

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

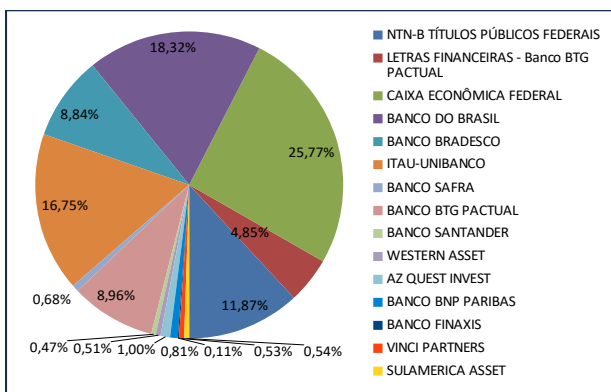
FUNDO	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	SALDO APLICADO	DISPONIBILIDADE PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 4963/2021	LIMITE LEGAL	% APLICADO	TX ADM	TAXA PERFORMANCE	NÍVEL DE RISCO (Incerteza)
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 11.046.645/0001-81 BB FI PREVID. DI TÍTULOS PÚBLICOS RF	CDI	PAS	17.921.996,20	29.007.452,08	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	11,08%	0,10%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 44.345.590/0001-60 BB FI PREVID. TP IPCA XXI	IPCA + 6%	PAS		20.755.582,04	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,90%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS	61.746.937,81	4.256.180,98	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	16,86%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.658/0001-93 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS		5.441.640,58	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	1,28%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 20.139.950/0001-78 CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	32.377.144,62	5.355.517,79	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	8,91%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 03.399.411/0001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS		33.248.232,70	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	7,85%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 00.852.453/0001-00 ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REFR. DI	CDI	PAS		66.484.641,77	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	15,69%	0,18%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2025 TFF	IPCA + 5,5680%	MARCAÇÃO NA CURVA		30.016.784,03	2025	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	7,08%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2040 TFF	IPCA + 5,7520%	MARCAÇÃO NA CURVA		12.295.954,56	2040	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	2,90%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2045 TFF	IPCA + 5,8230%	MARCAÇÃO NA CURVA		7.969.000,08	2045	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	1,88%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.294/0001-45 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2025	IPCA + 6,1400%	MARCAÇÃO NA CURVA		10.332.259,28	2025	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	2,44%		N POSSUI	BAIXO
BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.294/0001-45 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2028	IPCA + 6,2900%	MARCAÇÃO NA CURVA		6.141.967,26	2028	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	1,45%		N POSSUI	MÉDIO
BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.294/0001-44 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2030	IPCA + 6,3900%	MARCAÇÃO NA CURVA		4.095.607,58	2030	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	0,97%		N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 29.650.082/0001-00 BTG PACTUAL TESOURO SELIC S DI INSTITUCIONAL FI RF	CDI	PASSIVO		30.675.244,77	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	7,24%	0,08%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 09.631.542/0001-37 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE		5.104.956,60	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,20%	0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.018.354/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO		452.208,40	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		2.316.037,31	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,55%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 17.413.636/0001-88 BB GLOBAL SELECT EQUIT INV. EXTERIOR FI MULT	MERC. EXTERNO	ATIVO		5.279.170,80	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,25%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.825/0001-50 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO		2.325.394,56	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,55%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 16.436.816/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO		2.877.046,32	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	0,68%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.259.314,76	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,53%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.453.850/0001-48 WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS		2.149.019,48	D+1	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	0,51%	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		4.225.953,88	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,00%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAÚ-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAÚ FIC FIA SRI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		4.464.567,99	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,05%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMERICA DTMV 11.458.144/0001-02 SULAMERICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.294.909,28	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,54%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.959/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO		3.438.205,55	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,81%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.660.879/0001-98 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.167.648,47	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,51%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.988.623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO		2.048.064,64	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,48%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO		1.991.652,02	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	0,46%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-84 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.172.807,17	D+33	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,51%	3,00%	N POSSUI	ALTO
TOTAL RENDA FIXA			383.679.309,13				100,00%	90,56%			
TOTAL RENDA VARIÁVEL			40.009.792,23				70,00%	9,44%			
TOTAL GERAL			423.689.101,36								

