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

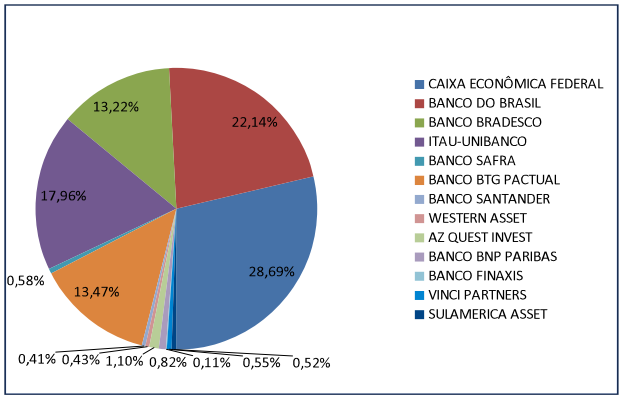
FUNDO	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	SALDO APLICADO	DISPONIBILIDADE PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 4963/2021	LIMITE LEGAL	% APLICADO	TX ADM	TAXA PERFORMANCE	NÍVEL DE RISCO (Incerteza)
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 07,442,078/0001-05 BB IMA-B TÍT. PÚBLICOS PREVID FI	IMA-B	PAS			D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 13077418000149 BB FI PREVID. DI TITULOS PÚBLICOS RF	CDI	PAS	43.072.744,01	26.770.475,98	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	15,47%	0,10%	N POSSUI	BAIXO
RENDA 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
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 44,345,590/0001-60 BB FI PREVID TP IPCA XXI	IPCA + 6%	PAS		20.260.763,67	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,49%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 15,486,093/0001-53 BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RF PREVIDENCIÁRIO	IPCA + 6%	PAS			2023	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 23,215,097/0001-55 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	ALOCAÇÃO ATIVA/DI	ATIVO			D+0	ARTIGO 7º, 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	61.396.782,30	4.935.814,27	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	16,07%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 14,386,926/0001-71 CAIXA BRASIL FI IDKA IPCA PRÉ 2 ANOS	IDKA 2	PAS	20.190.202,64		D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,47%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10,740,658/0001-93 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS		6.221.758,69	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	1,38%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
CAIXA EC. FEDERAL 20,139,595/0001-78 CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	31.558.041,03	5.220.029,49	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	8,15%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA 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
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 03,399,411/0001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS		55.182.913,07	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	12,22%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 00,832,435/0001-00 ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REFR. DI	CDI	PAS		76.564.342,76	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	16,96%	0,18%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 21,838,150/0001-49 ITAU ALOCAÇÃO DINAMICA FIC FI	ALOCAÇÃO ATIVA/DI	ATIVO			D+1	ARTIGO 7º, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%		0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 37,927,707/0001-58 BTG PACTUAL TESOURO SELIC S DI INSTITUCIONAL FI RF	CDI	PASSIVO		49.291.631,22	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	10,92%	0,08%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 23,176,875/0001-91 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE		4.994.351,10	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,11%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06,018,364/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO		485.997,36	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	5,00%	0,11%	0,25%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 10,418,335/0001-88 BB PREVID FIA GOV CORPORATIVA	GOVERNANÇA	PAS		2.244.365,85	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,50%	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		4.745.788,31	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,05%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09,005,805/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO		2.850.675,21	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,63%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21,595,829/0001-54 SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS			D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%		1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 36,499,594/0001-74 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		4.242.317,87	D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	0,94%	0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19,436,818/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO		2.633.429,56	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	0,58%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA 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
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28,470,587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.473.817,90	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,55%	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		1.939.529,71	D+1	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	0,43%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 03,737,188/0001-43 CAIXA RV-30 FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	ATIVO			D+4	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%		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 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		4.979.553,71	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,10%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAÚ-UNIBANCO 08,817,414/0001-10 ITAU FICFIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		4.512.364,56	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,00%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMERICA DTVM 11,458,144/0001-02 SULAMERICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.360.878,18	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,52%	1,50%	20 exceder o indice%	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12,238,939/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO		3.719.598,56	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,82%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03,660,879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.276.756,69	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,50%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06,988,623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO		2.208.911,76	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,49%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17,804,792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO		1.839.703,22	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	0,49%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11,977,794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIQ FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.305.344,21	D+33	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,51%	3,00%	N POSSUI	ALTO
			TOTAL RENDA FIXA . . . . . :	406.145.847,59			100,00%	89,96%			
			TOTAL RENDA VARIÁVEL . . . . . :	45.333.035,30			70,00%	10,04%			
			TOTAL GERAL . . . . . :	451.478.882,89							

