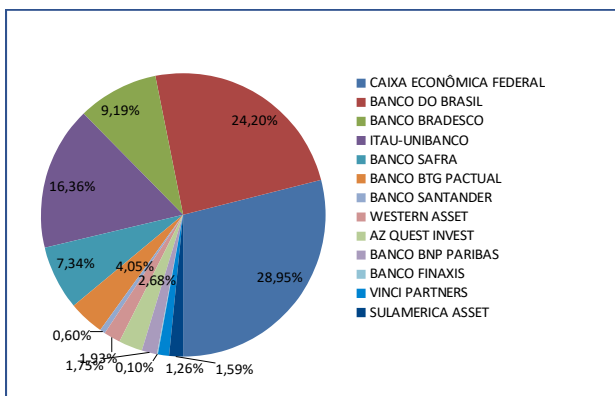


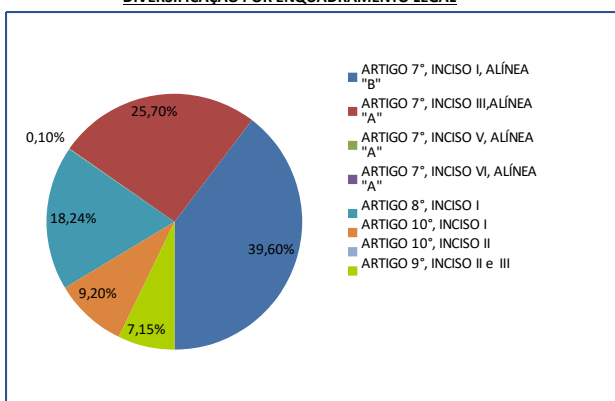
**RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE NOVEMBRO/2022**

**DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**



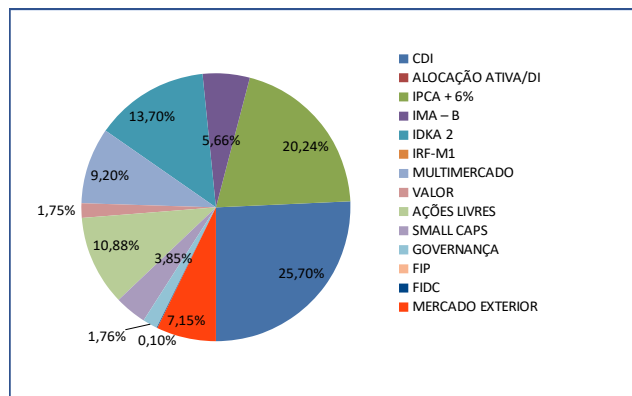
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	133.864.701,92	28,95%
BANCO DO BRASIL	111.903.096,72	24,20%
BANCO BRADESCO	42.512.207,12	9,19%
ITAU-UNIBANCO	75.629.094,45	16,36%
BANCO SAFRA	33.913.664,97	7,34%
BANCO BTG PACTUAL	18.721.108,13	4,05%
BANCO SANTANDER	2.768.839,20	0,60%
WESTERN ASSET	8.906.613,26	1,93%
AZ QUEST INVEST	12.377.169,22	2,68%
BANCO BNP PARIBAS	8.096.171,58	1,75%
BANCO FINAXIS	470.431,68	0,10%
VINCI PARTNERS	5.816.420,79	1,26%
SULAMERICA ASSET	7.369.604,87	1,59%
<b>TOTAL . . . . .</b>	<b>462.349.123,91</b>	<b>100,00%</b>

**DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL**



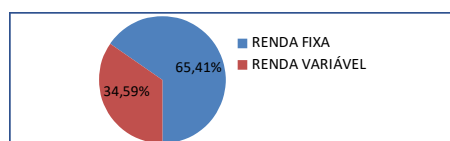
ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	183.104.455,05	39,60%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	118.835.409,53	25,70%
ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	470.431,68	0,10%
ARTIGO 7º, INCISO VI, ALÍNEA "A"		
ARTIGO 8º, INCISO I	84.321.554,67	18,24%
ARTIGO 10º, INCISO I	42.544.542,57	9,20%
ARTIGO 10º, INCISO II		
ARTIGO 9º, INCISO II e III	33.072.730,41	7,15%
<b>TOTAL . . . . .</b>	<b>462.349.123,91</b>	<b>100,00%</b>

**DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS**



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CDI	118.835.409,53	25,70%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI		
IPCA + 6%	93.573.683,74	20,24%
IMA - B	26.174.257,23	5,66%
IDKA 2	63.356.514,08	13,70%
IRF-M1		
MULTIMERCADO	42.544.542,57	9,20%
VALOR	8.096.171,58	1,75%
AÇÕES LIVRES	50.295.118,44	10,88%
SMALL CAPS	17.790.201,59	3,85%
GOVERNANÇA	8.140.063,06	1,76%
FIP		
FIDC	470.431,68	0,10%
MERCADO EXTERIOR	33.072.730,41	7,15%
<b>TOTAL . . . . .</b>	<b>462.349.123,91</b>	<b>100,00%</b>

**DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO**



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	302.410.296,26	65,41%
RENDA VARIÁVEL	159.938.827,65	34,59%
<b>TOTAL . . . . .</b>	<b>462.349.123,91</b>	<b>100,00%</b>

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	-0,31%
META ATUARIAL NO MÊS	0,78%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	3,29%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	-9,76%
META GERENCIAL ANO	4,34%
META ATUARIAL ANO	9,68%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	33,99%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)	MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL	
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 154.412.252,38	33,40%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 121.353.354,97	26,25%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 186.583.516,56	40,36%
<b>TOTAL</b>		<b>R\$ 462.349.123,91</b>	<b>100,00%</b>

**LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO**  
Economista /Corecon 32.356MBA GESTÃO FINANCEIRA/Certificado CGRPPS

**JOSÉ RICARDO ORTOLANI**  
Presidente – FUNPREV

## RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE NOVEMBRO/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 F I	IMA-B	PAS		26.174.257,23	D+1	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,66%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 130774180/0001-49 BB FI PREVID. PERFIL DI	CDI	PAS			D+0	ARTIGO 7°, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%		0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 13.222.205/0001-35 BB FI PREVID IDKA-2	IDKA 2	PAS	2.863.577,83		D+1	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,58%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 44.345.590/0001-60 BB FI PREVID TP IPCA XXI	IPCA + 6%	PAS		18.945.160,80	2024	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,10%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 15.486.003/0001-63 BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RF PREVIDENCIÁRIO	IPCA + 6%	PAS	31.676.484,49	3.900.358,36	2023	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	6,85%	0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 23.215.987/0001-65 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO			D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS	24.886.157,82	5.915.291,68	D+0	ARTIGO 7°, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	6,66%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 14.386.026/0001-71 CAIXA BRASIL FI IDKA IPCA 2A	IDKA 2	PAS	47.713.844,41	12.979.091,84	D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	13,13%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.659/0001-93 CAIXA BRASIL FI IMA-B TP	IMA-B	PAS			D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 20.139.590/0001-76 CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	29.508.732,12	4.704.195,17	2024	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	7,40%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.569/0001-82 BRADESCO FI IDKA PRÉ 2	IDKA 2	PAS			D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 03.399.411/0001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS		23.834.515,40	D+0	ARTIGO 7°, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	5,16%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 00.832.453/0001-00 ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REFR. DI	CDI	PAS		64.199.444,63	D+0	ARTIGO 7°, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	13,89%	0,18%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 21.838.150/0001-49 ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC FI	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO			D+1	ARTIGO 7°, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%		0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO SANTANDER 26.607.132/0001-06 SANTANDER RF ATIVO FIC FI	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO			D+1	ARTIGO 7°, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%		0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 23.176.874/0001-91 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE		4.838.752,80	2024	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,05%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.019.384/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO		470.431,68	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7°, INCISO V, ALÍNEA "A"	5,00%	0,10%	0,25%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 10.418.353/0001-88 BB PREVID FIA GOV CORPORATIVA	GOVERNANÇA	PAS		8.140.063,06	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,76%	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		12.002.569,75	D+5	ARTIGO 9°, INCISO II	10,00%	2,60%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.903/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO		8.400.625,20	D+3	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,82%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21.556.329/0001-54 SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		15.612.343,51	D+2	ARTIGO 10°, INCISO I	10,00%	3,38%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 36.498.594/0001-74 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		9.868.196,92	D+2	ARTIGO 10°, INCISO I	10,00%	2,13%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.458.318/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO		18.301.321,46	D+5	ARTIGO 9°, INCISO III	10,00%	3,96%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 13.396.703/0001-22 VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO			D+2	ARTIGO 10°, INCISO I	10,00%		1,00%	20% exceder o índice	MÉDIO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		5.816.420,79	D+32	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,26%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.453.850/0001-48 WESTERN ASSE T US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		8.906.613,26	D+1	ARTIGO 10°, INCISO I	10,00%	1,93%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 03.737.188/0001-43 CAIXA RV-30 FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO		8.157.388,88	D+4	ARTIGO 10°, INCISO I	10,00%	1,76%	1,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 13.767.159/0001-88 CAIXA FIP INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA	FIP	ATIVO			11/2021	ARTIGO 10°, 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		12.377.169,22	D+30	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	2,68%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAÚ-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAÚ FICFIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		11.429.649,82	D+5	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	2,47%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMÉRICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMÉRICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO		7.369.604,87	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,59%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.939/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO		8.096.171,58	D+30	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,75%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.680.879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO		13.264.659,35	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	2,87%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.988.623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO		5.413.032,37	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	1,17%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO		2.768.839,20	D+8	ARTIGO 9°, INCISO II	10,00%	1,17%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		4.014.158,41	D+33	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	0,87%	3,00%	N POSSUI	ALTO
<b>TOTAL RENDA FIXA</b> .....			<b>302.410.296,26</b>				<b>100,00%</b>	<b>64,56%</b>			
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b> .....			<b>159.938.827,65</b>				<b>70,00%</b>	<b>35,44%</b>			
<b>TOTAL GERAL</b> .....			<b>462.349.123,91</b>								



