

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

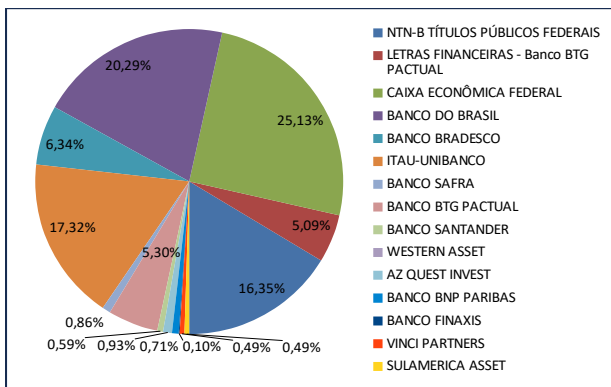
FUNDO	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	SALDO APLICADO	DISPONIBILIDADE PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 4963/2021	LIMITE LEGAL	% APLICADO	TX ADM	TAXA PERFORMANCE	NÍVEL DE RISCO (Incerteza)
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 11.046.6450001-81 BB FI PREVID. DI TÍTULOS PÚBLICOS RF	CDI	PAS	23.295.636,54	31.132.713,42	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	12,71%	0,10%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 44.345.5900001-60 BB FI PREVID. TP-IPCA XXI	IPCA + 6%	PAS		21.334.411,28	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	4,98%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.2060001-97 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS	59.386.436,91	2.933.244,04	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	16,08%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 10.740.6580001-93 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS		6.509.341,66	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	1,52%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 20.139.950001-78 CAIXA BRASIL FI 2024 IV TP	IPCA + 6%	VÉRTICE	33.279.405,57	5.504.761,16	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	9,06%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 03.389.4110001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS		23.469.858,35	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	5,48%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAU-UNIBANCO 00.832.4530001-00 ITAU INSTITUCIONAL FI RF REFR. DI	CDI	PAS		70.135.001,78	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	16,38%	0,18%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.2940001-45 NTN-B 2025 TPF	IPCA + 5,5680%	MARCAÇÃO NA CURVA		30.770.398,70	2025	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	7,19%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.2940001-44 NTN-B 2033 TPF	IPCA + 5,8372%	MARCAÇÃO NA CURVA		18.441.746,81	2033	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	4,31%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.2940001-45 NTN-B 2049 TPF	IPCA + 5,7520%	MARCAÇÃO NA CURVA		12.621.701,22	2040	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	2,95%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.2940001-45 NTN-B 2045 TPF	IPCA + 5,8230%	MARCAÇÃO NA CURVA		8.181.915,38	2045	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	1,91%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.2940001-45 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2025	IPCA + 6,1400%	MARCAÇÃO NA CURVA		10.933.176,33	2025	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	2,55%		N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.2940001-45 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2028	IPCA + 6,2900%	MARCAÇÃO NA CURVA		6.507.594,39	2028	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	1,52%		N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTODIA 30.306.2940001-44 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2030	IPCA + 6,3900%	MARCAÇÃO NA CURVA		4.341.424,74	2030	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	1,01%		N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 37.927.7070001-58 BTG PACTUAL TESOURO SELIC S DI INSTITUCIONAL FI RF	CDI	PASSIVO		15.469.070,68	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	3,61%	0,08%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 09.631.5420001-37 BTG PACTUAL 2024 TP FI RF	IPCA + 6%	VÉRTICE		5.246.450,10	2024	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	1,23%	0,15%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.018.3540001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO		449.118,31	AMORT. MENSAL	ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	5,00%	0,10%	0,25%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 10.418.3550001-88 BB PREVID FIA GOV CORPORATIVA	GOVERNANÇA	PAS		2.155.196,29	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I		0,50%	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		6.940.476,52	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	1,62%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.8050001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	IBOVESPA	ATIVO		2.031.323,60	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,47%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SAFRA 19.436.8180001-80 SAFRA CONS. AMERICANO FIA MERCADO EXTERIOR	MERC. EXTERNO	ATIVO		3.684.442,15	D+5	ARTIGO 9º, INCISO III	10,00%	0,86%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.5870001-11 VINCI MISCADO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.089.389,02	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,49%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL WESTERN ASSET 17.453.850001-48 WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	MULTIMERC.	PAS			D+1	ARTIGO 10º, INCISO I	10,00%		1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL AZ QUEST INVEST 11.392.1650001-72 AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	SMALL CAPS	ATIVO		3.990.056,74	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,93%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAU-UNIBANCO 08.817.4140001-10 ITAU FICFIA RPI IBOVESPA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		4.009.701,38	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,94%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMERICA D'VM 11.458.1440001-02 SULAMERICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO		2.108.191,14	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,49%	1,50%	20 exceder o índice%	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BNP PARIBAS 12.239.9390001-92 BNP PARIBAS ACTION FIC FIA	VALOR	ATIVO		3.061.120,15	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,71%	2,00%	20% exceder o índice	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 03.660.8790001-96 BRADESCO FIA SELECTION	AÇÕES LIVRES	ATIVO		1.878.699,29	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,44%	2,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.989.8230001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO		1.785.441,51	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,42%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.894.7920001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER M E	MERC. EXTERNO	ATIVO		2.523.285,17	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	0,42%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BTG PACTUAL 11.977.7940001-64 BTG PACTUAL ABSOLUTO INST FIC FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO		1.961.371,80	D+33	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,46%	3,00%	N POSSUI	ALTO
TOTAL RENDA FIXA			389.943.407,37				100,00%	91,07%			
TOTAL RENDA VARIÁVEL			38.218.694,76				70,00%	8,93%			
TOTAL GERAL			428.162.102,13								

