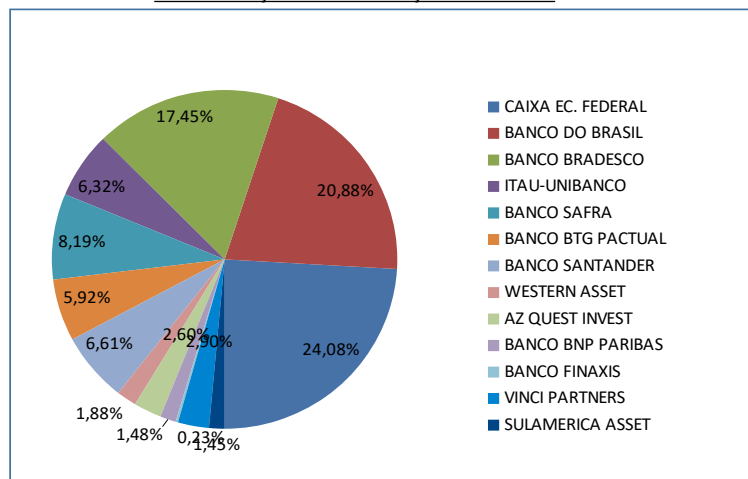


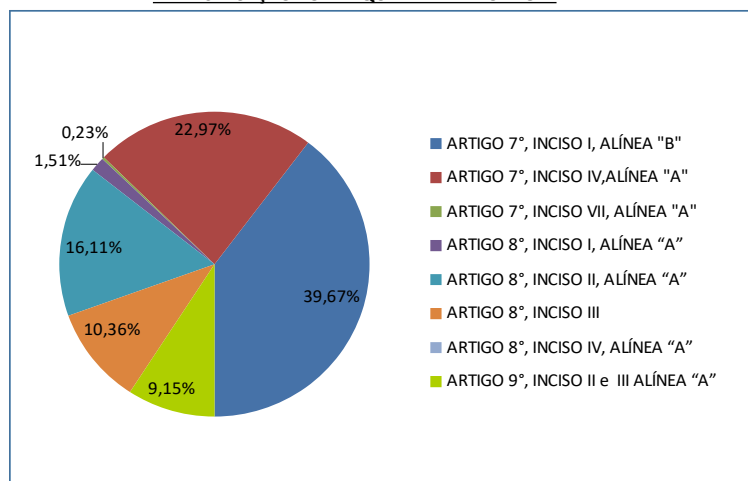
RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE DEZEMBRO/2021

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



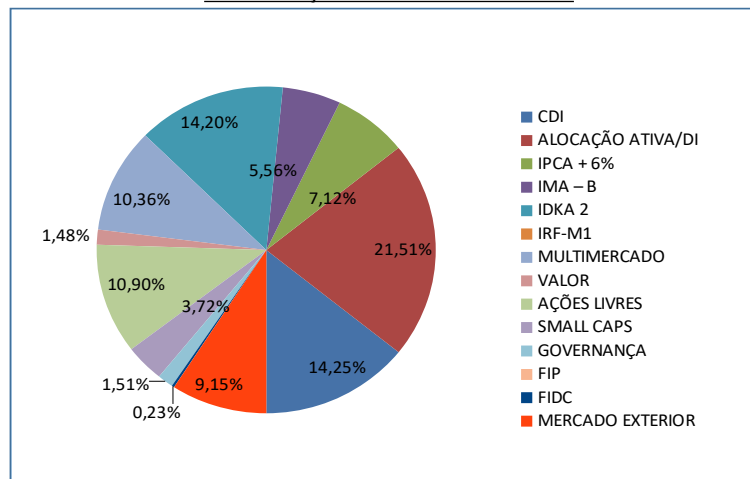
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CAIXA EC. FEDERAL	123.388.081,75	24,08%
BANCO DO BRASIL	107.005.540,54	20,88%
BANCO BRADESCO	89.420.861,39	17,45%
ITAU-UNIBANCO	32.374.211,42	6,32%
BANCO SAFRA	41.937.142,28	8,19%
BANCO BTG PACTUAL	30.351.503,46	5,92%
BANCO SANTANDER	33.879.550,78	6,61%
WESTERN ASSET	9.630.772,98	1,88%
AZ QUEST INVEST	13.311.272,28	2,60%
BANCO BNP PARIBAS	7.607.850,11	1,48%
BANCO FINAXIS	1.178.296,74	0,23%
VINCI PARTNERS	14.865.546,68	2,90%
SULAMERICA ASSET	7.409.864,92	1,45%
TOTAL	512.360.495,33	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL



