.363,87	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7°, INCISO VII, ALÍNEA "A"	5,00%	0,22%	0,25%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	BANCO DO BRASIL	10.418.335/0001-88	BB PREVID FIA GOV CORPORATIVA	1963-1/13.618-2	GOVERNANÇA	PAS		8.266.994,15	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I, ALÍNEA "A"	20,00%	1,55%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	BANCO DO BRASIL	17.413.636./0001-68	BB GLOBAL SELECT EQUIT INV. EXTERIOR FI MULT	1963-1/13.618-2	MERC. EXTERNO	ATIVO		9.360.555,98	D+5	ARTIGO 9°, INCISO II	10,00%	1,76%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	BANCO DO BRASIL	09.005.805/0001-00	BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1963-1/13.618-1	IBOVESPA	ATIVO		10.107.142,95	D+3	ARTIGO 8°, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,90%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	BANCO SAFRA	21.595.829/0001-54	SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0146/00001173-1	MULTIMERC.	ATIVO		24.092.756,58	D+2	ARTIGO 8°, INCISO III	10,00%	4,53%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	BANCO SAFRA	17.253.869/0001-40	SAFRA CARTEIRA PREMIUM INSTIT MULTIMERCADO	0146/00001173-0	MULTIMERC.	ATIVO			D+1	ARTIGO 8°, INCISO III	10,00%		0,20%	10% exceder o índice	BAIXO
RENDA VARIÁVEL	BANCO SAFRA	19.436.818/0001-80	SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	0146/000011731	MERC. EXTERNO	ATIVO		22.278.819,87	D+5	ARTIGO 9°, INCISO III	10,00%	4,19%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	VINCI PARTNERS	13.396.703/0001-22	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	2856-8/651.358-1	MULTIMERC.	ATIVO		10.334.830,70	D+2	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,94%	1,00%	20% exceder o índice	MÉDIO
RENDA VARIÁVEL	VINCI PARTNERS	28.470.587/0001-11	VINCI MOSAICO FIA	2856/20606-7	AÇÕES LIVRES	ÃTIVO		6.103.890,98	D+32	ARTIGO 8°, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,15%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL	WESTERN ASSET	17.453.850/0001-48	WESTERN ASSE T US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	001/78910000-1	MULTIMERC.	ATIVO		8.523.106,48	D+1	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,60%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	CAIXA EC. FEDERAL	03.737.188/0001-43	CAIXA RV-30 FI MULTIMERCADO	0290/006/330-9	MUITIMERC.	ATIVO		7.299.012,36	D+4	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,37%	1,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL	CAIXA EC. FEDERAL	13.767.159/0001-88	CAIXA FIP INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA	0290/006/9-1	FIP	ATIVO		36.214,20	06/2020	ARTIGO 8°, INCISO IV, ALÍNEA "A"	5,00%	0,01%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	AZ QUEST INVEST	11.392.165/0001-72	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	2856/27.966-8	SMALL CAPS	ATIVO		14.509.424,35	D+30	ARTIGO 8°, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,73%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL	ITAU-UNIBANCO	08.817.414/0001-10	ITAU FICFIA RPI IBOVESPA	0075/46710-0	AÇÕES LIVRES	ATIVO		11.738.623,63	D+5	ARTIGO 8°, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,21%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	SULAMERICA DTVM	11.458.144/0001-02	SULAMÉRICA FIA EQUITIES	2856-8/19.615-0	AÇÕES LIVRES	ATIVO		8.465.182,21	D+4	ARTIGO 8°, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,59%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENDA VARIÁVEL	BANCO BNP PARIBAS	12.239.939/0001-92	BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	001/65045 001	VALOR	ATIVO		8.215.782,79	D+30	ARTIGO 8°, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,54%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL	BANCO BRADESCO	03.660.879/0001-96	BRADESCO FIA SELECTION	13/344069-9	AÇÕES LIVRES	ATIVO		13.195.177,58	D+4	ARTIGO 8°, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,48%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	BANCO BRADESCO	06.988.623/0001-09	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	13/344069-9	SMALL CAPS	ATIVO		6.529.721,60	D+4	ARTIGO 8°, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,23%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	BANCO SANTANDER	17.804.792/0001-50	SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	0680/450000175	MERC. EXTERNO	ATIVO		9.585.291,13	D+8	ARTIGO 9°, INCISO II	10,00%	1,23%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL	BANCO BTG PACTUAL	11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIQ FIA	0001/000160730	AÇÕES LIVRES	ATIVO		13.457.417,90	D+33	ARTIGO 8°, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,53%	3,00%	N POSSUI	ALTO
					TOTAL RENDA FIXA . . . . . :			339.752.039,29			100,00%	63,88%			
					TOTAL RENDA VARIÁVEL . . . . . :			192.099.945,44			40,00%	35,54%			
					TOTAL GERAL . . . . . :			531.851.984,73							

