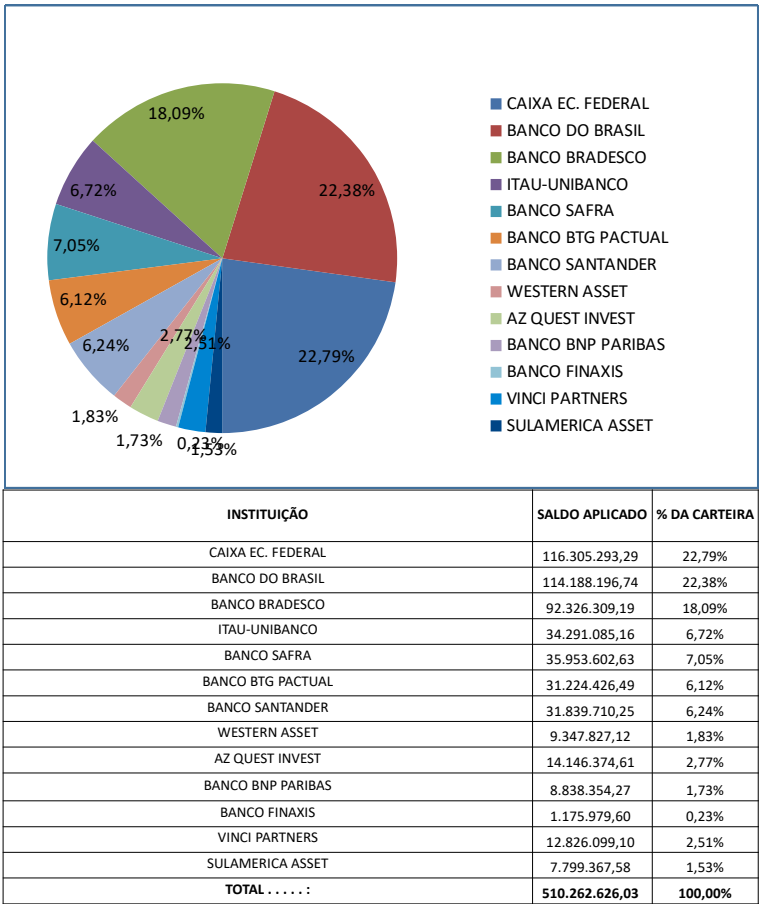
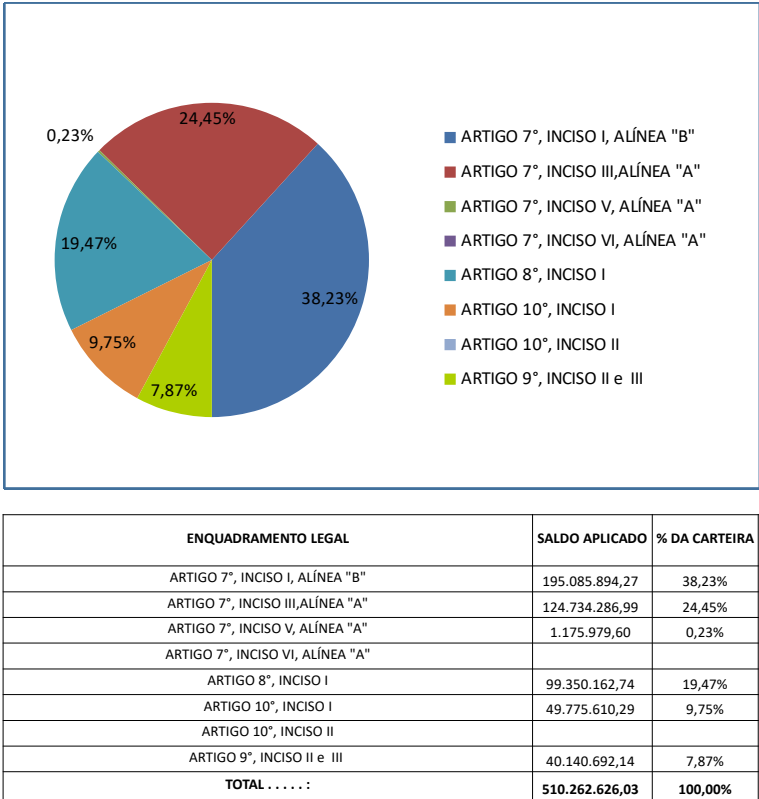


RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE MARÇO/2022

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

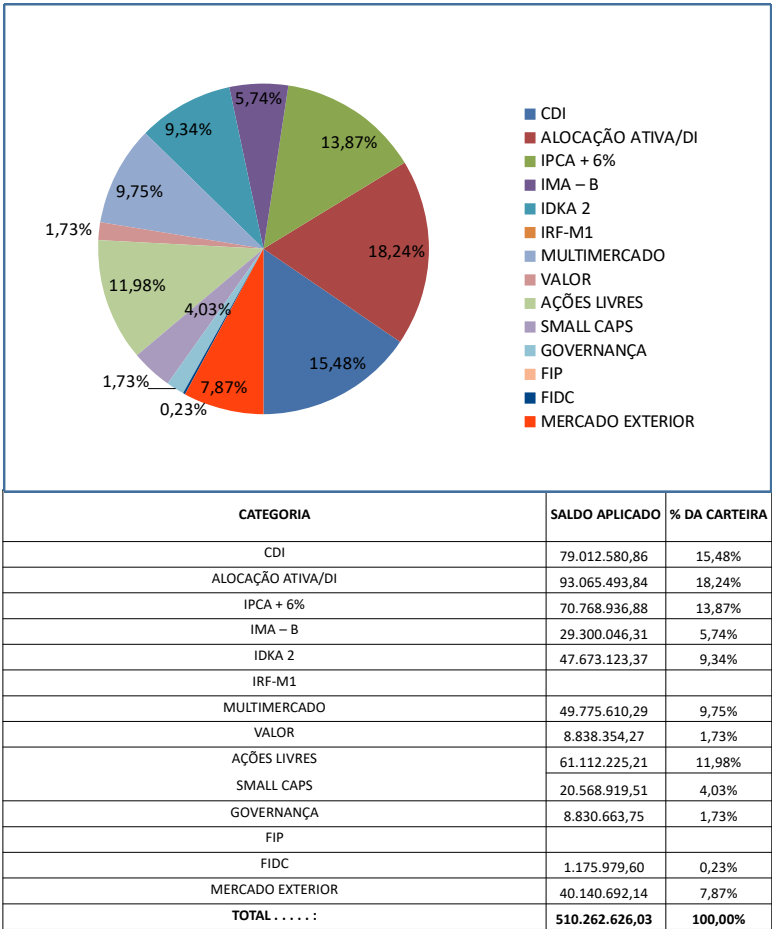


DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL

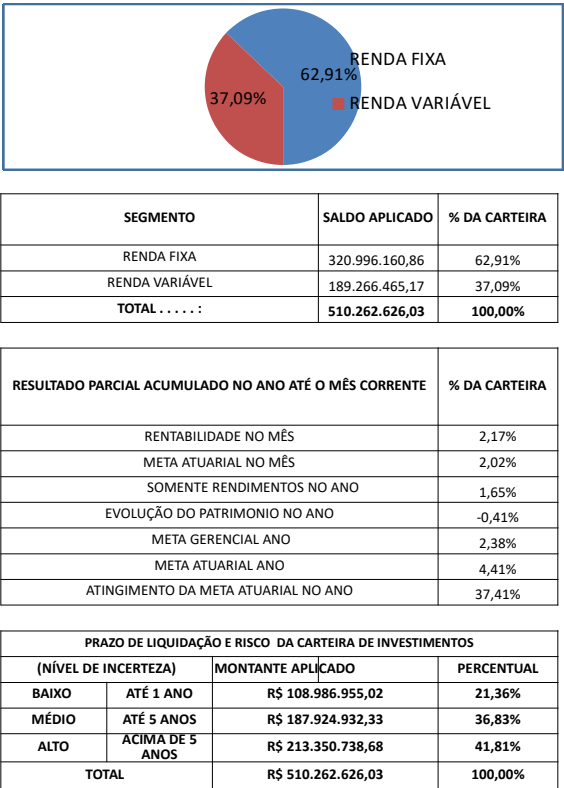


LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS



DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



DONIZETE DO CARMO DOS SANTOS
Presidente – FUNPREV

RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE MARÇO/2022

FUNDO	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	SALDO APLICADO	DISPONIBILIDADE PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 4963/2021	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	IMA-B	PAS	-	29.300.046,31	D+1	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,74%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 19.523.305/0001-06 BB FI PREVID TP IPCA VII	IPCA + 6%	VÉRTICE	-	8.955.558,62	2022	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,76%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 13.322.205/0001-35 BB FI PREVID IDKA-2	IDKA 2	PAS	9.080.987,15	2.527.821,98	D+1	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	2,28%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 44.345.590/0001-60 BB FI PREVID TP IPCA XXI	IPCA + 6%	PAS	-	12.857.963,10	2024	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	2,52%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 15.486.093/0001-83 BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RF PREVIDENCIÁRIO	IPCA + 6%	PAS	21.018.815,54	-	2023	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,12%	0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 23.215.097/0001-55 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	47.343.787,71	-	D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	9,28%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS	-	6.604.045,35	D+0	ARTIGO 7°, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	1,29%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 14.386.926/0001-71 CAIXA BRASIL FI IDKA IPCA 2A	IDKA 2	PAS	18.859.682,17	17.204.632,07	D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	7,07%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.658/0001-93 CAIXA BRASIL FI IMA-B TP	IMA-B	PAS	-	-	D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,00%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 20.139.595/0001-78 CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	18.532.838,92	-	2024	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	3,63%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.566/0001-82 BRADESCO FI IDKA PRÉ 2	IDKA 2	PAS	-	-	D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,00%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 03.399.411/0001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS	-	72.408.535,51	D+0	ARTIGO 7°, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	14,19%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.566/0001-82 BRADESCO FI IDKA PRÉ 2	IDKA-2	PAS	-	-	D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,00%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA ITAU-UNIBANCO 21.838.150/0001-49 ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC FI	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	22.262.027,71	D+1	ARTIGO 7°, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	4,36%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO SANTANDER 26.507.132/0001-06 SANTANDER RF ATIVO FIC FI	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	23.459.678,42	D+1	ARTIGO 7°, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	4,60%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 23.176.675/0001-91 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE	-	9.403.760,70	2024	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,84%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.018.364/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO	