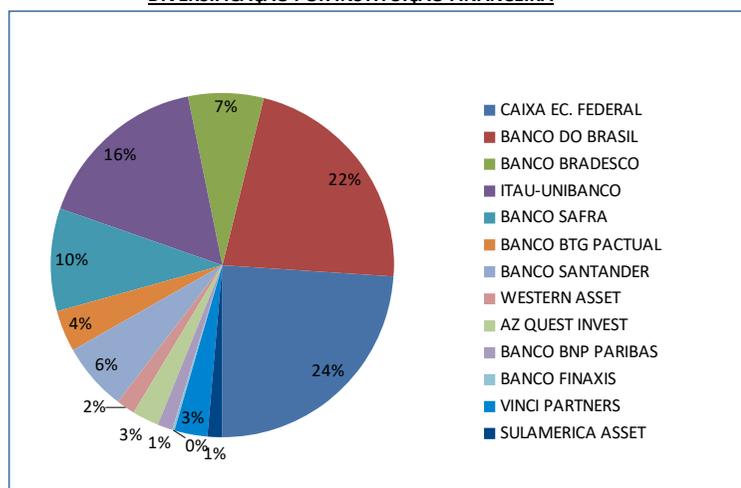


RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE NOVEMBRO/2021

FUNDO	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	SALDO APLICADO	RENTABILIDADE				DISPONIBILIDADE PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 3922/2010 E 4695/2018	LIMITE LEGAL	% APLICADO	TX ADM	TAXA PERFORMANCE	NÍVEL DE RISCO (Incerteza)	
					MÊS	ANO	12 M	24 M								
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 07.442.078/0001-05 BB IMA-B TÍT. PÚBLICOS PREVID FII	IMA-B	PAS	-	28.454.038,44	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,50%	0,20%	N POSSUI	ALTO	
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 19.523.305/0001-06 BB FII PREVID TP IPCA VII	IPCA + 6%	VÉRTICE	-	8.808.879,18	0,00%	0,00%	0,00%	FUNDO NOVO	2020 e 2022	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,70%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO	
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 13.322.205/0001-35 BB FII PREVID IDKA-2	IDKA 2	PAS	26.654.056,30	24.406.150,75	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	9,86%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO	
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 23.215.097/0001-55 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	75.405.707,75	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	14,56%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO	
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.206/0001-87 CAIXA BRASIL FII REF DI LP	CDI	PAS	-	1.406.223,09	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	40,00%	0,27%	0,20%	N POSSUI	BAIXO	
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 14.386.926/0001-71 CAIXA BRASIL FII IDKA IPCA 2A	IDKA 2	PAS	15.455.563,99	6.374.377,91	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,22%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO	
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.658/0001-93 CAIXA BRASIL FII IMA-B TP	IMA-B	PAS	-	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,00%	0,20%	N POSSUI	ALTO	
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 20.139.895/0001-78 CAIXA BRASIL FII 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	18.173.915,69	-	0,00%	0,00%	0,00%	FUNDO NOVO	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	3,51%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO	
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.566/0001-82 BRADESCO FII IDKA PRÉ 2	IDKA 2	PAS	-	-	0,00%	0,00%	FUNDO NOVO	FUNDO NOVO	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,00%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO	
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 03.399.411/0001-90 BRADESCO FII REF DI PREMIUM	CDI	PAS	-	19.485.757,96	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	40,00%	3,76%	0,20%	N POSSUI	BAIXO	
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.566/0001-82 BRADESCO FII IDKA PRÉ 2	IDKA-2	PAS	-	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,00%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO	
RENDA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 21.838.150/0001-49 ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC FII	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	74.702.278,37	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	40,00%	14,43%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO	
RENDA FIXA BANCO SANTANDER 26.507.132/0001-06 SANTANDER RF ATIVO FIC FII	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	22.834.266,23	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	40,00%	4,41%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO	
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 23.176.675/0001-91 BTG PACTUAL 2024 TP FII RF	IPCA + 6%	VÉRTICE	-	9.244.717,20	0,00%	0,00%	FUNDO NOVO	FUNDO NOVO	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,79%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO	
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.018.364/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO	-	1.181.803,25	0,00%	0,00%	n/a	n/a	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7º, INCISO VII, 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	-	7.481.570,87	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I, ALÍNEA "A"	20,00%	1,45%	1,00%	N POSSUI	ALTO	
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 17.413.636/0001-68 BB GLOBAL SELECT EQUIT INV. EXTERIOR FII MULT	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	9.913.796,61	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,91%	1,00%	N POSSUI	ALTO	
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.805/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO	-	8.947.072,78	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+3	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,73%	1,00%	N POSSUI	ALTO	
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21.595.829/0001-54 SAFRA S&P REAIS PB FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO	-	25.778.693,37	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+2	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	4,98%	1,00%	N POSSUI	ALTO	
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 17.253.869/0001-40 SAFRA CARTEIRA PREMIUM INSTIT MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO	-	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	0,00%	0,20%	10% exceder o índice	BAIXO	
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.436.318/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	24.228.393,26	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	4,68%	1,50%	N POSSUI	ALTO	
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 13.336.703/0001-22 VINCI VALOREM FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO	-	10.380.018,73	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+2	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	2,00%	1,00%	20% exceder o índice	MÉDIO	
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	5.789.060,95	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+32	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,12%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO	
RENDA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.453.850/0001-48 WESTERN ASSET US INDEX 500 FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO	-	9.129.599,89	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,76%	1,00%	N POSSUI	ALTO	
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 03.737.180/0001-43 CAIXA RV-30 FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO	-	7.199.987,15	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,39%	1,00%	20% exceder o índice	ALTO	
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 13.767.159/0001-88 CAIXA FII INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA	FII	ATIVO	-	-	0,00%	0,00%	0,00%	n/a	06/2020	ARTIGO 8º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	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	-	13.010.149,60	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+30	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,51%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO	
RENDA VARIÁVEL ITAÚ-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAÚ FIC FIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	10.486.826,21	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+5	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,03%	1,00%	N POSSUI	ALTO	
RENDA VARIÁVEL SULAMÉRICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMÉRICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	7.061.362,13	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,36%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO	
RENDA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.939/0001-82 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO	-	7.333.157,38	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+30	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,42%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO	
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.660.879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	11.821.615,89	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,28%	2,00%	N POSSUI	ALTO	
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 08.988.823/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO	-	5.530.266,25	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,07%	1,50%	N POSSUI	ALTO	
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	10.130.828,03	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,07%	1,00%	N POSSUI	ALTO	
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FII FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	10.915.290,31	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+33	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,11%	3,00%	N POSSUI	ALTO	
TOTAL RENDA FIXA				332.587.736,11							100,00%	64,24%				
TOTAL RENDA VARIÁVEL				185.137.689,41							40,00%	34,87%				
TOTAL GERAL				517.725.425,52												

