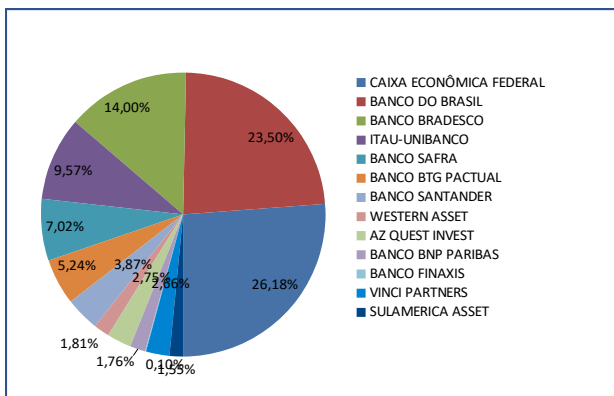


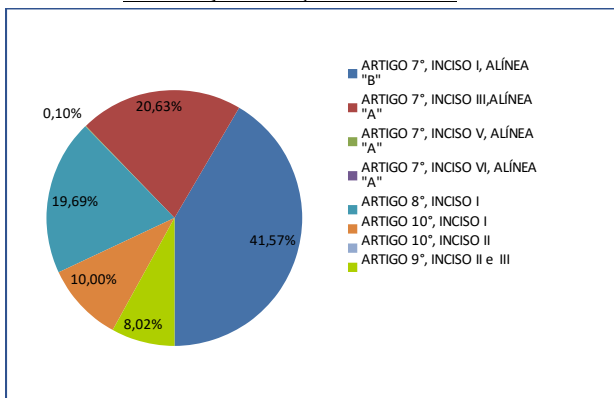
RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE AGOSTO/2022

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



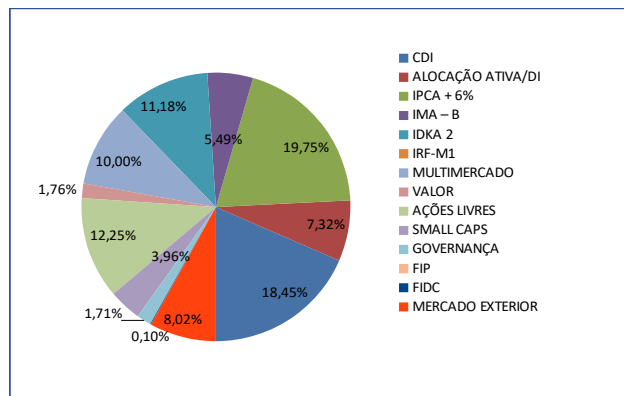
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	122.553.148,75	26,18%
BANCO DO BRASIL	110.021.221,18	23,50%
BANCO BRADESCO	65.568.967,95	14,00%
ITAU-UNIBANCO	44.789.035,35	9,57%
BANCO SAFRA	32.864.195,06	7,02%
BANCO BTG PACTUAL	24.540.530,61	5,24%
BANCO SANTANDER	18.098.187,25	3,87%
WESTERN ASSET	8.456.741,79	1,81%
AZ QUEST INVEST	12.887.022,43	2,75%
BANCO BNP PARIBAS	8.253.915,82	1,76%
BANCO FINAXIS	476.849,67	0,10%
VINCI PARTNERS	12.442.295,64	2,66%
SULAMERICA ASSET	7.237.683,65	1,55%
TOTAL	468.189.795,15	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL



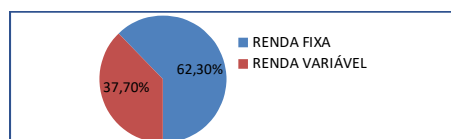
ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	194.604.535,60	41,57%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	96.597.461,02	20,63%
ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	476.849,67	0,10%
ARTIGO 7º, INCISO VI, ALÍNEA "A"		
ARTIGO 8º, INCISO I	92.164.669,90	19,69%
ARTIGO 10º, INCISO I	46.801.600,07	10,00%
ARTIGO 10º, INCISO II		
ARTIGO 9º, INCISO II e III	37.544.678,89	8,02%
TOTAL	468.189.795,15	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CDI	86.383.343,82	18,45%
ALOCÇÃO ATIVA/DI	34.287.136,73	7,32%
IPCA + 6%	92.474.215,49	19,75%
IMA - B	25.697.593,64	5,49%
IDKA 2	52.359.706,94	11,18%
IRF-M1		
MULTIMERCADO	46.801.600,07	10,00%
VALOR	8.253.915,82	1,76%
AÇÕES LIVRES	57.334.463,90	12,25%
SMALL CAPS	18.549.492,30	3,96%
GOVERNANÇA	8.026.797,88	1,71%
FIP		
FIDC	476.849,67	0,10%
MERCADO EXTERIOR	37.544.678,89	8,02%
TOTAL	468.189.795,15	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	291.678.846,29	62,30%
RENDA VARIÁVEL	176.510.948,86	37,70%
TOTAL	468.189.795,15	100,00%

