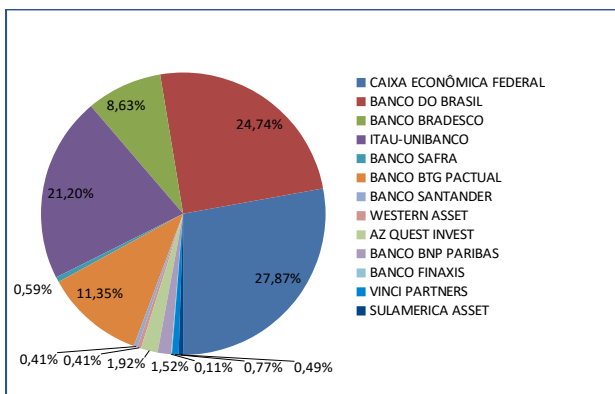


RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE MAIO/2023

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 FI	IMA-B	PAS			D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	ALTO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 13077418000149 BB FI PREVID. DI TÍTULOS PÚBLICOS RF	CDI	PAS	41.611.055,73	39.325.729,50	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	18,11%	0,10%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 13.322.205/0001-35 BB FI PREVID IDKA-2	IDKA 2	PAS			D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO DO BRASIL 44.345.590/0001-60 BB FI PREVID TP IPCA XXI	IPCA + 6%	PAS		20.073.847,79	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,49%	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			2023	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 23.215.097/0001-55 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 FI REF DI LP	CDI	PAS	76.802.610,14	5.030.960,78	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	19,71%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 14.386.926/0001-71 CAIXA BRASIL FI IDKA IPCA 2A	IDKA 2	PAS			D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.658/0001-93 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS		6.241.716,19	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	1,40%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
CAIXA EC. FEDERAL 20.139.595/0001-78 CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	31.266.803,03	5.171.855,68	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	8,15%	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%		0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO BRADESCO 03.399.411/0001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS		34.372.756,11	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	7,69%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 00.832.435/0001-00 ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REFR. DI	CDI	PAS		90.565.875,43	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	20,27%	0,18%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 21.838.150/0001-49 ITAÚ ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC FI	ALOCÇÃO ATIVA/DI	ATIVO			D+1	ARTIGO 7º, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%		0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO BTG PACTUAL 37.927.707/0001-58 BTG PACTUAL TESOURO SELIC S DI INSTITUCIONAL FI RF	CDI	PASSIVO		37.999.135,54	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	8,50%	0,08%	N POSSUI	BAIXO
RENTA FIXA BANCO BTG PACTUAL 23.176.675/0001-91 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE		4.952.160,90	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,11%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENTA FIXA BANCO PETRA 06.018.364/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO	488.449,26		AMORT. MENSAL	ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	5,00%	0,11%	0,25%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 10.418.335/0001-88 BB PREVID FIA GOV CORPORATIVA	GOVERNANÇA	PAS		2.061.369,53	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,46%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 17.413.636/0001-68 BB GLOBAL SELECT EQUITY INV. EXTERIOR FI MULT	MERC. EXTERNO	ATIVO		4.812.886,36	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,08%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.805/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO		2.654.345,21	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,59%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21.566.829/0001-54 SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS			D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%		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		3.962.048,28	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	0,89%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.436.818/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO		2.634.961,81	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	0,59%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 13.396.703/0001-22 VINCI VALOREM FI 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		3.446.785,74	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,77%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.453.850/0001-48 WESTERN ASSE T US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		1.813.024,11	D+1	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	0,41%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 03.737.188/0001-43 CAIXA RV-30 FI MULTIMERCADO	MUITIMERC.	ATIVO			D+4	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%		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		8.578.433,01	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,92%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL ITAÚ-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAÚ FIC FIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		4.175.609,43	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,93%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL SULAMERICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMERICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.173.314,46	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,49%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.939/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO		6.782.360,34	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,52%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.660.879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.107.866,57	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,47%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.988.823/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO		2.074.487,38	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,46%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO		1.854.078,84	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	0,46%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENTA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIQ FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		3.794.066,57	D+33	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,85%	3,00%	N POSSUI	ALTO
TOTAL RENTA FIXA							393.902.956,08	100,00%	88,16%		
TOTAL RENTA VARIÁVEL							52.925.637,64	70,00%	11,84%		
TOTAL GERAL							446.828.593,72				

