

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

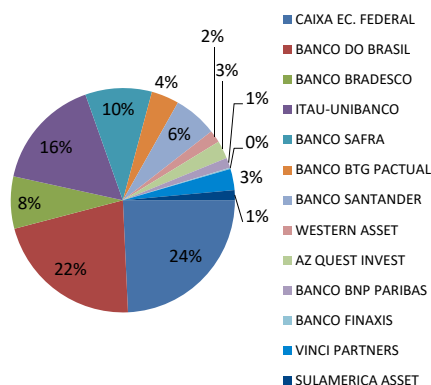
SEGMENTO	INSTITUIÇÃO	CNPJ FUNDO	FUNDO	AGÊNCIA / CONTA CORRENTE	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	SALDO APLICADO	DISPONIBILIDADE E PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 3922/2010 E 4695/2018	LIMITE LEGAL	% APLICADO	TX ADM	TAXA PERFORMANCE	NÍVEL DE RISCO
RENTA FIXA	BANCO DO BRASIL	07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍT. PÚBLICOS PREVID FI	6919-122.0002-3/113.618-6	IMA-B	PAS	-	27.507.678,23	D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,28%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENTA FIXA	BANCO DO BRASIL	19.523.305/0001-06	BB FI PREVID TP IPCA VII	6919-122.0002-3/113.618-6	IPCA + 6%	VÉRTICE		8.658.615,30	2020 e 2022	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,66%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA	BANCO DO BRASIL	13.322.205/0001-35	BB FI PREVID IDKA-2	6919-122.0002-3/113.618-6	IDKA 2	PAS	25.651.806,51	23.827.341,46	D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	9,50%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA	CAIXA EC. FEDERAL	23.215.097/0001-55	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	330-0	ALOCAÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	74.728.712,99		D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	14,35%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA	CAIXA EC. FEDERAL	03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI REF DI LP	0290/006/330-9 / 0000066-0	CDI	PAS	-	1.696.482,73	D+0	ARTIGO 7º, INCISO IV,ALÍNEA "A"	40,00%	0,33%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA	CAIXA EC. FEDERAL	14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL FI IDKA IPCA 2A	0290/006/330-9 / 00000009-1	IDKA 2	PAS	12.327.121,41	12.703.042,94	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,81%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA 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 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,00%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENTA FIXA	CAIXA EC. FEDERAL	20.139.595/0001-78	CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	0290/006/330-9 / 00000009-1	IPCA + 6%	VÉRTICE	17.694.773,81	-	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	3,40%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA 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 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,00%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA	BANCO BRADESCO	03.399.411/0001-90	BRADESCO FI REF DI PREMIUM	13 28.703-2 ATIVO/28.707-5 INATIVO	CDI	PAS	-	21.403.003,29	D+0	ARTIGO 7º, INCISO IV,ALÍNEA "A"	40,00%	4,11%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA	BANCO BRADESCO	24.022.566/0001-82	BRADESCO FI IDKA PRÉ 2	344079-6/344069-9	IDKA-2	PAS	-	-	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,00%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA	ITAÚ-UNIBANCO	21.838.150/0001-49	ITAÚ ALOCAÇÃO DINAMICA FIC FI	0075/46710-0	ALOCAÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	73.493.324,28	D+1	ARTIGO 7º, INCISO IV,ALÍNEA "A"	40,00%	14,11%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA	BANCO SANTANDER	26.507.132/0001-06	SANTANDER RF ATIVO FIC FI	0680/450000175	ALOCAÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	22.529.907,43	D+1	ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	40,00%	4,33%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA	BANCO BTG PACTUAL	23.176.675/0001-91	BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	0001/000160730	IPCA + 6%	VÉRTICE	-	9.014.564,70	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,73%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA	BANCO PETRA	06.018.364/0001-85	FIDC PREMIUM	n/a	FIDC	M LIQUIDAÇÃO	-	1.188.338,32	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7º, INCISO VII, ALÍNEA "A"	5,00%	0,23%	0,25%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL	BANCO DO BRASIL	10.418.335/0001-88	BB PREVID FIA GOV CORPORATIVA	1963-1/13.618-2	GOVERNANÇA	PAS		7.616.528,63	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I, ALÍNEA "A"	20,00%	1,46%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA 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		9.993.429,77	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,92%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL	BANCO DO BRASIL	09.005.805/0001-00	BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1963-1/13.618-1	IBOVESPA	ATIVO		9.248.295,15	D+3	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,78%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL	BANCO SAFRA	21.595.829/0001-54	SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0146/00001173-1	MULTIMERC.	