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	1,18%
META ATUARIAL NO MÊS	0,06%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	1,13%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	-8,62%
META GERENCIAL ANO	1,23%
META ATUARIAL ANO	7,69%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	14,69%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)	MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL	
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 121.913.364,80	26,04%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 150.182.959,51	32,08%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 196.093.470,84	41,88%
TOTAL		R\$ 468.189.795,15	100,00%

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

JOSÉ RICARDO ORTOLANI
Presidente – FUNPREV

RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE AGOSTO/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)
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 07.442.078/0001-05 BB IMA-B TIT. PÚBLICOS PREVID FII	IMA-B	PAS		25.697.593,64	D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,49%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 13077418/000149 BB FII PREVID. PERFIL DI	CDI	PAS			D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%		0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 13.222.205/0001-35 BB FII PREVID IDKA-2	IDKA 2	PAS	1.569.483,08		D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,34%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 44.345.590/0001-60 BB FII PREVID TP IPCA XXI	IPCA + 6%	PAS		18.598.952,79	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	3,97%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 15.486.003/0001-63 BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FII RF PREVIDENCIÁRIO	IPCA + 6%	PAS	31.634.795,79	3.895.225,19	2023	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	6,76%	0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 23.125.097/0001-55 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO	24.073.019,53		D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,14%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.205/0001-97 CAIXA BRASIL FII REF DI LP	CDI	PAS		6.176.262,39	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	1,32%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 14.386.026/0001-71 CAIXA BRASIL FII IDKA IPCA 2A	IDKA 2	PAS	36.535.648,80	14.254.575,06	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	10,85%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.659/0001-93 CAIXA BRASIL FII IMA-B TP	IMA-B	PAS			D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 20.139.590/0001-78 CAIXA BRASIL FII 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	28.968.237,42	4.618.031,10	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	7,17%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.569/0001-82 BRADESCO FII IDKA PRÉ 2	IDKA 2	PAS			D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 03.399.411/0001-90 BRADESCO FII REF DI PREMIUM	CDI	PAS		46.683.781,26	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	9,97%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 00.832.453/0001-00 ITAÚ INSTITUCIONAL FII RF REFR. DI	CDI	PAS		33.523.300,17	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	7,16%	0,18%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 21.838.150/0001-49 ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC FII	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO			D+1	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%		0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO SANTANDER 26.507.122/0001-06 SANTANDER RF ATIVO FIC FII	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO		10.214.117,20	D+1	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	2,18%	0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 23.176.874/0001-91 BTG PACTUAL 2024 TP FII RF	IPCA + 6%	VÉRTICE		4.758.973,20	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,02%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.018.384/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO		476.849,67	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	5,00%	0,10%	0,25%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 10.418.333/0001-88 BB PREVID FIA GOV CORPORATIVA	GOVERNANÇA	PAS		8.026.797,88	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,71%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 17.413.638.0001-68 BB GLOBAL SELECT EQUIT INV. EXTERIOR FII MULT	MERC. EXTERNO	ATIVO		11.634.927,87	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	2,49%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.903/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO		8.963.444,94	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,91%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21.556.329/0001-54 SAFRA S&P REAIS PB FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		14.838.514,09	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	3,17%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 36.498.594/0001-74 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		8.987.048,41	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,92%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.458.318/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO		18.025.680,97	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	3,85%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 13.396.703/0001-22 VINCI VALOREM FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO		6.591.921,33	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,41%	1,00%	20% exceder o índice	MÉDIO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		5.850.374,31	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,25%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.453.850/0001-48 WESTERN ASSE T US INDEX 500 FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		8.456.741,79	D+1	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,81%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 03.737.188/0001-43 CAIXA RV-30 FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO		7.927.374,45	D+4	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,69%	1,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 13.767.159/0001-88 CAIXA FII INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA	FII	ATIVO			11/2021	ARTIGO 10º, INCISO II	5,00%		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		12.887.022,43	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,75%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAÚ-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAÚ FICFIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		11.265.735,18	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,41%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMÉRICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMÉRICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO		7.237.683,65	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,55%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.939/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO		8.253.915,82	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,76%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.680.879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO		13.222.716,82	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,82%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.988.623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO		5.662.469,87	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,21%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO		7.884.070,05	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,21%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FII FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		10.794.509,00	D+33	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,31%	3,00%	N POSSUI	ALTO
TOTAL RENDA FIXA							291.678.846,29	100,00%	61,47%		
TOTAL RENDA VARIÁVEL							176.510.948,86	70,00%	38,53%		
TOTAL GERAL							468.189.795,15				

