

## RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE JANEIRO/2024

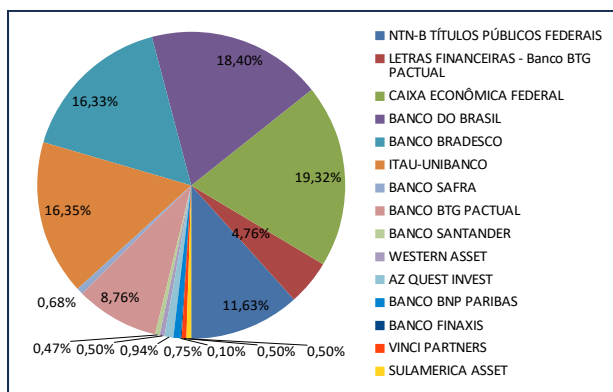
FUNDO	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	SALDO APLICADO	DISPONIBILIDADE PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 4963/2021	LIMITE LEGAL	% APLICADO	TX ADM	TAXA PERFORMANCE	NÍVEL DE RISCO (Incerteza)
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 11.046.645/0001-81 BB FI PREVID. DI TÍTULOS PÚBLICOS RF	CDI	PAS	20.183.340,57	29.288.502,23	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	11,33%	0,10%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 44.345.590/0001-60 BB FI PREVID. TP IPCA XXI	IPCA + 6%	PAS		20.985.392,15	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,81%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS	35.863.730,09	4.097.317,53	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	10,59%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.658/0001-93 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS		6.277.776,73	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	1,44%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.398.411/0001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	IPCA + 6%	VÉRTICE	32.735.520,27	5.414.796,86	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	8,74%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 03.398.411/0001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS		67.344.831,14	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	15,42%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAÚ-UNIBANCO 00.832.453/0001-40 ITAÚ INSTITUCIONAL FI RF REFR. DI	CDI	PAS		67.154.462,06	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	15,38%	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		30.323.155,10	2025	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	6,94%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2040 TFF	IPCA + 5,7520%	MARCAÇÃO NA CURVA		12.422.908,85	2040	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	2,84%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2045 TFF	IPCA + 5,8230%	MARCAÇÃO NA CURVA		8.051.743,88	2045	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	1,84%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.294/0001-45 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2025	IPCA + 6,1400%	MARCAÇÃO NA CURVA		10.434.237,74	2025	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	2,39%		N POSSUI	BAIXO
BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.294/0001-45 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2028	IPCA + 6,2900%	MARCAÇÃO NA CURVA		6.209.681,07	2028	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	1,42%		N POSSUI	MÉDIO
BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.294/0001-44 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2030	IPCA + 6,3900%	MARCAÇÃO NA CURVA		4.141.100,69	2030	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	0,95%		N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 37.927.707/0001-58 BTG PACTUAL TESOURO SELIC S DI INSTITUCIONAL FI RF	CDI	PASSIVO		30.971.486,17	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	7,09%	0,08%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 09.631.542/0001-37 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE		5.164.925,40	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,18%	0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.018.354/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO		448.829,19	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	5,00%	0,10%	0,25%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 10.418.335/0001-88 BB PREVID FIA GOV CORPORATIVA	GOVERNANÇA	PAS		2.210.449,35	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,51%	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		5.500.093,88	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,26%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.825/0001-50 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO		2.204.945,32	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,50%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 18.436.816/0001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO		2.955.707,46	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		2.170.921,84	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,50%	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		2.184.590,69	D+1	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%	0,50%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL AZ QUEST INVEST 11.392.185/0001-72 AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	SMALL CAPS	ATIVO		4.096.276,52	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,94%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAÚ-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAÚ FIC FIA SPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		4.264.768,09	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,98%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMERICA DTMV 11.458.144/0001-02 SULAMERICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.197.682,75	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,50%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.959/0001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO		3.268.533,24	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,75%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.660.879/0001-98 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.074.791,73	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,48%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.988.623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO		1.907.081,60	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,44%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO		2.053.087,93	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	0,44%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.794/0001-84 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.099.613,55	D+33	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,48%	3,00%	N POSSUI	ALTO
<b>TOTAL RENDA FIXA</b> .....			<b>397.513.737,72</b>				<b>100,00%</b>	<b>91,03%</b>			
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b> .....			<b>39.188.543,95</b>				<b>70,00%</b>	<b>8,97%</b>			
<b>TOTAL GERAL</b> .....			<b>436.702.281,67</b>								