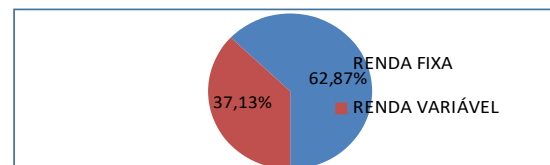
ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	203.237.558,06	39,67%
ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	117.699.476,05	22,97%
ARTIGO 7º, INCISO VII, ALÍNEA "A"	1.178.296,74	0,23%
ARTIGO 8º, INCISO I, ALÍNEA "A"	7.738.852,14	1,51%
ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	82.535.211,83	16,11%
ARTIGO 8º, INCISO III	53.067.987,47	10,36%
ARTIGO 8º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	46.903.113,04	9,15%
ARTIGO 9º, INCISO II e III ALÍNEA "A"		
TOTAL	512.360.495,33	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CDI	72.998.735,11	14,25%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI	110.187.040,08	21,51%
IPCA + 6%	36.496.283,44	7,12%
IMA - B	28.511.909,60	5,56%
IDKA 2	72.743.065,88	14,20%
IRF-M1		
MULTIMERCADO	53.067.987,47	10,36%
VALOR	7.607.850,11	1,48%
AÇÕES LIVRES	55.870.548,00	10,90%
SMALL CAPS	19.056.813,72	3,72%
GOVERNANÇA	7.738.852,14	1,51%
FIP		
FIDC	1.178.296,74	0,23%
MERCADO EXTERIOR	46.903.113,04	9,15%
TOTAL	512.360.495,33	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	322.115.330,85	62,87%
RENDA VARIÁVEL	190.245.164,48	37,13%
TOTAL	512.360.495,33	100,00%

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	1,45%
META ATUARIAL NO MÊS	1,17%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	1,68%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	-9,27%
META GERENCIAL ANO	3,38%
META ATUARIAL ANO	15,98%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	10,51%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS		
(NÍVEL DE INCERTEZA)	MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 72.998.735,11
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 228.495.804,78
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 200.662.499,25
TOTAL		R\$ 502.157.039,14

