



Este relat

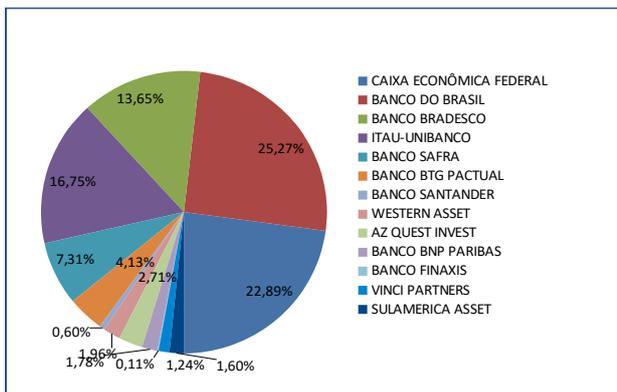
Luiz Gustavo Peres Macedo
Economista / Corecon 32.356

Relatórios de Investimentos (GOVERNANÇA CORPORATIVA)

JANEIRO / 2023

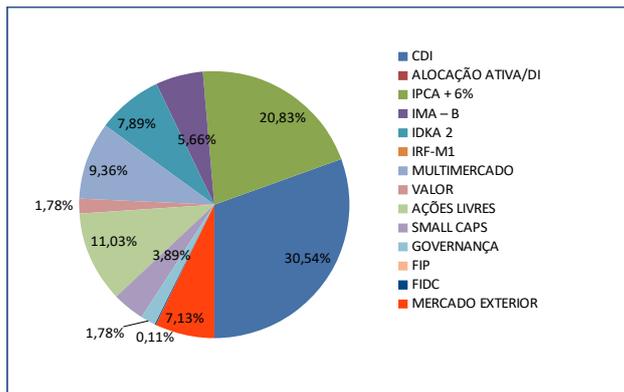
RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE JANEIRO/2023

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



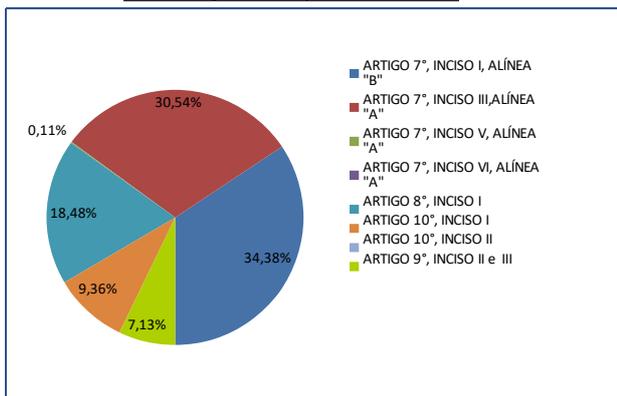
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	105.532.759,46	22,89%
BANCO DO BRASIL	116.525.274,74	25,27%
BANCO BRADESCO	62.911.530,42	13,65%
ITAU-UNIBANCO	77.220.245,66	16,75%
BANCO SAFRA	33.704.710,10	7,31%
BANCO BTG PACTUAL	19.044.302,57	4,13%
BANCO SANTANDER	2.761.349,25	0,60%
WESTERN ASSET	9.026.110,15	1,96%
AZ QUEST INVEST	12.476.296,83	2,71%
BANCO BNP PARIBAS	8.210.784,74	1,78%
BANCO FINAXIS	526.396,05	0,11%
VINCI PARTNERS	5.711.059,74	1,24%
SULAMERICA ASSET	7.388.760,48	1,60%
TOTAL	461.039.580,19	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS



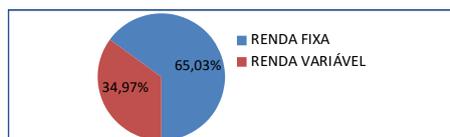
CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CDI	140.778.751,79	30,54%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI		
IPCA + 6%	96.046.760,50	20,83%
IMA - B	26.114.426,09	5,66%
IDKA 2	36.359.440,30	7,89%
IRF-M1		
MULTIMERCADO	43.134.726,77	9,36%
VALOR	8.210.784,74	1,78%
AÇÕES LIVRES	50.870.348,43	11,03%
SMALL CAPS	17.924.366,58	3,89%
GOVERNANÇA	8.213.548,56	1,78%
FIP		
FIDC	526.396,05	0,11%
MERCADO EXTERIOR	32.860.030,38	7,13%
TOTAL	461.039.580,19	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL



ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	158.520.626,89	34,38%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	140.778.751,79	30,54%
ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	526.396,05	0,11%
ARTIGO 7º, INCISO VI, ALÍNEA "A"		
ARTIGO 8º, INCISO I	85.219.048,31	18,48%
ARTIGO 10º, INCISO I	43.134.726,77	9,36%
ARTIGO 10º, INCISO II		
ARTIGO 9º, INCISO II e III	32.860.030,38	7,13%
TOTAL	461.039.580,19	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	299.825.774,73	65,03%
RENDA VARIÁVEL	161.213.805,46	34,97%
TOTAL	461.039.580,19	100,00%

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	2,18%
META ATUARIAL NO MÊS	0,95%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	2,18%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	4,19%
META GERENCIAL ANO	1,98%
META ATUARIAL ANO	0,95%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	229,47%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)	MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL	
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 177.234.353,34	38,44%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 95.950.599,25	20,81%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 187.854.627,60	40,75%
TOTAL		R\$ 461.039.580,19	100,00%

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

DAVID JOSÉ FRANÇO
Presidente – FUNPREV

RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE JANEIRO/2023

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 TIT. PÚBLICOS PREVID FII	IMA-B	PAS		26.114.426,09	D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	5,66%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 130774180/0001-49 BB FII PREVID. PERFIL DI	CDI	PAS			D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%		0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 13.222.026/0001-35 BB FII PREVID IDKA-2	IDKA 2	PAS	5.367.905,16		D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,16%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 44.345.590/0001-60 BB FII PREVID TP IPCA XXI	IPCA + 6%	PAS		19.461.413,23	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,22%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 15.486.030/0001-63 BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FII RF PREVIDENCIÁRIO	IPCA + 6%	PAS	32.458.903,17	3.996.698,38	2023	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	7,91%	0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 23.215.977/0001-65 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO			D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL FII REF DI LP	CDI	PAS	25.447.711,76	5.639.515,93	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	6,74%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 14.389.026/0001-71 CAIXA BRASIL FII IDKA IPCA 2A	IDKA 2	PAS	26.342.258,23	4.649.276,91	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	6,72%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 110.740.659/0001-93 CAIXA BRASIL FII IMA-B TP	IMA-B	PAS			D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	ALTO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 201.139.590/0001-78 CAIXA BRASIL FII 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	30.312.598,45	4.832.345,17	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	7,62%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA 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
RENTA FIXA BANCO BRADESCO 03.399.411/0001-90 BRADESCO FII REF DI PREMIUM	CDI	PAS		44.033.610,35	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	9,55%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 00.832.453/0001-00 ITAÚ INSTITUCIONAL FII RF REFR. DI	CDI	PAS		65.657.913,75	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	14,24%	0,18%	N POSSUI	BAIXO
RENTA 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
RENTA FIXA BANCO SANTANDER 26.607.132/0001-06 SANTANDER RF ATIVO FIC FII	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO			D+1	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%		0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO BTG PACTUAL 23.176.874/0001-91 BTG PACTUAL 2024 TP FII RF	IPCA + 6%	VÉRTICE		4.984.802,10	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,08%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO PETRA 06.018.384/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO		526.396,05	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	5,00%	0,11%	0,25%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 10.418.333/0001-88 BB PREVID FIA GOV CORPORATIVA	GOVERNANÇA	PAS		8.213.548,56	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,78%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 17.413.638/0001-68 BB GLOBAL SELECT EQUIT INV. EXTERIOR FII MULT	MERC. EXTERNO	ATIVO		12.206.463,16	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	2,65%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.903/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO		8.705.916,99	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,89%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21.556.329/0001-54 SAFRA S&P REAIS PB FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		15.812.492,13	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	3,43%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 36.498.594/0001-74 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		9.987.071,48	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	2,17%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.436.318/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO		17.892.217,97	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	3,88%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 13.396.703/0001-22 VINCI VALOREM FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO			D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%		1,00%	20% exceder o índice	MÉDIO
RENTA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		5.711.059,74	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,24%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.433.850/0001-48 WESTERN ASSET US INDEX 500 FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		9.026.110,15	D+1	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,96%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 03.737.188/0001-43 CAIXA RV-30 FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO		8.309.053,01	D+4	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	1,80%	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%		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		12.476.296,83	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,71%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL ITAÚ-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAÚ FICFIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		11.562.331,91	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,51%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL SULAMÉRICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMÉRICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO		7.388.760,48	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,60%	1,50%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.939/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO		8.210.784,74	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,78%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.680.879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO		13.429.850,32	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	2,91%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.988.623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO		5.448.069,75	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,18%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO		2.761.349,25	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,18%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		4.072.428,99	D+33	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,88%	3,00%	N POSSUI	ALTO
TOTAL RENTA FIXA							299.825.774,73	100,00%	65,03%		
TOTAL RENTA VARIÁVEL							161.213.805,46	70,00%	34,97%		
TOTAL GERAL							461.039.580,19				



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS
SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS
MÊS: JANEIRO/2023
FOLHAS 02/20 – PROCESSO 10/2023

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS
ATA Nº 02/2023 DATA: 09/03/2023

	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 observa que a rentabilidade da carteira no mês de janeiro de 2023 foi de 2,18%, influenciada principalmente pelo resultados dos fundos de ações, que representaram um retorno de 4,36%, seguido do investimento no exterior com retorno de 2,51% e a renda fixa com 1,23%.



