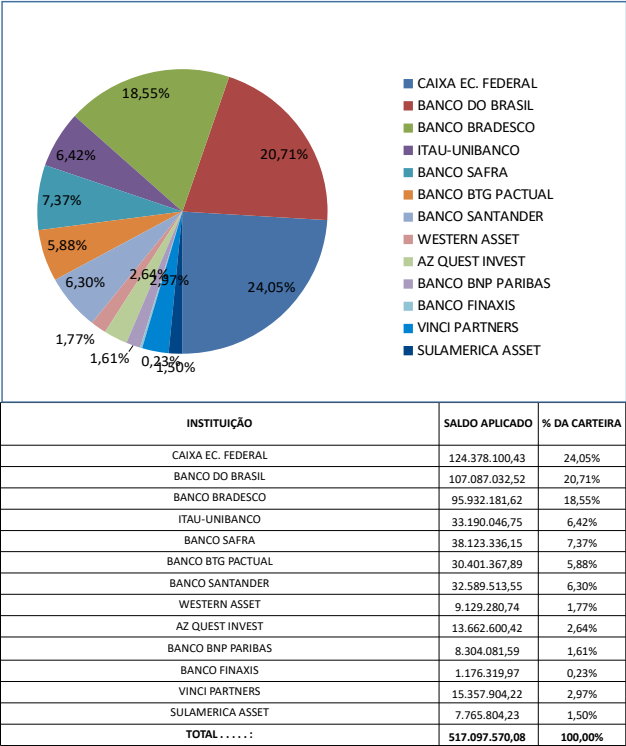
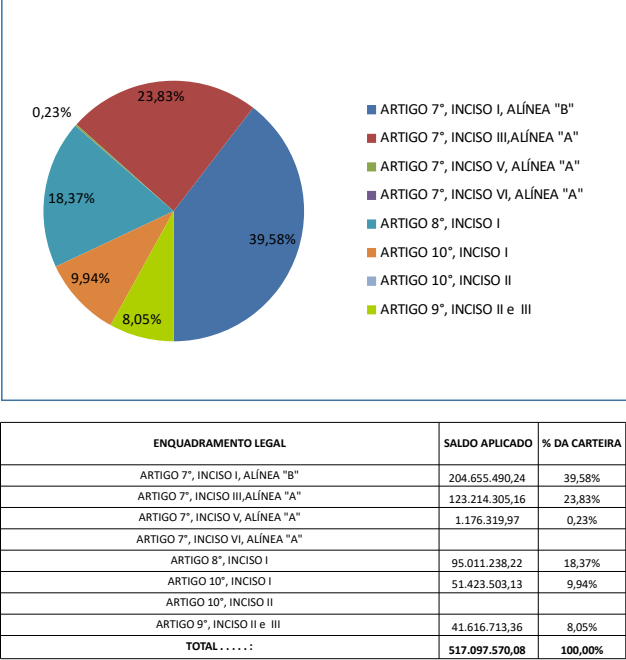


RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE JANEIRO/2022

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

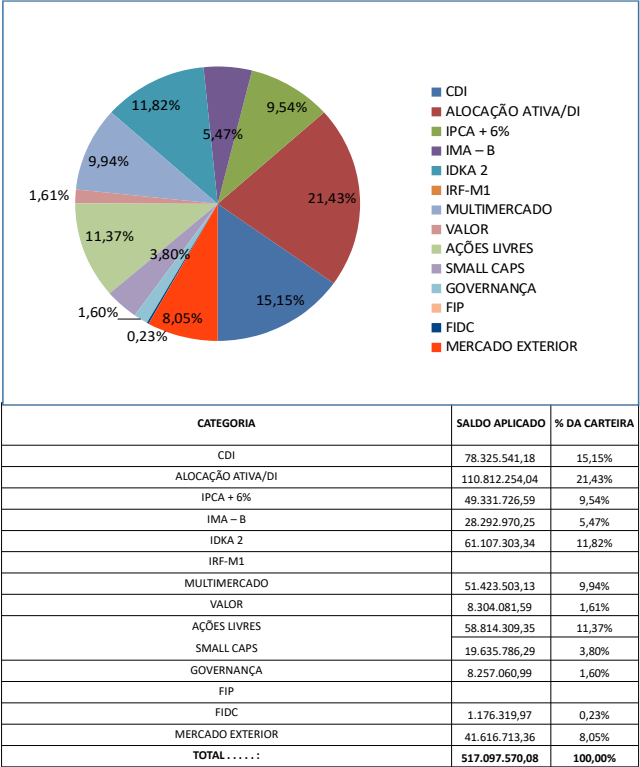


DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL

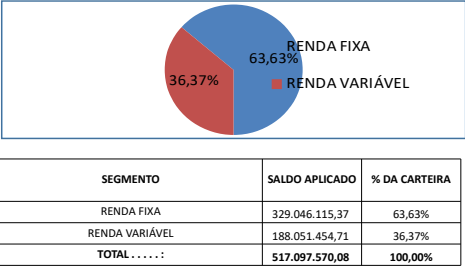


LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS



DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	329.046.115,37	63,63%
META ATUARIAL NO MÊS		
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	188.051.454,71	36,37%
EVOLUÇÃO DO PATRIMONIO NO ANO		
META GERENCIAL ANO		
META ATUARIAL ANO		
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO		

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)		MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 78.325.541,18	15,15%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 230.388.766,13	44,55%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 208.383.262,77	40,30%
TOTAL		R\$ 517.097.570,08	

DONIZETE DO CARMO DOS SANTOS
Presidente – FUNPREV

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

FUNDO	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	SALDO APLICADO	RENTABILIDADE				DISPONIBILIDADE PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 4963/2021	LIMITE LEGAL	% APLICADO	TX ADM	TAXA PERFORMANCE	NÍVEL DE RISCO (Incerteza)
					MÊS	ANO	12 M	24 M							
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 07.442.078/0001-05 BB IMA-B TIT. PÚBLICOS - PREVID FI	IMA-B	PAS	-	28.292.970,25	0,00%	0,00%	0,00%		D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,47%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 19.523.305/0001-06 BB FI PREVID TP IPCA VII	IPCA + 6%	VÉRTICE	-	8.910.206,63	0,00%	0,00%	0,00%	FUNDO NOVO	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,72%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 13.322.205/0001-35 BB FI PREVID IDKA-2	IDKA 2	PAS	27.902.470,81	1.801.585,91	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,74%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 23.215.097/0001-55 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	65.923.490,06	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	12,75%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS	-	1.242.150,87	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	0,24%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 14.386.926/0001-71 CAIXA BRASIL FI IDKA IPCA 2A	IDKA 2	PAS	22.316.879,76	9.086.366,86	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	6,07%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.658/0001-93 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
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 20.139.595/0001-78 CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	18.322.765,69	-	0,00%	0,00%	0,00%	FUNDO NOVO	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	3,54%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.566/0001-82 BRADESCO FI 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
RENTA FIXA BANCO BRADESCO 03.399.411/0001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS	-	77.083.390,31	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	14,91%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA 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
RENTA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 21.838.150/0001-49 ITAÚ ALOCAÇÃO DINAMICA FIC FI	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	21.803.588,63	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 7º, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	4,22%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO SANTANDER 26.507.132/0001-06 SANTANDER RF ATIVO FIC FI	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	23.085.175,35	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	4,46%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO BTG PACTUAL 23.176.875/0001-91 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE	-	9.346.083,30	0,00%	0,00%	FUNDO NOVO	FUNDO NOVO	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,81%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO PETRA 06.018.364/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO	-	1.176.319,97	0,00%	0,00%	n/a	n/a	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7º, INCISO V, 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	GOVERNANÇA	PAS	-	8.257.060,99	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,60%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 17.413.636 /0001-68 BB GLOBAL SELECT EQUIT INV. EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	9.986.936,60	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,93%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.805/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO	-	9.183.130,36	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,78%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21.595.829/0001-54 SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS	-	15.997.897,59	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	3,09%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 36.499.594/0001-74 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI	MULTIMERC.	PAS	-	9.672.395,45	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,87%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.436.818/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	22.125.438,56	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	4,28%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 13.396.703/0001-22 VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO	-	9.137.482,16	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,77%	1,00%	20% exceder o índice	MÉDIO
RENTA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	6.220.422,06	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,20%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.453.850/0001-48 WESTERN ASSE T US INDEX 500 FI	MULTIMERC.	PAS	-	9.129.280,74	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+1	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,77%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 03.737.188/0001-43 CAIXA RV-30 FI MULTIMERCADO	MUITIMERC.	ATIVO	-	7.486.447,19	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,45%	1,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 13.767.159/0001-88 CAIXA FIP INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA	FIP	ATIVO	-	-	0,00%	0,00%	0,00%	n/a	11/2021	ARTIGO 10º, INCISO II	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	SMALL CAPS	ATIVO	-	13.662.600,42	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,64%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL ITAÚ-UNIBANCO 06.817.414/0001-10 ITAÚ FICFIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	11.386.458,12	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,20%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL SULAMERICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMERICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	7.765.804,23	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,50%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.939/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO	-	8.304.081,59	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,61%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.660.879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	12.875.605,44	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,49%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.888.623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO	-	5.973.185,87	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,16%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.864.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M.E	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	9.504.338,20	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,16%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	11.382.889,14	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	D+33	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,20%	3,00%	N POSSUI	ALTO
TOTAL RENTA FIXA				329.046.115,37								100,00%	63,63%		
TOTAL RENTA VARIÁVEL				188.051.454,71								70,00%	36,37%		
TOTAL GERAL				517.097.570,08											



