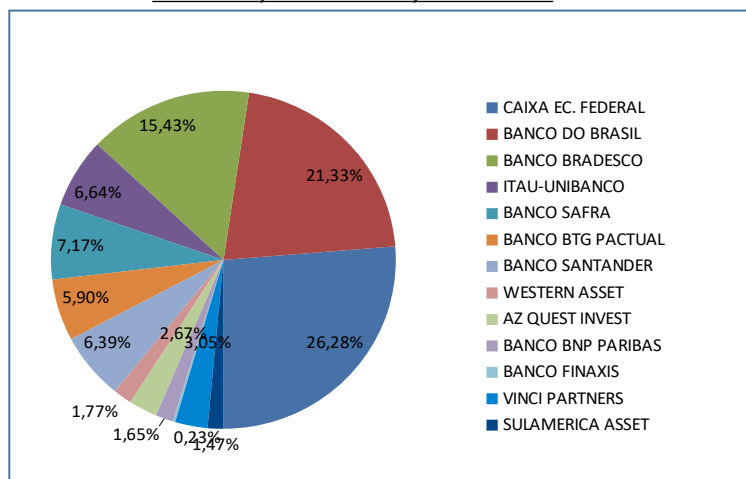


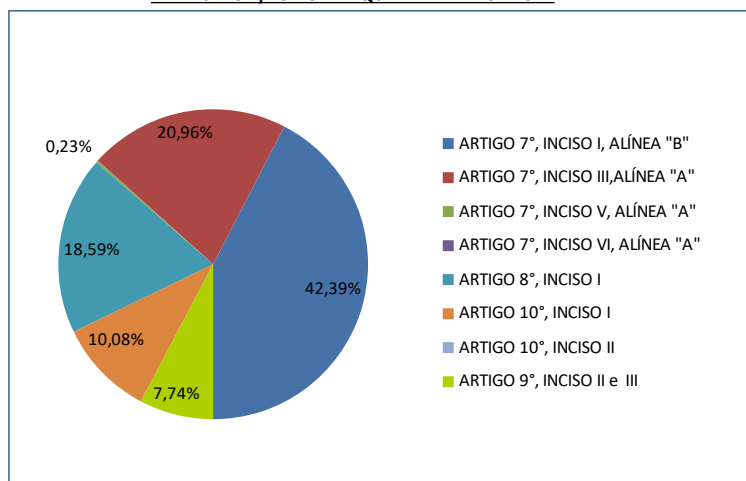
**RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE FEVEREIRO/2022**

**DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**



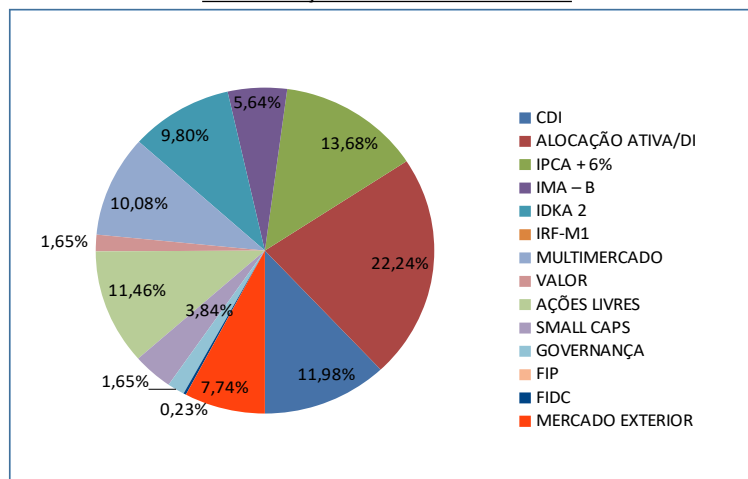
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CAIXA EC. FEDERAL	132.532.061,07	26,28%
BANCO DO BRASIL	107.593.914,20	21,33%
BANCO BRADESCO	77.848.832,68	15,43%
ITAU-UNIBANCO	33.501.977,15	6,64%
BANCO SAFRA	36.165.512,48	7,17%
BANCO BTG PACTUAL	29.776.656,88	5,90%
BANCO SANTANDER	32.252.752,46	6,39%
WESTERN ASSET	8.938.562,74	1,77%
AZ QUEST INVEST	13.461.285,96	2,67%
BANCO BNP PARIBAS	8.306.709,29	1,65%
BANCO FINAXIS	1.174.385,16	0,23%
VINCI PARTNERS	15.403.748,26	3,05%
SULAMERICA ASSET	7.410.680,57	1,47%
<b>TOTAL</b>	<b>504.367.078,90</b>	<b>100,00%</b>

**DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL**



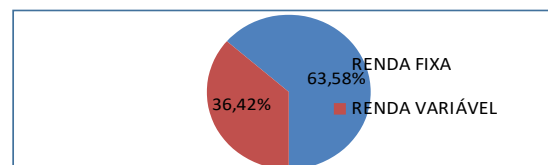
ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	213.820.083,60	42,39%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	105.694.941,71	20,96%
ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	1.174.385,16	0,23%
ARTIGO 7º, INCISO VI, ALÍNEA "A"		
ARTIGO 8º, INCISO I	93.781.157,17	18,59%
ARTIGO 10º, INCISO I	50.842.294,64	10,08%
ARTIGO 10º, INCISO II		
ARTIGO 9º, INCISO II e III	39.054.216,62	7,74%
<b>TOTAL</b>	<b>504.367.078,90</b>	<b>100,00%</b>

**DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS**



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CDI	60.437.718,67	11,98%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI	112.175.300,43	22,24%
IPCA + 6%	69.020.536,33	13,68%
IMA - B	28.443.933,74	5,64%
IDKA 2	49.437.536,14	9,80%
IRF-M1		
MULTIMERCADO	50.842.294,64	10,08%
VALOR	8.306.709,29	1,65%
AÇÕES LIVRES	57.802.530,18	11,46%
SMALL CAPS	19.348.644,13	3,84%
GOVERNANÇA	8.323.273,57	1,65%
FIP		
FIDC	1.174.385,16	0,23%
MERCADO EXTERIOR	39.054.216,62	7,74%
<b>TOTAL</b>	<b>504.367.078,90</b>	<b>100,00%</b>

**DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO**



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	320.689.410,47	63,58%
RENDA VARIÁVEL	183.677.668,43	36,42%
<b>TOTAL</b>	<b>504.367.078,90</b>	<b>100,00%</b>

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	-0,29%
META ATUARIAL NO MÊS	1,40%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	-0,51%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	-1,56%
META GERENCIAL ANO	0,11%
META ATUARIAL ANO	2,35%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	-21,70%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS		
(NÍVEL DE INCERTEZA)	MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 89.716.365,44
		17,79%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 210.582.408,72
		41,75%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 204.068.304,74
		40,46%
<b>TOTAL</b>		R\$ 504.367.078,90
		100,00%

**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 FEVEREIRO/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)
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 07.442.078/0001-05 BB IMA-B TÍT. PÚBLICOS_PREVID.FI	IMA-B	PAS	-	28.443.933,74	D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,64%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 19.523.309/0001-06 BB FI PREVID TP IPCA VII	IPCA + 6%	VÉRTICE	-	8.754.851,74	2022	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,74%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 13.322.205/0001-35 BB FI PREVID IDKA-2	IDKA 2	PAS	8.072.959,48	2.463.280,04	D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	2,09%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 44.345.590/0001-60 BB FI PREVID TP IPCA XXI	IPCA + 6%	PAS	-	12.525.235,55	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	2,48%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 15.486.093/0001-83 BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RF PREVIDENCIÁRIO	IPCA + 6%	PAS	20.523.795,03	-	2023	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,07%	0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 23.215.097/0001-55 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	66.918.077,39	-	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	13,27%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS	-	1.101.408,62	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	0,22%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 14.386.926/0001-71 CAIXA BRASIL FI IDKA IPCA 2A	IDKA 2	PAS	25.509.042,75	13.392.253,87	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	7,71%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.658/0001-93 CAIXA BRASIL FI IMA-B TP	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	IPCA + 6%	VÉRTICE	18.052.883,71	-	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	3,58%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.566/0001-82 BRADESCO FI IDKA PRÉ 2	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	CDI	PAS	-	59.336.310,05	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	11,76%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.566/0001-82 BRADESCO FI IDKA PRÉ 2	IDKA-2	PAS	-	-	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,00%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA ITAU-UNIBANCO 21.838.150/0001-49 ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC FI	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	22.006.041,50	D+1	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	4,36%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO SANTANDER 26.507.132/0001-06 SANTANDER RE ATIVO FIC FI	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	-	23.251.181,54	D+1	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	4,61%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO BTG PACTUAL 23.176.675/0001-91 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE	-	9.163.770,30	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,82%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO PETRA 06.018.384/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO	-	1.174.385,16	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	-	8.323.273,57	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,65%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 17.413.636/0001-68 BB GLOBAL SELECT EQUIT INV. EXTERIOR FI MULT	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	9.537.547,31	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,89%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.805/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO	-	8.949.037,74	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,77%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21.595.829/0001-54 SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS	-	15.650.414,09	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	3,10%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 36.499.594/0001-74 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS	-	9.467.240,49	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,88%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.436.818/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	20.515.098,39	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	4,07%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 13.396.703/0001-22 VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO	-	9.227.682,59	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,83%	1,00%	20% exceder o índice	MÉDIO
RENTA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	6.176.065,67	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,22%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.453.850/0001-48 WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS	-	8.938.562,74	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	MULTIMERC.	ATIVO	-	7.558.394,73	D+4	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,50%	1,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 13.767.159/0001-88 CAIXA FIP INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA	FIP	ATIVO	-	-	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	-	13.461.285,96	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,67%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL ITAU-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAU FIC FIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	11.495.935,65	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,28%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL SULAMERICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMERICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	7.410.680,57	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,47%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.339/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO	-	8.306.709,29	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,65%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.660.879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	12.625.164,46	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,50%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.988.623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO	-	5.887.358,17	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,17%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO	-	9.001.570,92	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,17%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	-	11.145.846,09	D+33	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,21%	3,00%	N POSSUI	ALTO
<b>TOTAL RENTA FIXA</b> . . . . .				<b>320.689.410,47</b>			<b>100,00%</b>	<b>63,58%</b>			
<b>TOTAL RENTA VARIÁVEL</b> . . . . .				<b>183.677.668,43</b>			<b>70,00%</b>	<b>36,42%</b>			
<b>TOTAL GERAL</b> . . . . .				<b>504.367.078,90</b>							