**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



O resultado positivo interrompeu a sequência de duas quedas consecutivas, em novembro e dezembro de 2022. 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 e que registrou no primeiro mês do exercício um percentual de 1,98%. Em relação a meta atuarial que fechou o mês em 0,95%, o resultado da carteira foi importante e abriu uma margem de segurança de pelo menos um mês de rentabilidade. Embora o ano tenha iniciado com o resultado surpreendente, o Comitê mantém cautela e uma posição mais vigilante dos indicadores para os próximos meses, visando identificar se o resultado de janeiro foi um ponto fora da curva ou se o mercado irá reagir positivamente as políticas do novo governo, já que o resultado parcial de fevereiro foi bem pior do que o de janeiro, praticamente “devolvendo” todos os ganhos na renda variável. Diante do resultado parcial de fevereiro, o Comitê reitera a assertividade das movimentações realizadas, protegendo a carteira da volatilidade do mercado em momentos adversos, obviamente que em momentos favoráveis, a carteira não conseguirá acompanhar o resultado da bolsa e do exterior, porém com a alteração na estratégia, vislumbra-se pelo menos ficar próximo da meta atuarial em 2023 e num cenário promissor superá-la, diminuindo os impactos no resultado atuarial. O Comitê irá acompanhar os resultados dos próximos meses e monitorar a carteira visando novas adequações caso seja necessário.

ALEXANDRE FRUCTUOSO DA COSTA – PRESIDENTE

DIOGO NUNES PEREIRA – SECRETÁRIO

ANTONIO CARLOS BATISTA MARTINEZ – MEMBRO

EDUARDO DE ALMEIDA – MEMBRO

SÉRGIO RICARDO CORREA ALBERTO - 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



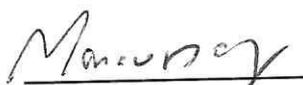
26

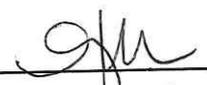
RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS
SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS
MÊS: JANEIRO 2023

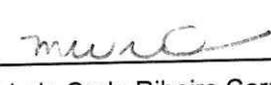
ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR
ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 05/2023 DATA: 14/03/2023

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

Observações: Este Conselho recebe os autos (Processo 10/2023) e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, as folhas 20 e 21, e aprova referido relatório de investimentos base Janeiro/2023, conforme item 03, da Ata da Reunião Ordinária 02/2023 do Comitê de Investimentos.


Marcos Roberto da Costa Garcia
Presidente do Conselho Curador


Gabriella Lucarelli Rocha
Membro do Conselho Curador


Michele Carla Ribeiro Correa
Membro do Conselho Curador


Gilson Gimenes Campos
Membro do Conselho Curador


Franly Regina Craveiro
Membro do Conselho Curador


Tatiane Bertocco da Silva
Secretária do Conselho Curador



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS
SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS
MÊS: JANEIRO/2023

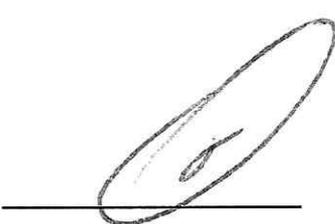
ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL
ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 06/2023 DATA: 29/03/2023

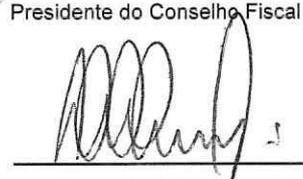
	SIM	NÃO
O Conselho Fiscal aprova o relatório de investimentos?	X	

Observações: Este Conselho recebe os autos (Processo 10/2023) e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, as folhas 20/21 e aprova o referido relatório de investimento base Janeiro/2023, conforme item 3 da ata da Reunião Ordinária 02/2023 do Comitê de Investimento.


Rafael Vicentin Ferrero Salla
Presidente do Conselho Fiscal


Marta Alves de Castro Correa
Secretária do Conselho Fiscal


Ricardo Alonso Senfuegos
Membro do Conselho Fiscal


Augusto Mendes
Membro do Conselho Fiscal


Giane Fátima Silva Francisco
Membro do Conselho Fiscal


Francisco Carlos Santiago
Membro do Conselho Fiscal