ATIVO		25.910.776,51	D+2	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	4,98%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL	BANCO SAFRA	17.253.869/0001-40	SAFRA CARTEIRA PREMIUM INSTIT MULTIMERCADO	0146/00001173-0	MULTIMERC.	ATIVO		-	D+1	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	0,00%	0,20%	10% exceder o índice	BAIXO
RENTA VARIÁVEL	BANCO SAFRA	19.436.818/0001-80	SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	0146/000011731	MERC. EXTERNO	ATIVO		24.176.947,91	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	4,64%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL	VINCI PARTNERS	13.396.703/0001-22	VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	2856-8/651.358-1	MULTIMERC.	ATIVO		10.240.091,86	D+2	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,97%	1,00%	20% exceder o índice	MÉDIO
RENTA VARIÁVEL	VINCI PARTNERS	28.470.587/0001-11	VINCI MOSAICO FIA	2856/20606-7	AÇÕES LIVRES	ATIVO		5.592.577,27	D+32	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,07%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL	WESTERN ASSET	17.453.850/0001-48	WESTERN ASSE T US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	001/78910000-1	MULTIMERC.	ATIVO		9.175.849,94	D+1	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,76%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL	CAIXA EC. FEDERAL	03.737.188/0001-43	CAIXA RV-30 FI MULTIMERCADO	0290/006/330-9	MULTIMERC.	ATIVO		7.191.589,85	D+4	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,38%	1,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL	CAIXA EC. FEDERAL	13.767.159/0001-88	CAIXA FIP INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA	0290/006/9-1	FIP	ATIVO		22.403,10	06/2020	ARTIGO 8º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	5,00%	0,00%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL	AZ QUEST INVEST	11.392.165/0001-72	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	2856/27.966-8	SMALL CAPS	ATIVO		13.549.649,97	D+30	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,60%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL	ITAÚ-UNIBANCO	08.817.414/0001-10	ITAÚ FICFIA RPI IBOVESPA	0075/46710-0	AÇÕES LIVRES	ATIVO		10.707.504,34	D+5	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,06%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL	SULAMERICA DTVM	11.458.144/0001-02	SULAMÉRICA FIA EQUITIES	2856-8/19.615-0	AÇÕES LIVRES	ATIVO		7.485.923,85	D+4	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,44%	1,50%	20% exceder o índice%	ALTO
RENTA VARIÁVEL	BANCO BNP PARIBAS	12.239.939/0001-92	BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	001/65045 001	VALOR	ATIVO		7.538.696,69	D+30	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,45%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL	BANCO BRADESCO	03.660.879/0001-96	BRADESCO FIA SELECTION	13/344069-9	AÇÕES LIVRES	ATIVO		12.058.153,10	D+4	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,32%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL	BANCO BRADESCO	06.988.623/0001-09	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	13/344069-9	SMALL CAPS	ATIVO		5.711.135,32	D+4	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,10%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL	BANCO SANTANDER	17.804.792/0001-50	SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	0680/450000175	MERC. EXTERNO	ATIVO		10.338.614,54	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,10%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL	BANCO BTG PACTUAL	11.977.794/0001-64	BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIQ FIA	0001/000160730	AÇÕES LIVRES	ATIVO		11.699.933,93	D+33	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,25%	3,00%	N POSSUI	ALTO
TOTAL RENTA FIXA								332.424.713,40			100,00%	63,84%			
TOTAL RENTA VARIÁVEL								188.258.101,73			40,00%	35,27%			
TOTAL GERAL								520.682.815,13							