-	1.175.979,60	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7°, INCISO V, ALÍNEA "A"	5,00%	0,23%	0,25%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 10.418.335/0001-88 BB PREVID FIA GOV CORPORATIVA	GOVERNANÇA	PAS	-	8.830.663,75	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,73%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 17.413.636./0001-68 BB GLOBAL SELECT EQUITY INV. EXTERIOR FI MULT	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	12.174.165,97	D+5	ARTIGO 9°, INCISO II	10,00%	2,39%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.805/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO	-	9.442.174,32	D+3	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,85%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21.595.829/0001-54 SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS	-	16.367.108,29	D+2	ARTIGO 10°, INCISO I	10,00%	3,21%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 36.499.594/0001-74 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS	-	9.908.615,41	D+2	ARTIGO 10°, INCISO I	10,00%	1,94%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.436.818/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	19.586.494,34	D+5	ARTIGO 9°, INCISO III	10,00%	3,84%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 13.386.703/0001-22 VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO	-	6.391.752,40	D+2	ARTIGO 10°, INCISO I	10,00%	1,25%	1,00%	20% exceder o índice	MÉDIO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	6.434.346,70	D+32	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,26%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.453.850/0001-48 WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS	-	9.347.827,12	D+1	ARTIGO 10°, INCISO I	10,00%	1,83%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 03.737.188/0001-43 CAIXA RV-30 FI MULTIMERCADO	MUITIMERC.	ATIVO	-	7.760.307,07	D+4	ARTIGO 10°, INCISO I	10,00%	1,52%	1,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 13.767.159/0001-88 CAIXA FIP INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA	FIP	ATIVO	-	-	11/2021	ARTIGO 10°, INCISO II	5,00%	0,00%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL AZ QUEST INVEST 11.392.165/0001-72 AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	SMALL CAPS	ATIVO	-	14.146.374,61	D+30	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	2,77%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAU-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAU FIC FIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	12.029.057,45	D+5	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	2,36%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMERICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMERICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	7.799.367,58	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,53%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.939/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO	-	8.838.354,27	D+30	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,73%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.680.879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	13.495.228,78	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	2,64%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.988.623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO	-	6.422.544,90	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,26%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	8.380.031,83	D+8	ARTIGO 9°, INCISO II	10,00%	1,26%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIQ FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	11.912.050,38	D+33	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	2,33%	3,00%	N POSSUI	ALTO
TOTAL RENDA FIXA							320.996.160,86	100,00%	62,91%		
TOTAL RENDA VARIÁVEL							189.266.465,17	70,00%	37,09%		
TOTAL GERAL							510.262.626,03				