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

JOSÉ RICARDO ORTOLANI
Presidente – FUNPREV



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS

MÊS: AGOSTO/2022

FOLHAS 160/171 – PROCESSO 579/2022

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA Nº 28/2022

DATA: 06/10/2022

	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, além 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 agosto de 2022 foi de 1,18% positiva, com destaque para os fundos de ações, que tiveram rentabilidade consideravelmente positiva e constituem boa parcela da carteira da Fundação. O segmento de renda fixa,



**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



fechou o mês de agosto com rentabilidade positiva em 0,57% e compõe a maior parte da carteira com 62,30%. O segmento de investimento no exterior, influenciado pela crise global, novamente prejudicou o resultado no mês. Em relação a esse segmento, a Funprev efetuou no mês de setembro o desinvestimento parcial de um dos fundos, em que foi possível movimentar sem prejudicar a execução orçamentária, diminuindo assim o risco de mercado. O resultado da carteira no mês foi compatível com a meta gerencial, que mede a possibilidade de retorno dentro o perfil de risco da Fundação. A Funprev nos meses de julho, agosto e setembro efetuou uma mudança significativa na estratégia de investimentos da Fundação, reduzindo exposição em ativos de maior risco e aproveitando oportunidades de investimentos em vértices de NTB-Bs de curto prazo com remuneração acima da meta atuarial e em fundos CDI favorecidos nesse momento diante do atual patamar da taxa Selic.

MÁRCIA ARAÚJO DOS REIS DE OLIVEIRA – PRESIDENTE

DIOGO NUNES PEREIRA – SECRETÁRIO

GILSON GIMENES CAMPOS – MEMBRO

ANTONIO CARLOS BATISTA MARTINEZ – MEMBRO

ALEXANDRE FRUCTUOSO DA COSTA - MEMBRO



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: AGOSTO/2022

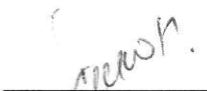
ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 18/2022


DATA: 11/10/2022

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


Observações: Este Conselho recebe os autos (Processo 579/2022) e toma conhecimento da manifestação do Núcleo de Gerenciamento de Investimentos, às folhas 171, e da manifestação do Comitê de Investimentos, às fls. 172, com especial atenção às **informações complementares apontadas pelo Comitê de Investimentos**, e aprova referido relatório de investimentos base agosto/2022, conforme item 07 da Ata da Reunião Ordinária 28/2022 do Comitê de Investimentos, de 06 de outubro de 2022, fl. 173.



David José França
Presidente do Conselho Curador



Gabriella Lucarelli Rocha
Membro do Conselho Curador



José Aparecido dos Santos
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: Agosto/2022

PARECER DO CONSELHO FISCAL
ATA Nº 19/2022 - DATA: 14/10/2022

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

Informações complementares: Este conselho após análise dos relatórios mensais e demais informações pertinentes a carteira de investimentos data base agosto/2022, elaborado pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos às fls.171, do parecer emitido pelo Comitê de Investimentos às fls.172, da análise e aprovação do relatório de investimentos pelo conselho Curador, ata nº 19/2022 às fls.175/177 - manifesta-se FAVORÁVEL as aprovações. Observando-se rentabilidade geral positiva de 1,18%, com destaque nos fundos de ações. O segmento de renda fixa apresentou rentabilidade ligeiramente positiva 0,57% o resultado geral da carteira está compatível com a meta gerencial.


Membros do Conselho Fiscal.

Cristiane N. Pereira dos Santos 

Elson Reis 

Michele Carla Ribeiro Correa 

Rubens Roberto R. de Souza 

Soraya de Goes 

Valderez Alves Cardoso 