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

DONIZETE DO CARMO DOS SANTOS
Presidente – FUNPREV

RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE DEZEMBRO/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 TIT. PÚBLICOS PREVID FI	IMA-B	PAS	-	28.511.909,60	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,56%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 19.523.305/0001-06 BB FI PREVID TP IPCA VII	IPCA + 6%	VÉRTICE	-	8.860.206,83	0,00%	0,00%	0,00%	FUNDO NOVO	2020 e 2022	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,73%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 13.322.205/0001-35 BB FI PREVID IDKA-2	IDKA 2	PAS	27.275.675,16	14.567.725,16	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	8,17%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 23.215.097/0001-55 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	65.486.299,14	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	12,78%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS	-	1.381.971,47	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 FI IDKA IPCA 2A	IDKA 2	PAS	19.082.838,24	11.816.827,32	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	6,03%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.659/0001-93 CAIXA BRASIL FI 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 20.139.595/0001-78 CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	18.328.506,11	-	0,00%	0,00%	0,00%	FUNDO NOVO	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	3,58%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.566/0001-82 BRADESCO FI IDKA PRÉ 2	IDKA 2	PAS	-	-	0,00%	0,00%	0,00%	FUNDO NOVO	FUNDO NOVO	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 FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS	-	71.616.763,64	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	40,00%	13,98%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.566/0001-82 BRADESCO FI 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 ITAU-UNIBANCO 21.838.150/0001-49 ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC FI	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	21.690.286,26	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	40,00%	4,23%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO SANTANDER 26.507.132/0001-06 SANTANDER RF ATIVO FIC FI	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	23.010.454,68	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	40,00%	4,49%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 23.176.675/0001-91 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE	-	9.307.570,50	0,00%	0,00%	0,00%	FUNDO NOVO	FUNDO NOVO	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,82%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.018.364/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO	-	1.178.296,74	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	-	7.738.852,14	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I, ALÍNEA "A"	20,00%	1,51%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 17.413.636/0001-68 BB GLOBAL SELECT EQUIT INV. EXTERIOR FI MULT	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	10.969.578,11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	2,14%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.805/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO	-	9.081.593,54	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+3	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,77%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21.595.829/0001-54 SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS	-	16.872.703,45	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+2	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	3,29%	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	-	10.203.456,19	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+2	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,99%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.436.818/0001-90 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	25.064.438,83	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	4,89%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 13.398.703/0001-22 VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO	-	9.069.415,38	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+2	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,77%	1,00%	20% exceder o índice	MÉDIO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	5.796.131,30	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+32	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,13%	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	-	9.630.772,98	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,88%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 03.737.188/0001-43 CAIXA RV-30 FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO	-	7.291.639,47	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO III	10,00%	1,42%	1,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 13.767.159/0001-88 CAIXA FIP INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA	FIP	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	-	13.311.272,28	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+30	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,60%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAU-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAU FIC FIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	10.683.925,16	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+5	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,09%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMERICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMERICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	7.409.864,92	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,45%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.939/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO	-	7.607.850,11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+30	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,48%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.660.879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	12.058.556,31	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,35%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 08.988.823/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO	-	5.745.541,44	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	1,12%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	10.869.096,10	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,12%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	10.840.476,77	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+33	ARTIGO 8º, INCISO II, ALÍNEA "A"	20,00%	2,12%	3,00%	N POSSUI	ALTO
TOTAL RENDA FIXA				322.115.330,85							100,00%	62,87%			
TOTAL RENDA VARIÁVEL											40,00%	36,13%			
TOTAL GERAL				512.360.495,33											



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

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS
ATA Nº 02/2022 DATA: 03/02/2022

	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, <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 de 2021 ficou abaixo da meta atuarial principalmente por dois motivos: a disparada da inflação medida pelo Índice de Preços ao Consumidor Amplo (IPCA) que compõe a meta atuarial e pela baixa rentabilidade proporcionada pelos principais indicadores do mercado financeiro ainda sob os efeitos da crise desencadeada pela



**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



pandemia e também pelo cenário doméstico de incertezas em relação ao quadro político-fiscal. No entanto, o resultado da carteira foi compatível com a meta gerencial que mede a possibilidade de retorno dentro o perfil de risco da Fundação. Verificamos também que os demais RPPS do mesmo porte e perfil da Funprev obtiveram retornos entre -1% a +3% cabendo esta variação aos níveis percentuais de exposição de cada RPPS aos respectivos segmentos. O Comitê verificou um novo desenquadramento passivo, novamente no segmento de multimercado, mesmo após as movimentações ocorridas em dezembro que tiveram entre seus objetivos, corrigir os percentuais aplicados. O desenquadramento, mais uma vez, foi provocado por conta das variações nos saldos das aplicações. O Comitê em conjunto com o Núcleo de Investimentos, espera que diante dos resultados de janeiro de 2022, o desenquadramento seja corrigido automaticamente diante dos resultados dos investimentos no mês de janeiro de 2022 e irá monitorar o fechamento para que, se necessário, proponha ao Conselho Curador, novas movimentações. Quanto ao desenquadramento no fundo BTG Pactual IPCA IV, o Comitê sugere que seja solicitada a correção por parte da consultoria em sua plataforma, tendo em vista que, a Resolução do Conselho Monetário Nacional nº 4963/2021, estabelece em seu artigo 19, § 3º que não se aplica o percentual limitador de 15% em fundos de investimentos compostos exclusivamente de títulos públicos federais. Logo, não há o que se falar em desenquadramento como destacado na plataforma da consultoria.

ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR

ATA REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA Nº 03/2022

DATA: 04/02/2022

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

Observações: _____.

ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL

ATA Nº 03/2022

DATA: 08/02/2022

	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



Márcia A. R. Oliveira

Presidente do Comitê de Investimentos

David José Françoso

Presidente do Conselho Curador

Soraya de Góes

Presidente do Conselho Fiscal