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

DONIZETE DO CARMO DOS SANTOS
Presidente – FUNPREV



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS

MÊS: MARÇO/2022

FOLHAS 48/65 – PROCESSO 579/2022

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA Nº 14/2022

DATA: 19/05/2022

	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 4963/2021?	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 mês de março de 2022 foi de 2,17% positiva, com destaque para os fundos de ações que tiveram expressiva rentabilidade e os fundos de renda fixa que fecharam positivos no mês e constituem a maior parte da carteira da



**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



Fundação. Mais uma vez, o segmento de investimento no exterior, que colaborou com o resultado da carteira em 2021, fechou o mês de março com rentabilidade negativa, impactando o resultado da carteira, por conta das tensões envolvendo o cenário internacional, o aumento da inflação e dos juros nos EUA e a situação na economia da China. No entanto, os fundos que a Funprev possui aplicação neste segmento, apresentaram rentabilidade satisfatória, de acordo com parâmetros definidos na Política de Investimentos, logo, verifica-se que a volatilidade do mercado externo, tem prejudicado a estratégia no segmento. O resultado da carteira no mês foi compatível com a meta gerencial que mede a possibilidade de retorno dentre o perfil de risco da Fundação. O Comitê recomenda o monitoramento dos fundos de ações num prazo mais curto, a fim de verificar eventuais possibilidades de migrações parciais dos fundos.



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS

MÊS: MARÇO/2022

PARECER DO CONSELHO FISCAL

ATA Nº 10/2022 - DATA: 30/05/2022

	SIM	NÃO	PARCIAL
O conselho Fiscal aprova o relatório de investimentos?	X		

Informações complementares: Este conselho após análise dos relatórios mensais e demais informações pertinentes a carteira de investimentos data base março/2022, elaborado pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos às fls. 48-65, do parecer emitido pelo Comitê de Investimentos às fls. 78-78vs, da análise e aprovação do relatório de investimentos pelo conselho Curador, conforme item 10 da ata nº 10/2022 às fls 81-82vs manifesta-se FAVORÁVEL as aprovações. Observando-se rentabilidade positiva de 2,17% no mercado interno, enquanto que o investimentos no exterior, muito embora tenha apresentado rentabilidade negativa, ainda se encontra satisfatória, de acordo com parâmetros definidos na política de investimentos e compatível com a meta gerencial.

Membros do Conselho Fiscal.

Cristiane N. Pereira dos Santos

Elson Reis

Michele Carla Ribeiro Correa

Rubens Roberto R. de Souza

Soraya de Goes

Valderez Alves Cardoso