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

DAVID JOSÉ FRANÇOIS
Presidente - FUNPREV

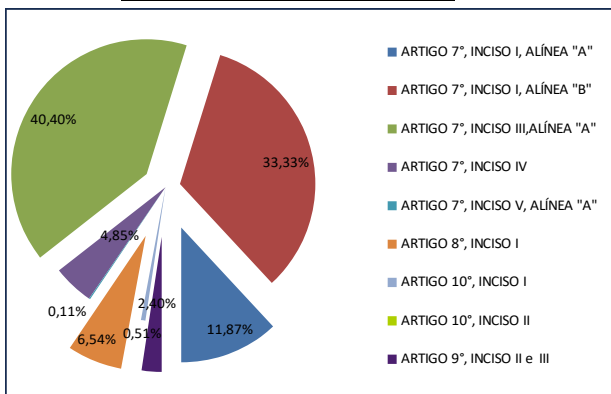
RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE DEZEMBRO/2023

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
NTN-B TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	50.281.738,67	11,87%
LETRAS FINANCEIRAS - Banco BTG PACTUAL	20.569.834,12	4,85%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	109.177.421,78	25,77%
BANCO DO BRASIL	77.605.632,99	18,32%
BANCO BRADESCO	37.463.945,81	8,84%
ITAU-UNIBANCO	70.949.209,76	16,75%
BANCO SAFRA	2.877.046,32	0,68%
BANCO BTG PACTUAL	37.953.008,54	8,96%
BANCO SANTANDER	1.991.652,02	0,47%
WESTERN ASSET	2.149.019,48	0,51%
AZ QUEST INVEST	4.225.953,88	1,00%
BANCO BNP PARIBAS	3.438.205,55	0,81%
BANCO FINAXIS	452.208,40	0,11%
VINCI PARTNERS	2.259.314,76	0,53%
SULAMERICA ASSET	2.294.909,28	0,54%
TOTAL	423.689.101,36	100,00%

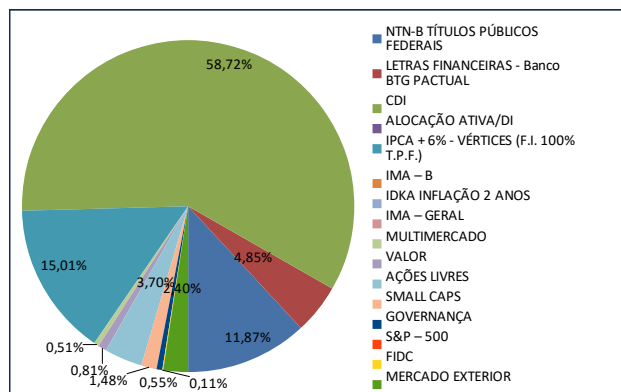
DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL



ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	50.281.738,67	11,87%
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	141.197.894,10	33,33%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	171.177.633,84	40,40%
ARTIGO 7º, INCISO IV	20.569.834,12	4,85%
ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	452.208,40	0,11%
ARTIGO 8º, INCISO I	27.712.903,61	6,54%
ARTIGO 10º, INCISO I	2.149.019,48	0,51%
ARTIGO 10º, INCISO II		
ARTIGO 9º, INCISO II e III	10.147.869,14	2,40%
TOTAL	423.689.101,36	100,00%

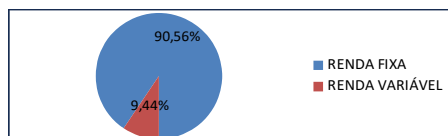
LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356

DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
NTN-B TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	50.281.738,67	11,87%
LETRAS FINANCEIRAS - Banco BTG PACTUAL	20.569.834,12	4,85%
CDI	248.782.326,89	58,72%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI		
IPCA + 6% - VÉRTICES (F.I. 100% T.P.F.)	63.593.201,05	15,01%
IMA - B		
IDKA INFLAÇÃO 2 ANOS		
IMA - GERAL		
MULTIMERCADO	2.149.019,48	0,51%
VALOR	3.438.205,55	0,81%
AÇÕES LIVRES	15.684.642,23	3,70%
SMALL CAPS	6.274.018,52	1,48%
GOVERNANÇA	2.316.037,31	0,55%
S&P - 500		
FIDC	452.208,40	0,11%
MERCADO EXTERIOR	10.147.869,14	2,40%
TOTAL	423.689.101,36	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	383.679.309,13	90,56%
RENDA VARIÁVEL	40.009.792,23	9,44%
TOTAL	423.689.101,36	100,00%

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	1,24%
META ATUARIAL NO MÊS	0,94%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	13,31%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	-4,25%
META GERENCIAL ANO	14,22%
META ATUARIAL ANO	9,72%
ATINGIMENTO DA META GERENCIAL NO ANO	93,60%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	136,93%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)	MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL	
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 352.724.571,42	83,25%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 6.141.967,26	1,45%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 64.822.562,85	15,30%
TOTAL		R\$ 423.689.101,37	100,00%

DAVID JOSÉ FRANÇOIS
Presidente - FUNPREV



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS

MÊS: DEZEMBRO/2023

FOLHAS 257/275 – PROCESSO 10/2023

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA Nº 03/2024

DATA: 01/02/2024

	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 dezembro de 2023 foi de 1,24%, influenciada positivamente pelos



**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



resultados nos segmentos de renda variável, cujo retorno no mês de referência foi de 5,40%, no segmento de investimento no exterior com retorno de 3,40% e por fim o segmento de renda fixa, com rentabilidade de 0,89%. Em participação, a renda fixa possui a maior concentração no total da carteira, uma vez que quase 90% da carteira da Fundação está alocada nesse segmento. O resultado no ano, está ligeiramente abaixo da meta gerencial, que mede a possibilidade de retorno dentre o perfil de risco da Fundação e que registrou no acumulado até dezembro um percentual de 14,22%, ante 13,31% da rentabilidade da carteira. Quanto a meta atuarial, esta encerrou o mês em 0,94%, e no acumulado do ano em 9,72%. Sendo assim, a Fundação obteve rentabilidade 36,99% acima da meta atuarial em 2023 com data-base em 31/12/2023, contribuindo com o resultado atuarial. Em volume de recursos, a Fundação encerrou o mês de dezembro/23 com R\$ 423.689.101,36 aplicados em fundos de investimentos, títulos públicos federais e letras financeiras. Os rendimentos acumulados no ano somam R\$ 55.947.684,10.

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: DEZEMBRO/2023

ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR
ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 03/2024 DATA: 06/02/2024

	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 275/276 e aprova referidos relatórios de investimentos base Dezembro/2023, conforme item 03, da Ata da Reunião Ordinária nº 03/2024, de 01 de fevereiro de 2024, do Comitê de Investimentos.

Marcos Roberto da Costa Garcia
Presidente do Conselho Curador

Neusa Maria Ferraz Valdo
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: DEZEMBRO/2023

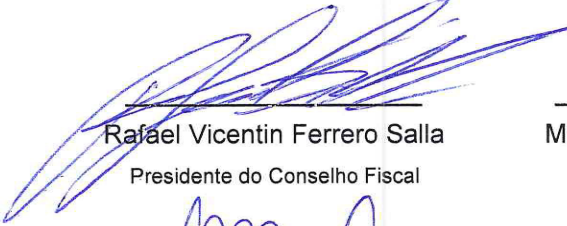
ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 03/2024

DATA: 07/02/2024


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

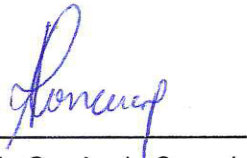
Observações: Este Conselho recebe os autos (Processo 10/2023) e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, as fls 276, e aprova o referido relatório de investimento base DEZEMBRO/2023, conforme item 03 da Ata da Reunião Ordinária 03/2024 do Comitê de Investimento. (fl 277). Toma conhecimento também da aprovação do Conselho Curador, conforme fl 280.


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