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS
ECONOMISTA FUNPREV – ITE 2003/CORECON 32.356
MBA EM GESTÃO FINANCIRA / FAAG 2016
CERTIFICAÇÃO CGRPPS Nº 063 / 2009

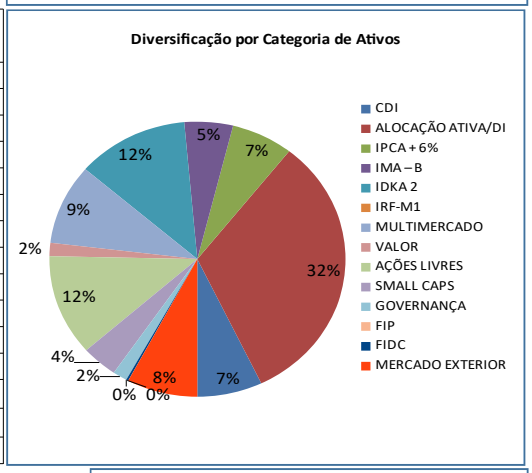
Donizete do Carmo dos Santos
Presidente da FUNPREV

RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE SETEMBRO/2021

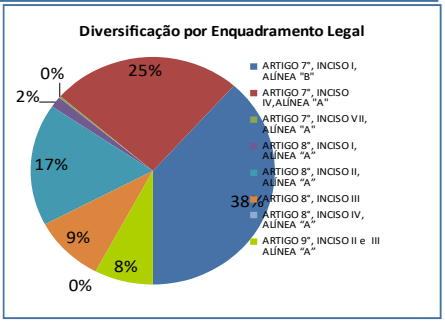
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CAIXA EC. FEDERAL	117.469.063,45	22,09%
BANCO DO BRASIL	114.472.971,56	21,52%
BANCO BRADESCO	55.864.813,74	10,50%
ITAU-UNIBANCO	85.494.000,79	16,07%
BANCO SAFRA	46.371.576,45	8,72%
BANCO BTG PACTUAL	22.597.863,80	4,25%
BANCO SANTANDER	32.239.113,56	6,06%
WESTERN ASSET	8.523.106,48	1,60%
AZ QUEST INVEST	14.509.424,35	2,73%
BANCO BNP PARIBAS	8.215.782,79	1,54%
BANCO FINAXIS	1.190.363,87	0,22%
VINCI PARTNERS	16.438.721,68	3,09%
SULAMERICA ASSET	8.465.182,21	1,59%
TOTAL . . . . . :	**531.851.984,73**	**100,00%**



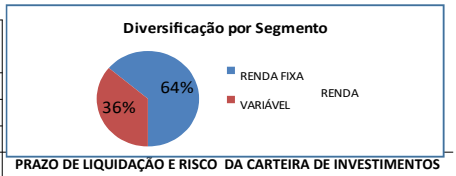
CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CDI	37.827.909,48	7,11%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI	171.635.330,33	32,27%
IPCA + 6%	35.805.059,87	6,73%
IMA – B	28.236.810,90	5,31%
IDKA 2	65.056.564,84	12,23%
IRF-M1		
MULTIMERCADO	50.249.706,12	9,45%
VALOR	8.215.782,79	1,54%
AÇÕES LIVRES	63.067.435,25	11,86%
SMALL CAPS	21.039.145,95	3,96%
GOVERNANÇA	8.266.994,15	1,55%
FIP	36.214,20	0,01%
FIDC	1.190.363,87	0,22%
MERCADO EXTERIOR	41.224.666,98	7,75%
TOTAL . . . . . :	**531.851.984,73**	**100,00%**



ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	204.324.566,35	38,42%
ARTIGO 7°, INCISO IV,ALÍNEA "A"	134.237.109,07	25,24%
ARTIGO 7°, INCISO VII, ALÍNEA "A"	1.190.363,87	0,22%
ARTIGO 8°, INCISO I, ALÍNEA "A"	8.266.994,15	1,55%
ARTIGO 8°, INCISO II, ALÍNEA "A"	92.322.363,99	17,36%
ARTIGO 8°, INCISO III	50.249.706,12	9,45%
ARTIGO 8°, INCISO IV, ALÍNEA "A"	36.214,20	0,01%
ARTIGO 9°, INCISO II e III ALÍNEA "A"	41.224.666,98	7,75%
TOTAL . . . . . :	**531.851.984,73**	**100,00%**



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	339.752.039,29	63,88%
RENDA VARIÁVEL	192.099.945,44	36,12%
TOTAL . . . . . :	**531.851.984,73**	**100,00%**



RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	-1,21%
META ATUARIAL NO MÊS	1,60%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	0,92%
EVOLUÇÃO DO PATRIMONIO NO ANO	-5,82%
META GERENCIAL ANO	1,19%
META ATUARIAL ANO	11,16%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	8,24%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

(NÍVEL DE INCERTEZA)		MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R$ 37.827.909,48	7,11%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R$ 282.831.785,74	53,18%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R$ 211.192.289,51	39,71%
TOTAL		R$ 531.851.984,73	

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS
ECONOMISTA FUNPREV – ITE 2003/CORECON 32.356
MBA EM GESTÃO FINANCIRA / FAAG 2016
CERTIFICAÇÃO CGRPPS Nº 063 / 2009

Donizete do Carmo dos Santos
Presidente da FUNPREV

FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS EFETIVOS DE BAURU – FUNPREV
Rua Rio Branco nº 19-31 – CEP 17014-037 – Bauru – SP
Fone: (14) 3009-5500
www.funprevbauru.sp.gov.br

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS

MÊS: SETEMBRO/2021

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA Nº 41/2021 DATA: 02/12/2021

	SIM	NÃO	PARCIAL
A rentabilidade da carteira está compatível com a meta gerencial definida na Política de Investimentos?	X		
O perfil de risco dos fundos que compõem a carteira foi divulgado no relatório de investimentos?	X		
Os percentuais aplicados estão respeitando os limites previstos na Política de Investimentos?	X		
Os percentuais aplicados estão respeitando os limites previstos na Resolução CMN 3922/2010?	X		
Os investimentos estão aderentes à Política de Investimentos?	X		
	SIM	**NÃO**	**NÃO SE APLICA**
Foram realizadas movimentações estratégicas na carteira no mês avaliado, ou seja, ALÉM daquelas rotineiras de fluxo de caixa e pagamentos?		X	
Em caso positivo à resposta anterior, as discussões foram registradas nas atas do Comitê de Investimentos?			X
Em caso positivo à resposta anterior, as decisões foram registradas nas atas do Conselho Curador?			X
Em caso positivo à resposta anterior, as decisões foram conhecidas pelo Conselho Fiscal com registro em ata?			X

Informações complementares: O Comitê observou que a rentabilidade da carteira no ano está ligeiramente abaixo da meta gerencial tendo em vista uma posição mais conservadora na renda fixa e maior exposição à volatilidade na renda variável. No segmento de renda variável houve ligeira diminuição

de exposição em fundos de ações diante das desvalorizações das cotas dos fundos diante dos resultados dos índices de bolsa. Quanto aos multimercados e investimentos no exterior houve aumento da posição devido à rentabilidade positiva e da diminuição da carteira no geral.

ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR

	SIM	NÃO
O Conselho Curador aprova o relatório de investimentos?	X	

Observações: _____

_____

_____.

ATA Nº 23/2021 **DATA: 03/12/2021**

ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL

	SIM	NÃO
O Conselho Fiscal aprova o relatório de investimentos?	X	

Observações: _____

_____

_____.

ATA Nº 24/2021 **DATA: 07/12/2021**

Márcia A. R. Oliveira	Sérgio R. C. Alberto	Soraya de Góes
Presidente do Comitê de Investimentos	Presidente do Conselho Curador em exercício	Presidente do Conselho Fiscal