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS
MÊS: JANEIRO/2022

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA Nº 05/2022

DATA: 10/03/2022

	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 mês de janeiro de 2022 foi de 0,22% negativa com destaque positivo para o índice Ibovespa que fechou positivo no mês em aproximadamente 6% e em 2021 apresentou a pior rentabilidade no ano. Em contrapartida, o segmento de investimento no exterior que colaborou com o resultado da carteira em 2021 fechou o mês de janeiro com



**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



rentabilidade negativa impactando o resultado da carteira, por conta das tensões envolvendo a Rússia e a Ucrânia e provocando a queda dos mercados no exterior. O resultado da carteira no primeiro mês de 2022 foi compatível com a meta gerencial que mede a possibilidade de retorno dentro o perfil de risco da Fundação.



**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: JANEIRO/2022

ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR

ATA REUNIÃO EXTRAORDINÁRIA Nº 05/2022

DATA: 11/03/2022

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

Observações: Este Conselho recebe os autos (Processo 579/2022) e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, as folhas 18, e aprova referido relatório de investimentos base Janeiro/2022, conforme item 03 da Ata da Reunião Ordinária 05/2022 do Comitê de Investimentos.

David José Françoso
Presidente do Conselho Curador

Gabriella Lucarelli Rocha
Membro do Conselho Curador

José Aparecido dos Santos
Membro do Conselho Curador

José Ricardo Ortolani
Membro do Conselho Curador

Sérgio Ricardo Correa Alberto
Membro do Conselho Curador

Ana Lúcia Corrêa da Conceição
Secretária do Conselho Curador



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS
SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS
MÊS: JANEIRO/2022

PARECER DO CONSELHO FISCAL
ATA Nº 05/2022 DATA: 10/03/2022

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

Observações: Este Conselho recebe os autos e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, as folhas 18, a rentabilidade da carteira em Janeiro foi negativa com destaque positivo para o índice Ibovespa, contudo ainda compatível com a meta gerencial que mede a possibilidade de retorno dentro do perfil de risco desta Fundação e aprova o referido relatório de investimentos base Janeiro de 2022, conforme item 03 da Ata de Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos.

Soraya de Goes
Presidente

Cristiane Nunes Pereira Dos Santos
Membro

Elson Reis
Membro

Lucas Chasseraux Tauil

Michele Carla Ribeiro Correa

Rubens Roberto Rodrigues de Souza