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32,356

DAVID JOSÉ FRANÇOSO
Presidente – FUNPREV

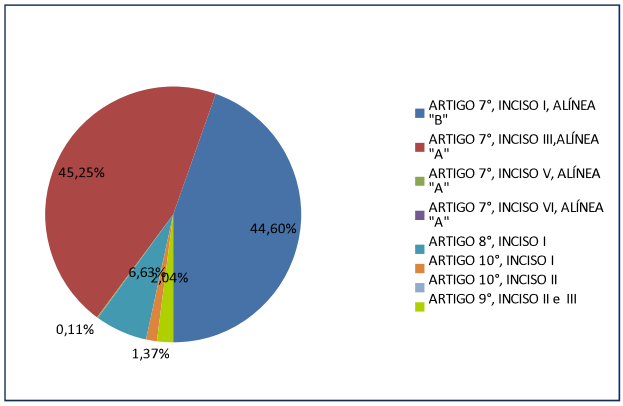
RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE JUNHO/2023

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



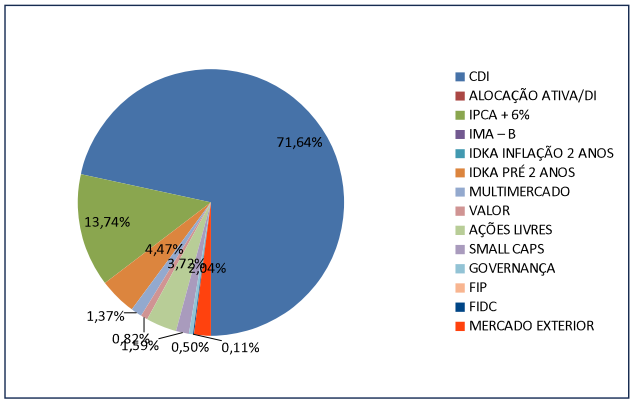
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	129.522.628,42	28,69%
BANCO DO BRASIL	99.944.813,03	22,14%
BANCO BRADESCO	59.668.581,52	13,22%
ITAU-UNIBANCO	81.076.707,32	17,96%
BANCO SAFRA	2.633.429,56	0,58%
BANCO BTG PACTUAL	60.833.644,40	13,47%
BANCO SANTANDER	1.839.703,22	0,41%
WESTERN ASSET	1.939.529,71	0,43%
AZ QUEST INVEST	4.979.553,71	1,10%
BANCO BNP PARIBAS	3.719.598,56	0,82%
BANCO FINAXIS	485.997,36	0,11%
VINCI PARTNERS	2.473.817,90	0,55%
SULAMERICA ASSET	2.360.878,18	0,52%
TOTAL . . . . . :	**451.478.882,89**	**100,00%**

DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL



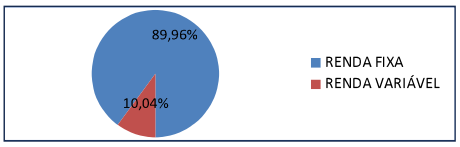
ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	201.358.239,14	44,60%
ARTIGO 7°, INCISO III,ALÍNEA "A"	204.301.611,09	45,25%
ARTIGO 7°, INCISO V, ALÍNEA "A"	485.997,36	0,11%
ARTIGO 7°, INCISO VI, ALÍNEA "A"		
ARTIGO 8°, INCISO I	29.932.266,63	6,63%
ARTIGO 10°, INCISO I	6.181.847,58	1,37%
ARTIGO 10°, INCISO II		
ARTIGO 9°, INCISO II e III	9.218.921,09	2,04%
TOTAL . . . . . :	**451.478.882,89**	**100,00%**

DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CDI	323.436.462,30	71,64%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI		
IPCA + 6%	62.033.185,29	13,74%
IMA – B		
IDKA INFLAÇÃO 2 ANOS		
IDKA PRÉ 2 ANOS	20.190.202,64	4,47%
MULTIMERCADO	6.181.847,58	1,37%
VALOR	3.719.598,56	0,82%
AÇÕES LIVRES	16.779.836,75	3,72%
SMALL CAPS	7.188.465,47	1,59%
GOVERNANÇA	2.244.365,85	0,50%
FIP		
FIDC	485.997,36	0,11%
MERCADO EXTERIOR	9.218.921,09	2,04%
TOTAL . . . . . :	**451.478.882,89**	**100,00%**

DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	406.145.847,59	89,96%
RENDA VARIÁVEL	45.333.035,30	10,04%
TOTAL . . . . . :	**451.478.882,89**	**100,00%**

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	**1,72%**
META ATUARIAL NO MÊS	0,32%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	**6,66%**
EVOLUÇÃO DO PATRIMONIO NO ANO	2,03%
META GERENCIAL ANO	**8,42%**
META ATUARIAL ANO	**5,34%**
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	124,72%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)		**MONTANTE APLICADO**	**PERCENTUAL**
BAIXO	**ATÉ 1 ANO**	**R$ 323.436.462,30**	**71,64%**
MÉDIO	**ATÉ 5 ANOS**	**R$ 82.223.387,93**	**18,21%**
ALTO	**ACIMA DE 5 ANOS**	**R$ 45.819.032,66**	**10,15%**
TOTAL		**R$ 451.478.882,89**	**100,00%**

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

DAVID JOSÉ FRANÇOSO
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: JUNHO/2023

FOLHAS 99/112 – PROCESSO 10/2023

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA Nº 18/2023 **DATA: 10/08/2023**

	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 a aderência das aplicações financeiras da Funprev em relação aos limites da Política de Investimentos e da Resolução CMN 4963/2021. O Comitê observa que a rentabilidade da carteira no mês de junho de 2023 foi de 1,72%, influenciada principalmente pelo resultado

nos fundos de ações, cujo retorno no mês de referência foi de 7,54%, seguido da renda fixa, segmento com maior exposição da carteira, com retorno de 1,11%. O segmento de investimento no exterior apresentou rentabilidade de -0,89% no mês em análise, porém no acumulado do ano apresentou variação positiva de aproximadamente 20%. O resultado da carteira no ano, está abaixo da meta gerencial, que mede a possibilidade de retorno dentre o perfil de risco da Fundação e que registrou no acumulado até junho um percentual de 8,42%, ante 6,66% da rentabilidade da carteira, justificando essa diferença pelo fato da posição atual da Funprev estar praticamente 85% no CDI e que a meta gerencial leva em consideração retornos de outros índices como o IMA-B e o IRF-M, cuja rentabilidade no ano está acima do CDI. Quanto a meta atuarial, esta encerrou o mês em 0,32%, e no acumulado do ano em 5,34%. Sendo assim, a Fundação obteve rentabilidade 24,72% acima da meta atuarial no 1º semestre de 2023.

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

FUNPREV BAURU

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS

MÊS: JUNHO/2023

ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 16/2023 DATA: 22/08/2023

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

Observações: Este Conselho recebe os autos (Processo nº 10/2023) e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, às folhas nº 113 e aprova referido relatório de investimentos base Junho/2023, item 5, da Ata da Reunião Ordinária 18/2023 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

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: JUNHO/2023

ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 16/2023 **DATA: 23/08/2023**

	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 114, e aprova o referido relatório de investimento base Junho/2023, conforme item 05 da Ata da Reunião Ordinária 18/2023 do Comitê de Investimento. (fl 115). Toma conhecimento também da aprovação do Conselho Curador, conforme fl 119.

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 do Conselho Fiscal

Giane Fátima Silva Francisco
Membro do Conselho Fiscal