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

**PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS**  
**ATA Nº 10/2022**                      **DATA: 14/04/2022**

	<b>SIM</b>	<b>NÃO</b>	<b>PARCIAL</b>
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		
	<b>SIM</b>	<b>NÃO</b>	<b>NÃO SE APLICA</b>
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 fevereiro de 2022 foi de 0,29% negativa, com destaque positivo para a renda fixa que fechou positivo no mês após uma sequência de quedas. O Ibovespa fechou positivo mas não repetiu a performance do mês anterior. Novamente o segmento de investimento no exterior que colaborou com o resultado da carteira em 2021,



**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](http://www.funprevbauru.sp.gov.br)



---

fechou o mês de fevereiro com rentabilidade negativa impactando o resultado da carteira, por conta das tensões envolvendo o cenário internacional e o conflito entre Rússia e Ucrânia, provocando a queda dos mercados no exterior. 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.



**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**

**SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS**

**MÊS: FEVEREIRO/2022**

**ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR**

**ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 08/2022**

**DATA: 27/04/2022**

	<b>SIM</b>	<b>NÃO</b>
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 42 a 47, e aprova referido relatório de investimentos base Fevereiro/2022, conforme item 05 da Ata da Reunião Ordinária 10/2022 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

\_\_\_\_\_  
Neusa Maria Ferraz Valdo  
Membro do Conselho Curador

\_\_\_\_\_  
Zenir Alvarenga Alves  
Secretária do Conselho Curador



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

PARECER DO CONSELHO FISCAL

ATA Nº 08/2022

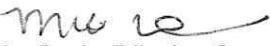
DATA: 29/04/2022

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

**Observações:** Este conselho após análise dos relatórios mensais e demais informações pertinentes a carteira de investimentos data base fevereiro/2022, elaborado pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos às fls. 27-42, do parecer emitido pelo Cômite de Investimentos às fls. 46-47, da análise e aprovação do relatório de investimentos pelo conselho Curador às fls.71, conforme item 6 da ata nº08/2022 às fls 66-67, manifesta-se FAVORÁVEL as aprovações, considerando que muito embora o resultado da rentabilidade tenha sido negativa, encontra-se compatível com a meta gerencial definida na política de investimentos com possibilidade de retorno dentro o perfil de risco da Fundação. Verificado ainda que os percentuais aplicados respeitam os limites previstos tanto na política de investimentos quanto na Resolução CMN 4963/2021 e por fim foram realizadas movimentações estratégicas, ALÉM das rotineiras de fluxo de caixa e pagamentos.

  
Cristiane Nunes Pereira dos Santos

Membro do Conselho Fiscal

  
Michele Carla Ribeiro Correa

Membro do Conselho Fiscal

  
Valderéz Alves Cardoso


Secretária do Conselho Fiscal

  
Elson Reis

Membro do Conselho Fiscal

  
Rubens R.R. de Souza

Membro do Conselho Fiscal

  
Soraya de Góes

Presidente do Conselho Fiscal