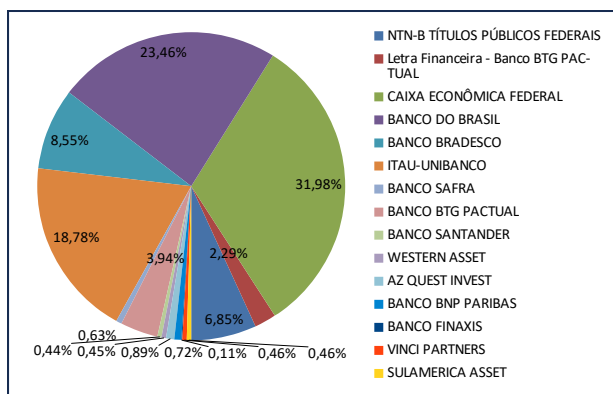


## RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE AGOSTO/2023

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					D+1						
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 11.046.645/0001-81 BB FI PREVID. DI TÍTULOS PÚBLICOS RF	CDI	PAS	45.871.553,17	27.935.978,47	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	16,83%	0,10%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 13.322.295/0001-35 BB											
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 44.345.590/0001-60 BB FI PREVID. TP (IPCA XXI)	IPCA + 6%	PAS		20.095.931,06	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,58%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 15.486.093/0001-83 BB											
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 23.215.097/0001-55 CAIXA											
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.260/0001-97 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS	71.445.356,12	4.692.155,12	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	18,96%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 14.388.999/0001-71 CAIXA BRASIL FI IDKA IPCA PRÉ 2 ANOS	IDKA 2	PAS	20.549.383,51		D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,68%	0,20%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.658/0001-93 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS		7.039.798,28	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	1,60%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
CAIXA EC. FEDERAL 20.139.595/0001-78 CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	31.348.174,40	5.185.315,36	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	8,33%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 24.022.568/0001-82 BRADESCO											
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 03.399.411/0001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS		33.628.189,28	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	7,67%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAU-UNIBANCO 00.832.435/0001-00 ITAU INSTITUCIONAL FI RF REFR. DI	CDI	PAS		78.451.975,16	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	17,88%	0,18%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2025 TPF	IPCA + 5,568%	MARCAÇÃO NA CURVA		30.028.054,79	2025	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	6,85%		N POSSUI	BAIXO
LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2025	IPCA + 6,14%	MARCAÇÃO NA CURVA		10.041.585,98	2025	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	2,29%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 29.650.062/0001-20 BTG PACTUAL TESOUREIRO SELIC S DI INSTITUCIONAL FI RF	CDI	PASSIVO		49.813.500,86	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	10,35%	0,08%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 08.631.542/0001-37 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE		4.949.284,50	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,13%	0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.016.364/0001-65 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO		481.546,14	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	5,00%	0,11%	0,25%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 10.418.350/0001-88 BB PREVID FIA GOV CORPORATIVA	GOVERNANÇA	PAS		2.012.176,14	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,46%	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		4.970.014,23	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,13%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.805/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO		2.034.816,88	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,46%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 21.595.829/0001-54 SAFRA											
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 36.499.594/0001-74 BTG											
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.436.818/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO		2.774.838,83	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	0,63%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 13.396.703/0001-22 VINCI											
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.012.844,59	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,46%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.453.860/0001-48 WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		1.990.469,58	D+1	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	0,45%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 03.737.188/0001-43 CAIXA											
RENDA VARIÁVEL CAIXA EC. FEDERAL 13.767.159/0001-88 CAIXA											
RENDA VARIÁVEL AZ QUEST INVEST 11.392.165/0001-72 AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	SMALL CAPS	ATIVO		3.921.649,35	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,89%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAU-UNIBANCO 08.817.144/0001-10 ITAU FIC FIA RP IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		3.943.637,04	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,90%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMERICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMERICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.011.317,76	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,46%	1,50%	20% exceder o índice%	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.939/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO		3.145.648,74	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,72%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.660.879/0001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO		1.955.637,20	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,45%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 05.988.623/0001-99 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO		1.904.065,79	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,43%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.894.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO		1.911.609,99	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	0,43%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		1.914.058,95	D+33	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,44%	3,00%	N POSSUI	ALTO
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>			<b>402.150.223,27</b>				<b>100,00%</b>	<b>91,68%</b>			
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>			<b>36.502.985,07</b>				<b>70,00%</b>	<b>8,32%</b>			
<b>TOTAL GERAL</b>			<b>438.653.208,34</b>								

