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

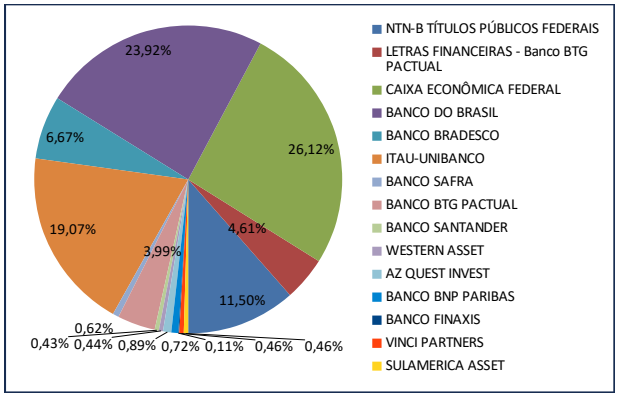
FUNDO	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	SALDO APLICADO	DISPONIBILIDADE PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 4963/2021	LIMITE LEGAL	% APLICADO	TX ADM	TAXA PERFORMANCE	NÍVEL DE RISCO (Incerteza)
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 11.046.645/0001-81 BB FI PREVID. DI TÍTULOS PÚBLICOS RF	CDI	PAS	46.892.010,96	28.210.184,21	D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	17,21%	0,10%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 44.345.590/0001-60 BB FI PREVID TP IPCA XXI	IPCA + 6%	PAS		20.316.651,05	2024	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,66%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS	66.609.051,21	4.540.108,57	D+0	ARTIGO 7°, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	17,66%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.658/0001-93 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS		5.908.370,98	D+0	ARTIGO 7°, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	1,35%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 20.139.595/0001-78 CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	31.692.411,69	5.242.255,80	2024	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	8,46%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 03.399.411/0001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS		25.326.353,34	D+0	ARTIGO 7°, INCISO III,ALÍNEA "A"	60,00%	5,80%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAU-UNIBANCO 00.832.435/0001-00 ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REFR. DI	CDI	PAS		79.277.075,10	D+0	ARTIGO 7°, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	18,17%	0,18%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2025 TPF	IPCA + 5,5680%	MARCAÇÃO NA CURVA		30.170.674,13	2025	ARTIGO 7°, INCISO I,ALÍNEA "A"	100,00%	6,91%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2040 TPF	IPCA + 5,7520%	MARCAÇÃO NA CURVA		12.007.504,53	2040	ARTIGO 7°, INCISO I,ALÍNEA "A"	100,00%	2,75%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2045 TPF	IPCA + 5,8230%	MARCAÇÃO NA CURVA		8.002.898,83	2045	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	1,83%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2025	IPCA + 6,1400%	MARCAÇÃO NA CURVA		10.107.581,41	2025	ARTIGO 7°, INCISO IV	20,00%	2,32%		N POSSUI	BAIXO
BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2028	IPCA + 6,2900%	MARCAÇÃO NA CURVA		6.004.732,31	2028	ARTIGO 7°, INCISO IV	20,00%	1,38%		N POSSUI	MÉDIO
BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-44 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2030	IPCA + 6,3900%	MARCAÇÃO NA CURVA		4.003.184,75	2030	ARTIGO 7, INCISO IV	20,00%	0,92%		N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 29.650.082/0001-00 BTG PACTUAL TESOURO SELIC S DI INSTITUCIONAL FI RF	CDI	PASSIVO		10.507.935,76	D+0	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	2,41%	0,08%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 09.631.542/0001-37 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE		4.994.982,00	2024	ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,14%	0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.018.364/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO		479.336,26	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7°, 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		2.030.329,97	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	0,47%	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		4.877.963,36	D+5	ARTIGO 9°, INCISO II	10,00%	1,12%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.805/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO		2.052.500,10	D+3	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	0,47%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.436.818/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO		2.697.269,74	D+5	ARTIGO 9°, INCISO III	10,00%	0,62%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.012.244,74	D+32	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	0,46%	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		1.902.325,97	D+1	ARTIGO 10°, INCISO I		0,44%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL AZ QUEST INVEST 11.392.165/0001-72 AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	SMALL CAPS	ATIVO		3.880.253,80	D+30	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	0,89%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAU-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAU FICFIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		3.946.384,33	D+5	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	0,90%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMERICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMÉRICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.020.981,05	D+4	ARTIGO 8°, 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		3.124.306,02	D+30	ARTIGO 8°, 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		1.937.041,72	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	0,44%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.988.623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO		1.856.983,48	D+4	ARTIGO 8°, INCISO I		0,43%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO		1.858.290,35	D+8	ARTIGO 9°, 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 FIQ FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		1.925.994,52	D+33	ARTIGO 8°, INCISO I	30,00%	0,44%	3,00%	N POSSUI	ALTO
			TOTAL RENDA FIXA	**400.293.302,89**			**100,00%**	**91,72%**			
			TOTAL RENDA VARIÁVEL	**36.122.869,15**			**70,00%**	**8,28%**			
			TOTAL GERAL	**436.416.172,04**							