**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**  
**SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS**  
**MÊS: NOVEMBRO/2022**  
**FOLHAS 223/230 – PROCESSO 579/2022**

**PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS**  
**ATA Nº 34/2022 DATA: 27/12/2022**

	<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, 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 novembro de 2022 foi de 0,31% negativa, por conta do resultado dos fundos de ações devido ao cenário pós eleição. Os fundos de renda fixa e os atrelados ao exterior tiveram performance positiva. O resultado da carteira no



**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)



mês, foi compatível com a meta gerencial, que mede a possibilidade de retorno dentro o perfil de risco da Fundação. Em relação a meta atuarial, diante do resultado de novembro, pode-se concluir que será mais um ano em que a Fundação não atingirá o percentual estabelecido. O objetivo passa a ser o de aumentar a rentabilidade no ano que atualmente está em 3,29% a depender do resultado do mês de dezembro. Do resultado parcial de 2022, identificamos que foi muito prejudicado pelo segmento de investimento no exterior que até o fechamento de 23/12 estava em 19,33% negativo. Esse segmento foi justamente o que mais contribuiu positivamente no ano anterior, evitando que a carteira ficasse negativa em 2021, no entanto, foi drasticamente afetada pela guerra entre Ucrânia e Rússia, além do fraco desempenho da economia global. Em relação aos fundos de ações, as rentabilidades foram muito voláteis durante todo o ano e no pós eleição muito afetadas pelo humor do mercado. Mesmo assim, o Ibovespa até 23/12 mantinha retorno positivo de aproximadamente 4%. O segmento de renda fixa cumpriu seu papel de proteção da carteira, porém não agregou resultados tão elevados a ponto de contrapor os resultados negativos no segmento de exterior, apenas minimizando seus impactos. Diante dos resultados, conclui-se a boa posição da carteira que, não fosse os investimentos no exterior teria ficado bem próximo da meta atuarial ou até superado. Aguardaremos o resultado de dezembro para verificação dos resultado no exercício.

**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**



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

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

ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR


ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 24/2022

DATA: 27/12/2022

	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, à folha 230, da Presidência à fl. 231, e da manifestação do Comitê de Investimentos, às fls. 232 e 233, com especial atenção às **informações complementares apontadas pelo Comitê de Investimentos**, e aprova referido relatório de investimentos base novembro/2022, conforme item 05 da Ata da Reunião Ordinária 37/2022 do Comitê de Investimentos, de 27 de dezembro de 2022.

  
\_\_\_\_\_  
David José Françaoso  
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: NOVEMBRO/2022**  
**Fls. 238**  
**PARECER DO CONSELHO FISCAL**  
**ATA Nº 24/2022 - DATA: 28/12/2022**

	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 novembro/2022, elaborado pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos às fls.223-230, do parecer emitido pelo Comitê de Investimentos às fls.232-233, da análise e aprovação do relatório de investimentos pelo conselho Curador, ata nº 24/2022 às fls.236-237 - manifesta-se FAVORÁVEL as aprovações. Observando-se rentabilidade negativa de 0,31%, os fundos de fixas atrelados aos investimentos no exterior tiveram performance positiva. O resultado da carteira no mês foi compatível com a meta gerencial em relação a meta atuarial, diante do resultado de novembro pode -se concluir que será mais um ano em que a Fundação não atingirá o percentual estabelecido. O objetivo passa a ser o de aumentar a rentabilidade no ano que atualmente está em 3,29% a depender do resultado do mês de dezembro.

**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