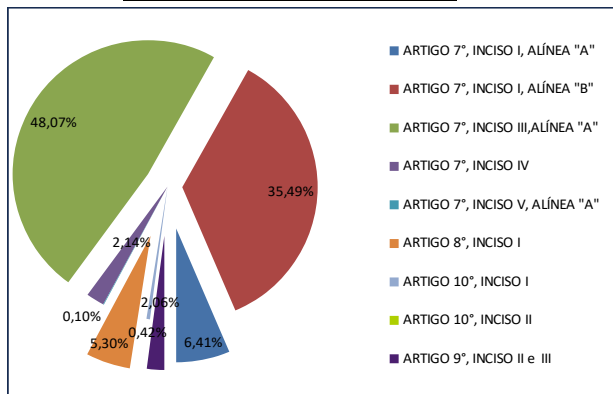
**RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE AGOSTO/2023**

**DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**



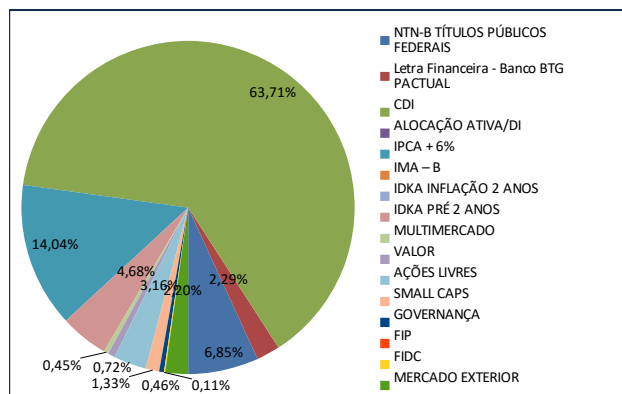
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
NTN-B TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	30.028.054,79	6,85%
Letra Financeira - Banco BTG PACTUAL	10.041.585,98	2,29%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	140.260.182,79	31,98%
BANCO DO BRASIL	102.920.469,95	23,46%
BANCO BRADESCO	37.488.092,27	8,55%
ITAU-UNIBANCO	82.395.612,20	18,78%
BANCO SAFRA	2.774.838,83	0,63%
BANCO BTG PACTUAL	17.269.285,38	3,94%
BANCO SANTANDER	1.911.609,99	0,44%
WESTERN ASSET	1.990.469,58	0,45%
AZ QUEST INVEST	3.921.649,35	0,89%
BANCO BNP PARIBAS	3.145.648,74	0,72%
BANCO FINAXIS	481.546,14	0,11%
VINCI PARTNERS	2.012.844,59	0,46%
SULAMERICA ASSET	2.011.317,76	0,46%
TOTAL . . . . .	438.653.208,34	100,00%

**DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL**



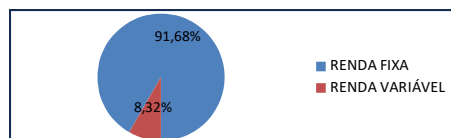
ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	30.028.054,79	6,85%
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	166.341.562,40	37,92%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	225.285.528,75	51,36%
ARTIGO 7º, INCISO IV	10.041.585,98	2,29%
ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	481.546,14	0,11%
ARTIGO 8º, INCISO I	24.856.052,44	5,67%
ARTIGO 10º, INCISO I	1.990.469,58	0,45%
ARTIGO 10º, INCISO II	9.656.463,05	2,20%
ARTIGO 9º, INCISO II e III	9.656.463,05	2,20%
TOTAL . . . . .	438.653.208,34	100,00%

**DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS**



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
NTN-B TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	30.028.054,79	6,85%
Letra Financeira - Banco BTG PACTUAL	10.041.585,98	2,29%
CDI	279.470.947,53	63,71%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI		
IPCA + 6%	61.578.705,32	14,04%
IMA - B		
IDKA INFLAÇÃO 2 ANOS		
IDKA PRÉ 2 ANOS	20.549.383,51	4,68%
MULTIMERCADO	1.990.469,58	0,45%
VALOR	3.145.648,74	0,72%
AÇÕES LIVRES	13.872.512,42	3,16%
SMALL CAPS	5.825.715,14	1,33%
GOVERNANÇA	2.012.176,14	0,46%
FIP		
FIDC	481.546,14	0,11%
MERCADO EXTERIOR	9.656.463,05	2,20%
TOTAL . . . . .	438.653.208,34	100,00%

**DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO**



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	402.150.223,27	91,68%
RENDA VARIÁVEL	36.502.985,07	8,32%
TOTAL . . . . .	438.653.208,34	100,00%

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	0,72%
META ATUARIAL NO MÊS	0,67%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	8,80%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	-0,87%
META GERENCIAL ANO	10,10%
META ATUARIAL ANO	6,60%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	133,33%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)		MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 381.119.293,71	86,88%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 20.549.383,51	4,68%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 36.984.531,21	8,43%
TOTAL		R\$ 438.653.208,43	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



160

**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**  
**SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS**  
**MÊS: AGOSTO/2023**  
**FOLHAS 143/159 – PROCESSO 10/2023**

**PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS**  
**ATA Nº 23/2023**                      **DATA: 21/09/2023**

	<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 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 agosto de 2023 foi de 0,72%, influenciada principalmente pelo



**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)



resultado no segmento de investimento no exterior, cujo retorno no mês de referência foi de 2,85%, seguido do segmento de renda fixa com rentabilidade de 1,14%. Os fundos de ações “puxaram” a rentabilidade da carteira para baixo, com rentabilidade de -5,36%. 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 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 agosto um percentual de 10,10%, ante 8,80% 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 0,67%, e no acumulado do ano em 6,60%. Sendo assim, a Fundação obteve rentabilidade 33,37% acima da meta atuarial até 31/08/2023, contribuindo com o resultado atuarial. Em volume de recursos, a Fundação encerrou o mês de agosto/23 com R\$ 438.653.208,34 aplicados em fundos de investimentos. Os rendimentos acumulados no ano somam R\$ 38.200.341,84.

**ALEXANDRE FRUCTUOSO DA COSTA – PRESIDENTE**

**DIOGO NUNES PEREIRA – SECRETÁRIO**

**ANTONIO CARLOS BATISTA MARTINEZ – MEMBRO**

**EDUARDO DE ALMEIDA – MEMBRO**

**SÉRGIO RICARDO CORREA ALBERTO - MEMBRO**



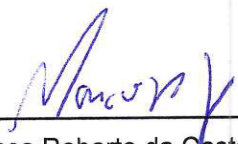



**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**  
**SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS**  
**MÊS: AGOSTO/2023**

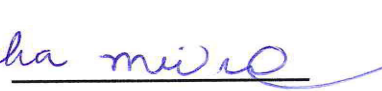
**ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR**  
**ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 18/2023 DATA: 26/09/2023**


	<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 159 e aprova referido relatório de investimentos base Agosto/2023, conforme item 6, da Ata da Reunião Ordinária nº 23/2023, de 21 de setembro de 2023, do Comitê de Investimentos.


  
\_\_\_\_\_  
Marcos Roberto da Oosta 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: AGOSTO/2023


ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 18/2023

DATA: 27/09/2023

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

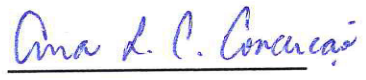
Observações: Este Conselho recebe os autos (Processo 10/2023) e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, as fls 160, e aprova o referido relatório de investimento base AGOSTO/2023, conforme item 06 da Ata da Reunião Ordinária 23/2023 do Comitê de Investimento. (fl 161). Toma conhecimento também da aprovação do Conselho Curador, conforme fl 166.

  
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 Lúcia Corrêa da Conceição  
Membro do Conselho Fiscal

  
Giane Fátima Silva Francisco  
Membro do Conselho Fiscal