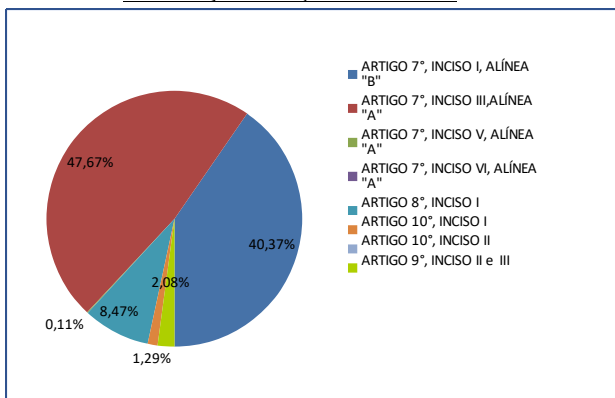
RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE MAIO/2023

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



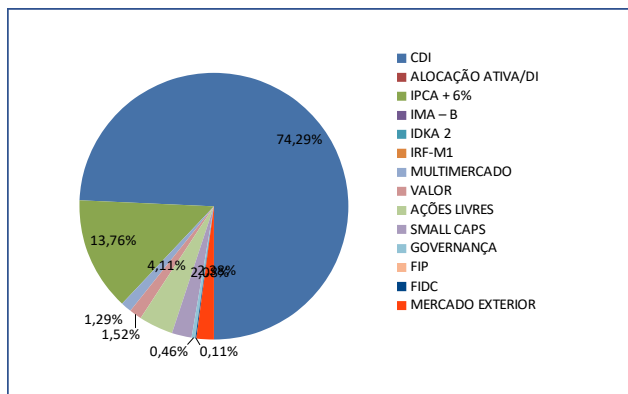
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	124.513.945,82	27,87%
BANCO DO BRASIL	110.539.234,12	24,74%
BANCO BRADESCO	38.555.110,06	8,63%
ITAU-UNIBANCO	94.741.484,86	21,20%
BANCO SAFRA	2.634.961,81	0,59%
BANCO BTG PACTUAL	50.707.411,29	11,35%
BANCO SANTANDER	1.854.078,84	0,41%
WESTERN ASSET	1.813.024,11	0,41%
AZ QUEST INVEST	8.578.433,01	1,92%
BANCO BNP PARIBAS	6.782.360,34	1,52%
BANCO FINAXIS	488.449,26	0,11%
VINCI PARTNERS	3.446.785,74	0,77%
SULAMERICA ASSET	2.173.314,46	0,49%
TOTAL	446.828.593,72	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL



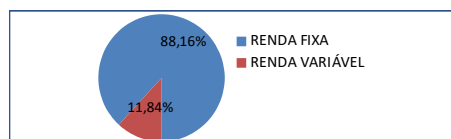
ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	180.400.588,17	40,37%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	213.013.918,65	47,67%
ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	488.449,26	0,11%
ARTIGO 7º, INCISO VI, ALÍNEA "A"		
ARTIGO 8º, INCISO I	37.848.638,24	8,47%
ARTIGO 10º, INCISO I	5.775.072,39	1,29%
ARTIGO 10º, INCISO II		
ARTIGO 9º, INCISO II e III	9.301.927,01	2,08%
TOTAL	446.828.593,72	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CDI	331.949.839,42	74,29%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI	61.464.667,40	13,76%
IPCA + 6%		
IMA - B		
IDKA 2		
IRF-M1		
MULTIMERCADO	5.775.072,39	1,29%
VALOR	6.782.360,34	1,52%
AÇÕES LIVRES	18.351.987,98	4,11%
SMALL CAPS	10.652.920,39	2,38%
GOVERNANÇA	2.061.369,53	0,46%
FIP		
FIDC	488.449,26	0,11%
MERCADO EXTERIOR	9.301.927,01	2,08%
TOTAL	446.828.593,72	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	393.902.956,08	88,16%
META ATUARIAL NO MÊS	52.925.637,64	11,84%
TOTAL	446.828.593,72	100,00%

