

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

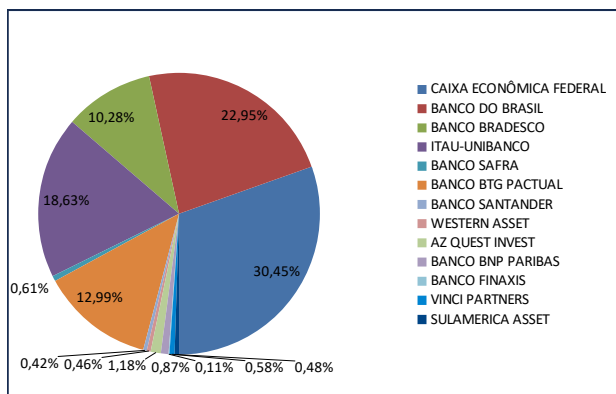
FUNDO	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	SALDO APLICADO	DISPONIBILIDADE PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 4963/2021	LIMITE LEGAL	% APLICADO	TX ADM	TAXA PERFORMANCE	NÍVEL DE RISCO (Incerteza)
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 07.442.078/0001-05 BB IMA-B TIT. PÚBLICOS PREVID FII	IMA-B	PAS			D+1	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 13077418000149 BB FII PREVID. DI TÍTULOS PÚBLICOS RF	CDI	PAS	44.492.821,61	27.053.227,31	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	16,24%	0,10%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 13.322.205/0001-35 BB FII 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 FII PREVID TP (IPCA XXI)	IPCA + 6%	PAS		20.474.986,06	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,65%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 15.486.093/0001-83 BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FII RF PREVIDENCIÁRIO	IPCA + 6%	PAS			2023	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 22.215.097/0001-55 CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	ALOCÇÃO ATIVADI	ATIVO			D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%		0,40%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.200/0001-97 CAIXA BRASIL FII REF DI LP	CDI	PAS	65.935.960,79	4.741.081,36	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	17,39%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 14.388.968/0001-71 CAIXA BRASIL FII IDKA IPCA PRÉ 2 ANOS	IDKA 2	PAS	20.382.039,23		D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,63%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.658/0001-93 CAIXA BRASIL FII REF DI LP	CDI	PAS		5.943.312,75	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	1,35%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
CAIXA EC. FEDERAL 20.139.595/0001-78 CAIXA BRASIL FII 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	31.891.710,78	5.275.221,96	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	8,43%	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		41.086.257,37	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	9,32%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAU-UNIBANCO 00.832.435/0001-00 ITAU INSTITUCIONAL FII RF REFR. DI	CDI	PAS		77.444.832,30	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	17,57%	0,18%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAU-UNIBANCO 21.838.150/0001-48 ITAU ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC FII	ALOCÇÃO ATIVADI	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 FII RF	CDI	PASSIVO		49.813.500,86	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	11,30%	0,08%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 23.176.675/0001-91 BTG PACTUAL 2024 TP FII RF	IPCA + 6%	VÉRTICE		5.047.793,10	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,15%	0,15%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.018.364/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO		483.710,88	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		2.122.531,75	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,48%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 17.413.636/0001-68 BB GLOBAL SELECT EQUIT INV. EXTERIOR FII MULT	MERC. EXTERNO	ATIVO		4.842.773,09	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,10%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.805/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO		2.133.094,81	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,48%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21.595.829/0001-54 SAFRA S&P REAIS FII 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 SRI FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS			D+2	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%		0,20%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.436.819/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO		2.674.147,84	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	0,61%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA 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
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.570.307,26	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,58%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.453.850/0001-48 WESTERN ASSET US INDEX 500 FII MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		2.009.528,50	D+1	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	0,46%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 03.737.188/0001-43 CAIXA RV-30 FII 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		5.184.714,39	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,18%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAU-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAU FIC FIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		4.665.653,07	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,06%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMERICA DTMV 11.458.144/0001-02 SULAMERICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.131.871,12	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,48%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.939/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO		3.814.740,18	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,87%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.690.879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.087.781,98	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,47%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 05.988.623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO		2.122.164,49	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,48%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.762/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO		1.872.383,71	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	0,48%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FII FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.375.986,49	D+33	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,54%	3,00%	N POSSUI	ALTO
<b>TOTAL RENDA FIXA</b> .....							<b>400.066.456,36</b>	<b>100,00%</b>	<b>90,79%</b>		
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b> .....							<b>40.607.678,68</b>	<b>70,00%</b>	<b>9,21%</b>		
<b>TOTAL GERAL</b> .....							<b>440.674.135,04</b>				