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS
ECONOMISTA FUNPREV

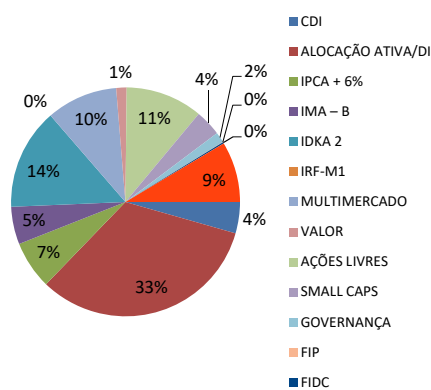
Donizete do Carmo dos Santos
Presidente da FUNPREV

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

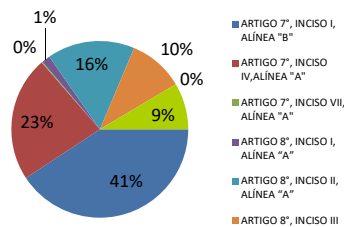
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CAIXA EC. FEDERAL	126.364.126,83	24,27%
BANCO DO BRASIL	112.503.695,05	21,61%
BANCO BRADESCO	39.172.291,71	7,52%
ITAU-UNIBANCO	84.200.828,62	16,17%
BANCO SAFRA	50.087.724,42	9,62%
BANCO BTG PACTUAL	20.714.498,63	3,98%
BANCO SANTANDER	32.868.521,97	6,31%
WESTERN ASSET	9.175.849,94	1,76%
AZ QUEST INVEST	13.549.649,97	2,60%
BANCO BNP PARIBAS	7.538.696,69	1,45%
BANCO FINAXIS	1.188.338,32	0,23%
VINCI PARTNERS	15.832.669,13	3,04%
SULAMERICA ASSET	7.485.923,85	1,44%
TOTAL :	520.682.815,13	100,00%

Diversificação por Instituições Financeiras


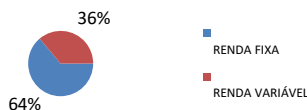
CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CDI	23.099.486,02	4,44%
ALOCÇÃO ATIVA/DI	170.751.944,70	32,79%
IPCA + 6%	35.367.953,81	6,79%
IMA – B	27.507.678,23	5,28%
IDKA 2	74.509.312,32	14,31%
IRF-M1	-	0,00%
MULTIMERCADO	52.518.308,16	10,09%
VALOR	7.538.696,69	1,45%
AÇÕES LIVRES	56.792.387,64	10,91%
SMALL CAPS	19.260.785,29	3,70%
GOVERNANÇA	7.616.528,63	1,46%
FIP	22.403,10	0,00%
FIDC	1.188.338,32	0,23%
MERCADO EXTERIOR	44.508.992,22	8,55%
TOTAL :	520.682.815,13	100,00%

Diversificação por Categoria de Ativos


ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	212.113.657,35	40,74%
ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	119.122.717,73	22,88%
ARTIGO 7º, INCISO VII, ALÍNEA "A"	1.188.338,32	0,23%
ARTIGO 8º, INCISO I, ALÍNEA "A"	7.616.528,63	1,46%
ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	83.591.869,62	16,05%
ARTIGO 8º, INCISO III	52.518.308,16	10,09%
ARTIGO 8º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	22.403,10	0,00%
ARTIGO 9º, INCISO II e III ALÍNEA "A"	44.508.992,22	8,55%
TOTAL :	520.682.815,13	100,00%

Diversificação por Enquadramento Legal


SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	332.424.713,40	63,84%
RENDA VARIÁVEL	188.258.101,73	36,16%
TOTAL :	520.682.815,13	100,00%
RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA	
RENTABILIDADE NO MÊS	-1,23%	
META ATUARIAL NO MÊS	1,69%	
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	-0,32%	
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	-7,80%	
META GERENCIAL ANO	0,66%	
META ATUARIAL ANO	13,07%	
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	-2,45%	

Diversificação por Segmento

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

(NÍVEL DE INCERTEZA)	MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 23.099.486,02
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 290.869.302,69
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 206.714.026,42
TOTAL		R\$ 520.682.815,13



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS
SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS
MÊS: OUTUBRO/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, <u>ALÉM</u> 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 abaixo da meta gerencial tendo em vista uma posição mais conservadora na renda fixa e maior exposição à



**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



volatilidade na renda variável. No segmento de renda variável houve diminuição de exposição em fundos de ações diante das desvalorizações das cotas dos fundos e 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. Foi observado desenquadramento passivo no artigo referente aos fundos multimercados em 0,09% justamente devido a diminuição da carteira no geral e a boa rentabilidade dos fundos que compõem o segmento. O desenquadramento passivo ocorre quando uma posição aplicada se altera diante de uma valorização ou desvalorização provocada pelo mercado, sem que haja movimentações que acarretem alteração de percentual investido. O Comitê observa que já foi apresentada proposta de correção pelo Núcleo de Investimentos, devidamente acompanhada pelo Comitê e encaminhada ao Conselho Curador para deliberação visando regularizar os percentuais. O processo passará pelo Conselho Curador para deliberação.

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: _____



**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



ATA Nº 24/2021

DATA: 07/12/2021

Márcia A. R. Oliveira

Presidente do Comitê de Investimentos

Sérgio R. C. Alberto

Presidente do Conselho Curador em exercício

Soraya de Góes

Presidente do Conselho Fiscal