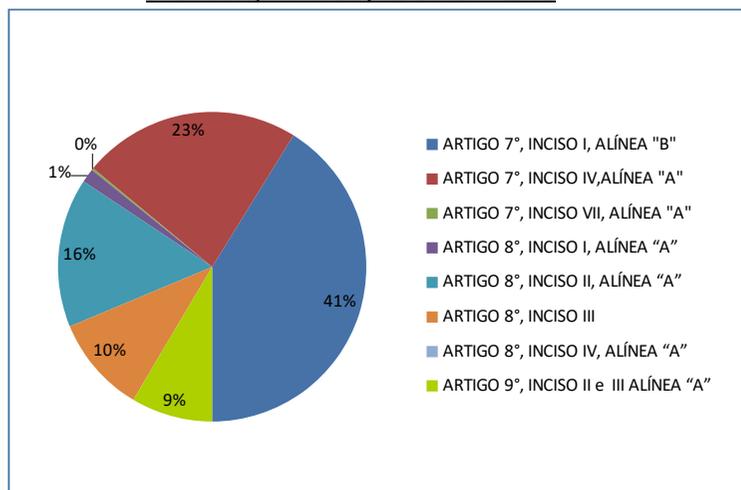
RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE NOVEMBRO/2021

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CAIXA EC. FEDERAL	124.015.775,58	23,95%
BANCO DO BRASIL	114.665.564,93	22,15%
BANCO BRADESCO	36.837.640,10	7,12%
ITAU-UNIBANCO	85.189.104,58	16,45%
BANCO SAFRA	50.007.086,63	9,66%
BANCO BTG PACTUAL	20.160.007,51	3,89%
BANCO SANTANDER	32.965.094,26	6,37%
WESTERN ASSET	9.129.599,89	1,76%
AZ QUEST INVEST	13.010.149,60	2,51%
BANCO BNP PARIBAS	7.333.157,38	1,42%
BANCO FINAXIS	1.181.803,25	0,23%
VINCI PARTNERS	16.169.079,68	3,12%
SULAMERICA ASSET	7.061.362,13	1,36%
TOTAL	517.725.425,52	100,00%