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO  
Economista / Corecon 32.356

DAVID JOSÉ FRANCOSO  
Presidente - FUNPREV

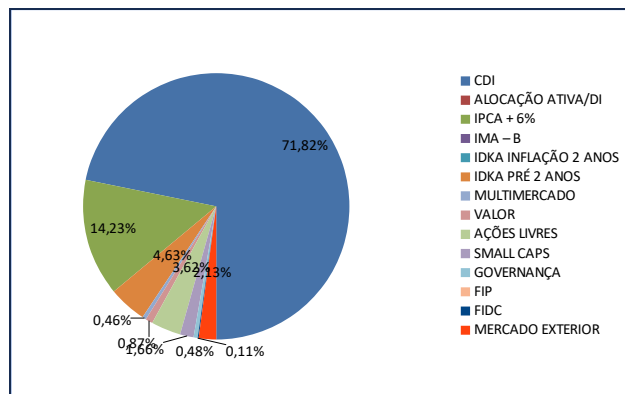
**RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE JULHO/2023**

**DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**



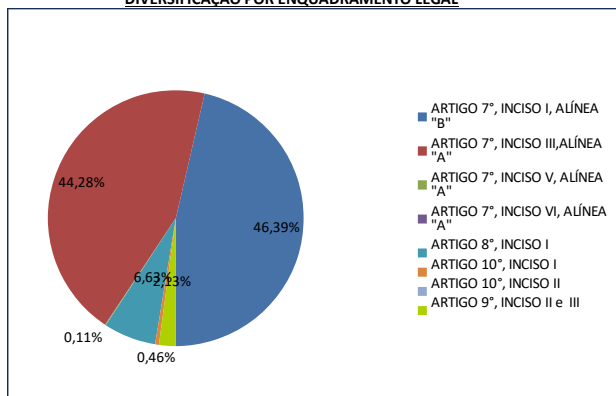
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	134.169.326,87	30,45%
BANCO DO BRASIL	101.119.434,63	22,95%
BANCO BRADESCO	45.296.203,84	10,28%
ITAU-UNIBANCO	82.110.485,37	18,63%
BANCO SAFRA	2.674.147,84	0,61%
BANCO BTG PACTUAL	57.237.280,45	12,99%
BANCO SANTANDER	1.872.383,71	0,42%
WESTERN ASSET	2.009.528,50	0,46%
AZ QUEST INVEST	5.184.714,39	1,18%
BANCO BNP PARIBAS	3.814.740,18	0,87%
BANCO FINAXIS	483.710,88	0,11%
VINCI PARTNERS	2.570.307,26	0,58%
SULAMERICA ASSET	2.131.871,12	0,48%
<b>TOTAL . . . . .</b>	<b>440.674.135,04</b>	<b>100,00%</b>

**DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS**



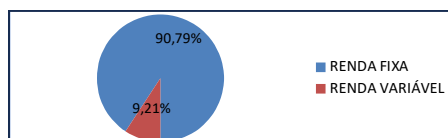
CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
CDI	316.510.994,35	71,82%
ALOCÇÃO ATIVA/DI		
IPCA + 6%	62.689.711,90	14,23%
IMA - B		
IDKA INFLAÇÃO 2 ANOS		
IDKA PRÉ 2 ANOS	20.382.039,23	4,63%
MULTIMERCADO	2.009.528,50	0,46%
VALOR	3.814.740,18	0,87%
AÇÕES LIVRES	15.964.694,73	3,62%
SMALL CAPS	7.306.878,88	1,66%
GOVERNANÇA	2.122.531,75	0,48%
FIP		
FIDC	483.710,88	0,11%
MERCADO EXTERIOR	9.389.304,64	2,13%
<b>TOTAL . . . . .</b>	<b>440.674.135,04</b>	<b>100,00%</b>

**DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL**



ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	204.431.300,91	46,39%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	195.151.444,57	44,28%
ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	483.710,88	0,11%
ARTIGO 7º, INCISO VI, ALÍNEA "A"		
ARTIGO 8º, INCISO I	29.208.845,54	6,63%
ARTIGO 10º, INCISO I	2.009.528,50	0,46%
ARTIGO 10º, INCISO II		
ARTIGO 9º, INCISO II e III	9.389.304,64	2,13%
<b>TOTAL . . . . .</b>	<b>440.674.135,04</b>	<b>100,00%</b>

**DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO**



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	400.066.456,36	90,79%
RENDA VARIÁVEL	40.607.678,68	9,21%
<b>TOTAL . . . . .</b>	<b>440.674.135,04</b>	<b>100,00%</b>

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	<b>1,28%</b>
META ATUARIAL NO MÊS	0,52%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	<b>8,02%</b>
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	-0,41%
META GERENCIAL ANO	<b>9,71%</b>
META ATUARIAL ANO	<b>5,89%</b>
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	136,16%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)	ATÉ 1 ANO	MONTEANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 316.510.994,35	71,82%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 83.071.751,13	18,85%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 41.091.389,56	9,32%
<b>TOTAL</b>		<b>R\$ 440.674.135,04</b>	<b>100,00%</b>

**LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO**  
Economista /Corecon 32.356

**DAVID JOSÉ FRANÇO**  
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: JULHO/2023**  
**FOLHAS 123/130 – PROCESSO 10/2023**

**PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS**  
**ATA Nº 21/2023 DATA: 31/08/2023**

	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 verificou 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 julho de 2023 foi de 1,28%, influenciada principalmente pelo resultado



**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)



nos fundos de ações, cujo retorno do segmento no mês de referência foi de 3,41%, seguido do segmento de investimentos no exterior com rentabilidade de 1,85% e do segmento de renda fixa, com rentabilidade de 1,08%. Em participação, a renda fixa foi o fator determinante pelo seu peso no total da carteira, uma vez que quase 90% da carteira da Fundação está alocada nesse segmento. 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 9,71%, ante 8,02% 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 0,52%, e no acumulado do ano em 5,89%. Sendo assim, a Fundação obteve rentabilidade 36,16% acima da meta atuarial até 31/07/2023, contribuindo com o resultado atuarial. Em volume de recursos, a Fundação encerrou o mês de julho/23 com R\$ 440.674.135,04 aplicados em fundos de investimentos. Os rendimentos acumulados no ano somam R\$ 35.042.186,76.

**ALEXANDRE FRUCTUOSO DA COSTA – PRESIDENTE**

**DIOGO NUNES PEREIRA – SECRETÁRIO**

**ANTONIO CARLOS BATISTA MARTINEZ – MEMBRO**

**EDUARDO DE ALMEIDA – MEMBRO**

**SÉRGIO RICARDO CORREA ALBERTO - MEMBRO**



**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**

**SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS**  
**MÊS: JULHO/2023**

**ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR**

**ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 17/2023 DATA: 12/09/2023**

	<b>SIM</b>	<b>NÃO</b>
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 130 e aprova referido relatório de investimentos base Julho/2023, item 6, da Ata da Reunião Ordinária nº 21/2023, de 31 de agosto de 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



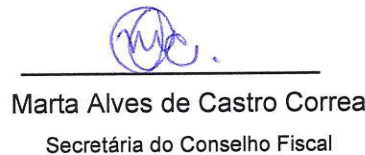
**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**  
**SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS**  
**MÊS: JULHO/2023**

**ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL**  
**ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 17/2023**                      **DATA: 13/09/2023**

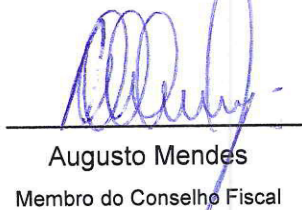
	<b>SIM</b>	<b>NÃO</b>
O Conselho Fiscal aprova o relatório de investimentos?	X	

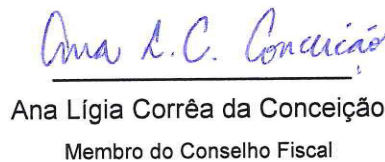
Observações: Este Conselho recebe os autos (Processo 10/2023) e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, as fls 130, e aprova o referido relatório de investimento base Julho/2023, conforme item 06 da Ata da Reunião Ordinária 21/2023 do Comitê de Investimento. (fl 132). Toma conhecimento também da aprovação do Conselho Curador, conforme fl 137.

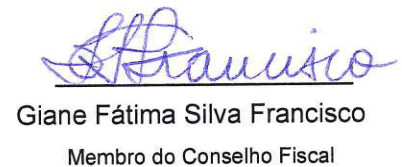
  
Rafael Vicentin Ferrero Salla  
Presidente do Conselho Fiscal

  
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