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

DAVID JOSÉ FRANÇOSO
Presidente – FUNPREV

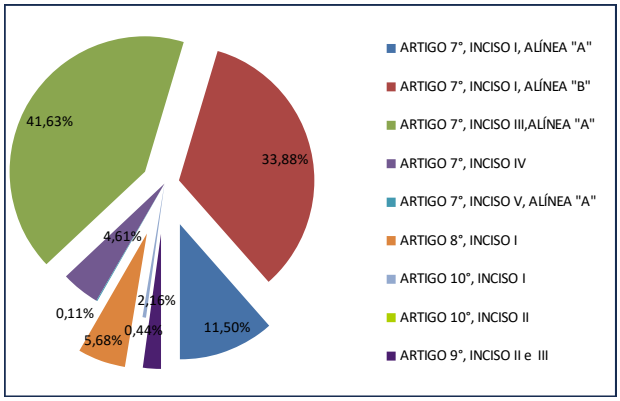
RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE SETEMBRO/2023

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



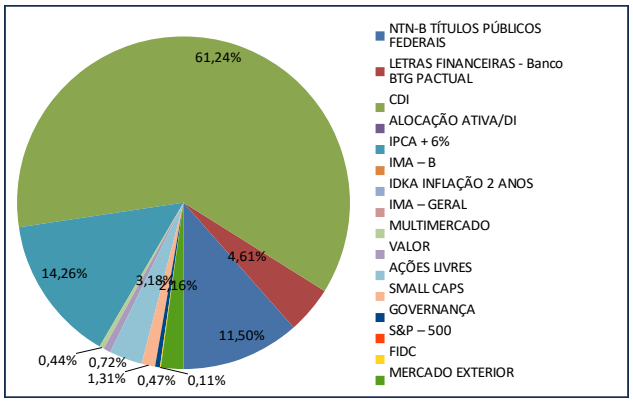
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
NTN-B TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	50.181.077,49	11,50%
LETRAS FINANCEIRAS - Banco BTG PACTUAL	20.115.498,47	4,61%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	113.992.198,25	26,12%
BANCO DO BRASIL	104.379.639,65	23,92%
BANCO BRADESCO	29.120.378,54	6,67%
ITAU-UNIBANCO	83.223.459,43	19,07%
BANCO SAFRA	2.697.269,74	0,62%
BANCO BTG PACTUAL	17.428.912,28	3,99%
BANCO SANTANDER	1.858.290,35	0,43%
WESTERN ASSET	1.902.325,97	0,44%
AZ QUEST INVEST	3.880.253,80	0,89%
BANCO BNP PARIBAS	3.124.306,02	0,72%
BANCO FINAXIS	479.336,26	0,11%
VINCI PARTNERS	2.012.244,74	0,46%
SULAMERICA ASSET	2.020.981,05	0,46%
TOTAL . . . . . :	436.416.172,04	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL



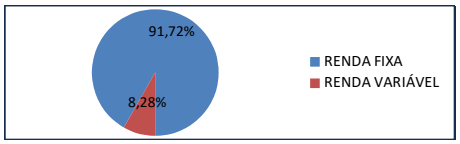
ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "A"	50.181.077,49	11,50%
ARTIGO 7°, INCISO I, ALÍNEA "B"	147.856.431,47	33,88%
ARTIGO 7°, INCISO III,ALÍNEA "A"	181.660.959,20	41,63%
ARTIGO 7°, INCISO IV	20.115.498,47	4,61%
ARTIGO 7°, INCISO V, ALÍNEA "A"	479.336,26	0,11%
ARTIGO 8°, INCISO I	24.787.019,73	5,68%
ARTIGO 10°, INCISO I	1.902.325,97	0,44%
ARTIGO 10°, INCISO II		
ARTIGO 9°, INCISO II e III	9.433.523,45	2,16%
TOTAL . . . . . :	436.416.172,04	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
NTN-B TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	50.181.077,49	11,50%
LETRAS FINANCEIRAS - Banco BTG PACTUAL	20.115.498,47	4,61%
CDI	267.271.090,13	61,24%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI		
IPCA + 6%	62.246.300,54	14,26%
IMA – B		
IDKA INFLAÇÃO 2 ANOS		
IMA – GERAL		
MULTIMERCADO	1.902.325,97	0,44%
VALOR	3.124.306,02	0,72%
AÇÕES LIVRES	13.895.146,46	3,18%
SMALL CAPS	5.737.237,28	1,31%
GOVERNANÇA	2.030.329,97	0,47%
S&P – 500		
FIDC	479.336,26	0,11%
MERCADO EXTERIOR	9.433.523,45	2,16%
TOTAL . . . . . :	436.416.172,04	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	400.293.302,89	91,72%
RENDA VARIÁVEL	36.122.869,15	8,28%
TOTAL . . . . . :	436.416.172,04	100,00%

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	0,76%
META ATUARIAL NO MÊS	0,64%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	9,63%
EVOLUÇÃO DO PATRIMONIO NO ANO	-1,37%
META GERENCIAL ANO	10,22%
META ATUARIAL ANO	7,28%
ATINGIMENTO DA META GERENCIAL NO ANO	94,23%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	132,28%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)		MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R$ 369.795.646,37	84,73%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R$ 6.004.732,31	1,38%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R$ 60.615.793,52	13,89%
TOTAL		R$ 436.416.172,04	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: SETEMBRO/2023

FOLHAS 194/211 – PROCESSO 10/2023

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA Nº 30/2023 **DATA: 30/11/2023**

	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 setembro de 2023 foi de 0,76%, influenciada positivamente pelo

resultado no segmento de renda fixa, cujo retorno no mês de referência foi de 0,93%, sendo que o segmento de renda variável teve rentabilidade negativa de 0,59% e o de investimento no exterior, também negativo de 2,31%. Os fundos de ações e de exterior fizeram com que a rentabilidade da carteira recuasse. 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 dentre o perfil de risco da Fundação e que registrou no acumulado até agosto um percentual de 10,22%, ante 9,63% da rentabilidade da carteira. Quanto a meta atuarial, esta encerrou o mês em 0,64%, e no acumulado do ano em 7,28%. Sendo assim, a Fundação obteve rentabilidade 32,20% acima da meta atuarial até 30/09/2023, contribuindo com o resultado atuarial. Em volume de recursos, a Fundação encerrou o mês de setembro/23 com R$ 436.416.172,04 aplicados em fundos de investimentos, títulos públicos federais e letras financeiras. Os rendimentos acumulados no ano somam R$ 41.548.086,11.

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: SETEMBRO/2023

ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 22/2023 DATA: 05/12/2023

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

Observações: Este Conselho recebe os autos e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, às folhas nº 212 e aprova referido relatório de investimentos base Setembro/2023, conforme item 03, da Ata da Reunião Ordinária nº 30/2023, de 30 de novembro 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

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: SETEMBRO/2023

ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 23/2023 **DATA: 06/12/2023**

	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 212, e aprova o referido relatório de investimento base SETEMBRO/2023, conforme item 03 da Ata da Reunião Ordinária 30/2023 do Comitê de Investimento. (fl 214). Toma conhecimento também da aprovação do Conselho Curador, conforme fl 216.

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