LUIS GUSTAVO PERES MACEDO  
Economista /Corecon 32.356

DAVID JOSÉ FRANÇOIS  
Presidente - FUNPREV

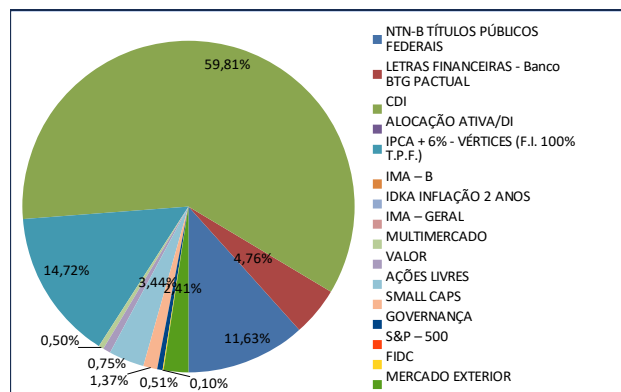
**RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE JANEIRO/2024**

**DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA**



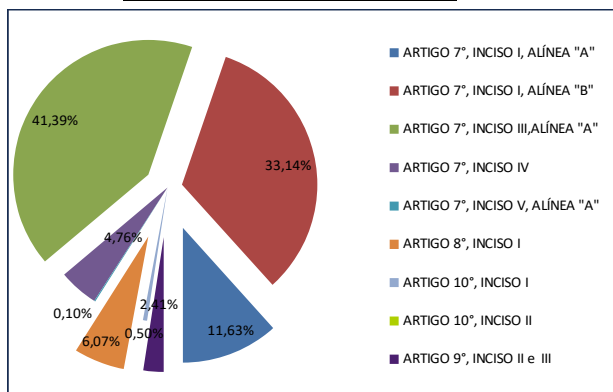
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
NTN-B TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	50.797.807,83	11,63%
LETRAS FINANCEIRAS - Banco BTG PACTUAL	20.785.019,50	4,76%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	84.389.141,48	19,32%
BANCO DO BRASIL	80.372.723,50	18,40%
BANCO BRADESCO	71.326.704,47	16,33%
ITAU-UNIBANCO	71.419.230,15	16,35%
BANCO SAFRA	2.955.707,46	0,68%
BANCO BTG PACTUAL	38.236.025,12	8,76%
BANCO SANTANDER	2.053.087,93	0,47%
WESTERN ASSET	2.184.590,69	0,50%
AZ QUEST INVEST	4.096.276,52	0,94%
BANCO BNP PARIBAS	3.268.533,24	0,75%
BANCO FINAXIS	448.829,19	0,10%
VINCI PARTNERS	2.170.921,84	0,50%
SULAMERICA ASSET	2.197.682,75	0,50%
TOTAL . . . . .	436.702.281,67	100,00%

**DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS**



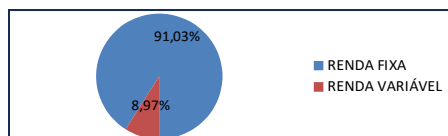
CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
NTN-B TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	50.797.807,83	11,63%
LETRAS FINANCEIRAS - Banco BTG PACTUAL	20.785.019,50	4,76%
CDI	261.181.446,52	59,81%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI		
IPCA + 6% - VÉRTICES (F.I. 100% T.P.F.)	64.300.634,68	14,72%
IMA - B		
IDKA INFLAÇÃO 2 ANOS		
IMA - GERAL		
MULTIMERCADO	2.184.590,69	0,50%
VALOR	3.268.533,24	0,75%
AÇÕES LIVRES	15.012.723,28	3,44%
SMALL CAPS	6.003.358,12	1,37%
GOVERNANÇA	2.210.449,35	0,51%
S&P - 500		
FIDC	448.829,19	0,10%
MERCADO EXTERIOR	10.508.889,27	2,41%
TOTAL . . . . .	436.702.281,67	100,00%

**DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL**



ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	50.797.807,83	11,63%
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	144.743.963,65	33,14%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	180.738.117,55	41,39%
ARTIGO 7º, INCISO IV	20.785.019,50	4,76%
ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	448.829,19	0,10%
ARTIGO 8º, INCISO I	26.495.063,99	6,07%
ARTIGO 10º, INCISO I	2.184.590,69	0,50%
ARTIGO 10º, INCISO II		
ARTIGO 9º, INCISO II e III	10.508.889,27	2,41%
TOTAL . . . . .	436.702.281,67	100,00%

**DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO**



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	397.513.737,72	91,03%
RENDA VARIÁVEL	39.188.543,95	8,97%
TOTAL . . . . .	436.702.281,67	100,00%

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	0,74%
META ATUARIAL NO MÊS	0,84%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	0,74%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	3,07%
META GERENCIAL ANO	0,22%
META ATUARIAL ANO	0,84%
ATINGIMENTO DA META GERENCIAL NO ANO	336,36%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	88,10%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)		MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 366.239.474,20	83,86%
MÉDIO	ATÉ 5 ANOS	R\$ 6.209.681,07	1,42%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 64.253.126,56	14,71%
TOTAL		R\$ 436.702.281,67	100,00%

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

**DAVID JOSÉ FRANÇOIS**  
Presidente – FUNPREV



**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**

**SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS**

**MÊS: JANEIRO/2024**

**FOLHAS 02/19 – PROCESSO 3665/2023**

**PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS**

**ATA Nº 05/2024**

**DATA: 22/02/2024**

	<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 janeiro de 2024 foi de 0,74%, 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](http://www.funprevbauru.sp.gov.br)



resultados nos segmentos de renda fixa, cujo retorno no mês de referência foi de 1,02% e no segmento de investimento no exterior com retorno de 3,56%, porém com pouca exposição devido seu perfil de risco. O segmento de renda variável “puxou” a rentabilidade da carteira para baixo com retorno de -3,96% no mês. Em participação, a renda fixa possui a maior concentração no total da carteira, uma vez que mais de 90% da carteira da Fundação está alocada nesse segmento. O resultado no ano ficou acima da meta gerencial, que mede a possibilidade de retorno dentro o perfil de risco da Fundação e que registrou no acumulado até janeiro um percentual de 0,22%, ante 0,74% da rentabilidade da carteira. Quanto a meta atuarial, esta encerrou o mês em 0,84%. Sendo assim, a Fundação obteve rentabilidade 88,11% em relação à meta atuarial em 2024 com data-base em 31/01/2024, contribuindo com o resultado atuarial. Em volume de recursos, a Fundação encerrou o mês de janeiro/24 com R\$ 436.702.281,67 aplicados em fundos de investimentos, títulos públicos federais e letras financeiras. Os rendimentos acumulados no ano somam R\$ 3.209.317,67.

**ALEXANDRE FRUCTUOSO DA COSTA – PRESIDENTE**

**DIOGO NUNES PEREIRA – SECRETÁRIO**

**ANTONIO CARLOS BATISTA MARTINEZ – MEMBRO**

**EDUARDO DE ALMEIDA – MEMBRO**

**LUCAS CHASSERAUX TAUIL – MEMBRO**



**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**

**SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS**  
**MÊS: JANEIRO/2024**

**ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR**  
**ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 05/2024 DATA: 05/03/2024**

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

Observações: Este conselho toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, às folhas nº 19/20 e aprova referido relatório de investimentos base Janeiro/2024, conforme item 05, da Ata da Reunião Ordinária nº 06/2024, de 29 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



**RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS**

**SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS**  
**MÊS: JANEIRO/2024**

**ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL**

**ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 05/2024**

**DATA: 06/03/2024**

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

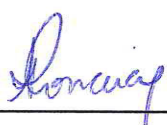
Observações: Este Conselho recebe os autos (Processo 3665/2023) e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, as fls 19/20, e aprova o referido relatório de investimento base JANEIRO/2024, conforme item 05 da Ata da Reunião Ordinária 06/2024 do Comitê de Investimento. (fl 21). Toma conhecimento também da aprovação do Conselho Curador, conforme fl 26.


  
Rafael Vicentin Ferrero Salla  
Presidente do Conselho Fiscal

  
Marta Alves de Castro Correa  
Secretária do Conselho Fiscal

  
Ricardo Alonso Senfuegos  
Membro do Conselho Fiscal

  
Lucilene Alves Guerra  
Membro do Conselho Fiscal

  
Ana Lígia Corrêa da Conceição  
Membro do Conselho Fiscal

  
Giane Fátima Silva Francisco  
Membro do Conselho Fiscal