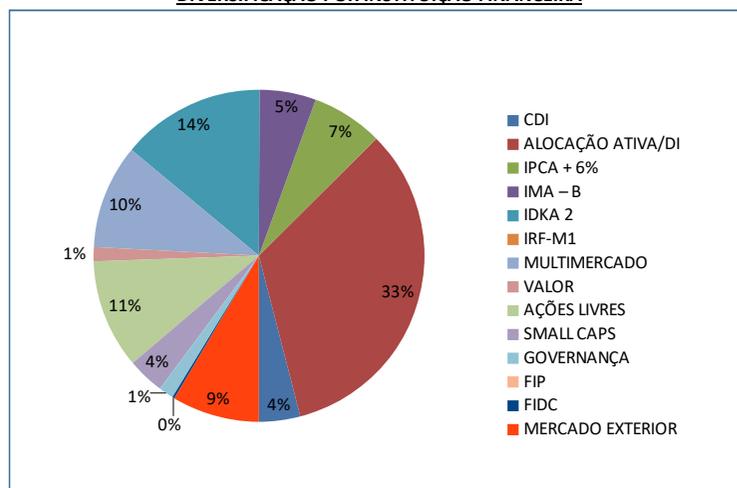
DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL



ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7, INCISO I, ALÍNEA "B"	212.977.407,21	41,14%
ARTIGO 7, INCISO IV, ALÍNEA "A"	118.428.525,65	22,87%
ARTIGO 7, INCISO VII, ALÍNEA "A"	1.181.803,25	0,23%
ARTIGO 8, INCISO I, ALÍNEA "A"	7.481.570,87	1,45%
ARTIGO 8, INCISO II, ALÍNEA "A"	80.894.801,50	15,63%
ARTIGO 8, INCISO III	52.488.299,14	10,14%
ARTIGO 8, INCISO IV, ALÍNEA "A"	44.273.017,90	8,55%
ARTIGO 9, INCISO II e III ALÍNEA "A"	44.273.017,90	8,55%
TOTAL	517.725.425,52	100,00%

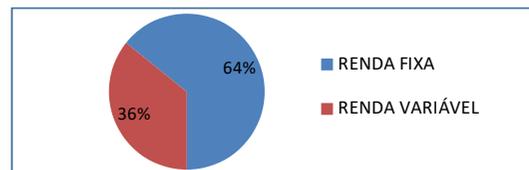
LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CDI	20.891.981,05	4,04%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI	172.942.252,35	33,40%
IPCA + 6%	36.227.512,07	7,00%
IMA - B	28.454.038,44	5,50%
IDKA 2	72.890.148,95	14,08%
IRF-M1		
MULTIMERCADO	52.488.299,14	10,14%
VALOR	7.333.157,38	1,42%
AÇÕES LIVRES	55.021.228,27	10,63%
SMALL CAPS	18.540.415,85	3,58%
GOVERNANÇA	7.481.570,87	1,45%
FIP		
FIDC	1.181.803,25	0,23%
MERCADO EXTERIOR	44.273.017,90	8,55%
TOTAL	517.725.425,52	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	332.587.736,11	64,24%
RENDA VARIÁVEL	185.137.689,41	35,76%
TOTAL	517.725.425,52	100,00%

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	0,54%
META ATUARIAL NO MÊS	1,39%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	0,21%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	-8,32%
META GERENCIAL ANO	1,29%
META ATUARIAL ANO	14,64%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	1,43%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)		MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 20.891.981,05	4,04%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 292.439.932,10	56,49%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 204.393.512,37	39,48%
TOTAL		R\$ 517.725.425,52	

DAVID JOSÉ FRANÇO SO
Presidente Substituto



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS
SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS
MÊS: NOVEMBRO/2021

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS
ATA Nº 43/2021 DATA: 16/12/2021

	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 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, <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 em aproximadamente 1% tendo como principal motivo a elevada rentabilidade dos fundos de investimento no exterior, acompanhada das quedas dos indicadores de renda fixa e principalmente no segmento de renda variável no segundo semestre. Tais fatos traduzem o comportamento do mercado e



**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



não exigem imediata correção na forma de cálculo da meta gerencial. O desenquadramento passivo ocorrido entre os meses de outubro e novembro já foi corrigido no mês de dezembro conforme as movimentações executadas, objeto do processo 2605/2021 e já não deverão constar no relatório do mês de dezembro.

ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR

ATA REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA Nº 11/2021

DATA: 27/12/2021

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

Observações: _____.

ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL

ATA Nº 25/2021

DATA: 21/12/2021

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

Observações: Cientes de que o desenquadramento quanto aos percentuais aplicados previstos na Política de Investimentos já foram sanados, em atendimento ao previsto na Resolução CMN 3922/2010 em 14/12/2021 e que a rentabilidade da carteira no ano está abaixo da meta gerencial em aproximadamente 1%.

Márcia A. R. Oliveira

Presidente do Comitê de Investimentos

David José Françoso

Presidente do Conselho Curador

Soraya de Góes

Presidente do Conselho Fiscal