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	1,33%
META ATUARIAL NO MÊS	0,65%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	4,85%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	0,98%
META GERENCIAL ANO	6,03%
META ATUARIAL ANO	5,00%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	97,00%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)	ATÉ 1 ANO	MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 331.949.839,42	74,29%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 61.464.667,40	13,76%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 53.414.086,90	11,95%
TOTAL		R\$ 446.828.593,72	100,00%

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

DAVID JOSÉ FRANÇOIS
Presidente – FUNPREV



**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: MAIO/2023

FOLHAS 75/87 – PROCESSO 10/2023

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA Nº 14/2023

DATA: 06/07/2023

	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 registra que em relação ao atendimento aos limites da Política de Investimentos e da Resolução CMN 4963/2021, apontados acima como PARCIAL, justifica-se que o motivo do apontamento foi um pequeno desenquadramento passivo (quando não há a intenção de



**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



desenquadramento), em virtude dos percentuais aplicados (saldo da carteira diminuiu e o saldo aplicado nos fundos aumentou). O Comitê registra que a situação já foi corrigida durante o mês de junho/2023, e os critérios já estão regulares, sendo que o prazo de correção era de seis meses a partir do desenquadramento. O Comitê observa que a rentabilidade da carteira no mês de maio de 2023 foi de 1,33%, impulsionada principalmente pelos resultados na renda variável cujo retorno foi de 3,59% e na renda fixa com retorno de 0,95%. O segmento de investimento no exterior apresentou rentabilidade de - 0,42% no mês em análise. O resultado da carteira no ano, está abaixo da meta gerencial, que mede a possibilidade de retorno dentro o perfil de risco da Fundação e que registrou no acumulado até maio um percentual de 6,03%, ante 4,85% da rentabilidade da carteira. No entanto é importante mencionar que a estratégia de investimentos da Fundação foi alterada em relação a data da elaboração da Política de Investimentos, notadamente em virtude do comportamento do mercado financeiro. Entretanto, a meta gerencial ainda não foi adequada à nova estratégia. Sendo assim, o Comitê propõe a adequação dos percentuais visando a correlacionar a meta gerencial à estratégia de investimentos. Quanto a meta atuarial, esta encerrou o mês em 0,65%, e no acumulado do ano em 5,00%. A expectativa é de que, caso o IPCA se mantenha numa posição historicamente inferior nos meses de junho e julho, e as condições de mercado se mantenham favoráveis, a rentabilidade da carteira deve superar a meta atuarial até o fechamento de julho.

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



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS

MÊS: MAIO 2023

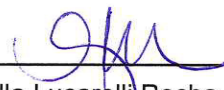
ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 13/2023 DATA: 11/07/2023

	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 87, 89 e 90, e aprova referido relatório de investimentos base Maio/2023, conforme item 06, da Ata da Reunião Ordinária 14/2023 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 Gímenes Campos
Membro do Conselho Curador


Franly Regina Craveiro
Membro do Conselho Curador


Tatiane Bertocco da Silva
Secretária do Conselho Curador



**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: MAIO/2023

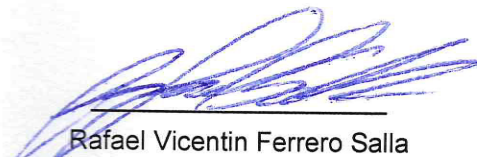
ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 13/2023

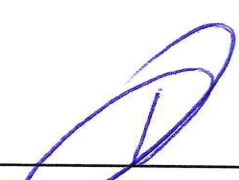
DATA: 12/07/2023

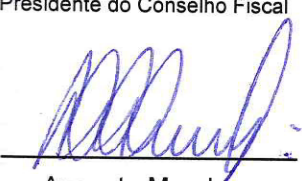
	SIM	NÃO
O Conselho Fiscal aprova o relatório de investimentos?	X	

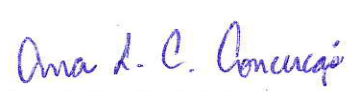
Observações: Este Conselho recebe os autos (Processo 10/2023) e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, as fls 88, e aprova o referido relatório de investimento base Fevereiro/2023, conforme item 06 da ata da Reunião Ordinária 14/2023 do Comitê de Investimento. (fl 89 verso). Toma conhecimento também da aprovação do Conselho Curador, conforme fl 92.


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


Ana Lígia Corrêa da Conceição
Membro Suplente do Conselho Fiscal