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista / Corecon 32.358
Certificação RPPS: CGINV I

DAVID JOSÉ FRANÇOSO
Presidente
Certificações RPPS: CGINV I e DIRIG I

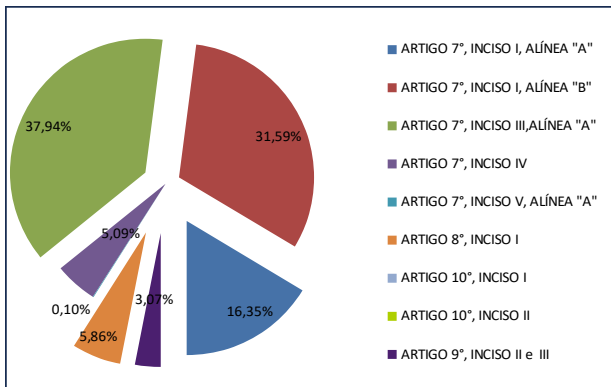
RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE JUNHO/2024

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



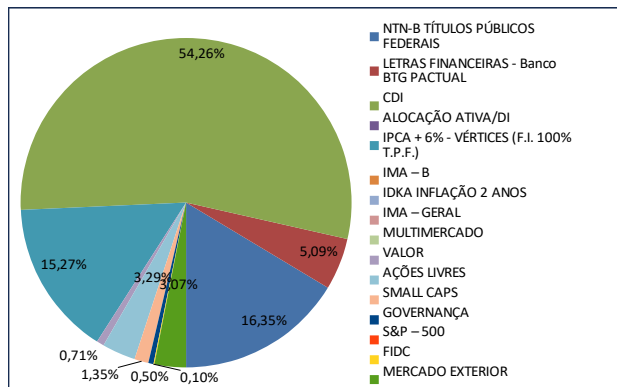
INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
NTN-B TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	70.015.762,11	16,35%
LETRAS FINANCEIRAS - Banco BTG PACTUAL	21.782.195,46	5,09%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	107.613.189,34	25,13%
BANCO DO BRASIL	86.889.757,65	20,29%
BANCO BRADESCO	27.133.999,15	6,34%
ITAU-UNIBANCO	74.144.703,16	17,32%
BANCO SAFRA	3.684.442,15	0,86%
BANCO BTG PACTUAL	22.676.892,58	5,30%
BANCO SANTANDER	2.523.285,17	0,59%
WESTERN ASSET		
AZ QUEST INVEST	3.990.056,74	0,93%
BANCO BNP PARIBAS	3.061.120,15	0,71%
BANCO FINAXIS	449.118,31	0,10%
VINCI PARTNERS	2.089.389,02	0,49%
SULAMERICA ASSET	2.108.191,14	0,49%
TOTAL	428.162.102,13	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL



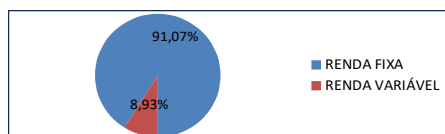
ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	70.015.762,11	16,35%
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	135.262.448,75	31,59%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	162.433.882,74	37,94%
ARTIGO 7º, INCISO IV	21.782.195,46	5,09%
ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	449.118,31	0,10%
ARTIGO 8º, INCISO I	25.070.490,92	5,86%
ARTIGO 10º, INCISO I		
ARTIGO 10º, INCISO II		
ARTIGO 9º, INCISO II e III	13.148.203,84	3,07%
TOTAL	428.162.102,13	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
NTN-B TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	70.015.762,11	16,35%
LETRAS FINANCEIRAS - Banco BTG PACTUAL	21.782.195,46	5,09%
CDI	232.331.303,38	54,26%
ALOCAÇÃO ATIVA/DI		
IPCA + 6% - VÉRTICES (F.I. 100% T.P.F.)	65.365.028,11	15,27%
IMA - B		
IDKA INFLAÇÃO 2 ANOS		
IMA - GERAL		
MULTIMERCADO		
VALOR	3.061.120,15	0,71%
ACÇÕES LIVRES	14.078.676,23	3,29%
SMALL CAPS	5.775.498,25	1,35%
GOVERNANÇA	2.155.196,29	0,50%
S&P - 500		
FIDC	449.118,31	0,10%
MERCADO EXTERIOR	13.148.203,84	3,07%
TOTAL	428.162.102,13	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	389.943.407,37	91,07%
RENDA VARIÁVEL	38.218.694,76	8,93%
TOTAL	428.162.102,13	100,00%

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	1,14%
META ATUARIAL NO MÊS	0,59%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	5,13%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	1,06%
META GERENCIAL ANO	2,59%
META ATUARIAL ANO	4,91%
ATINGIMENTO DA META GERENCIAL NO ANO	198,07%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	104,48%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)		MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 339.399.906,73	79,27%
	ATÉ 5 ANOS	R\$ 6.507.594,39	1,52%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 82.254.601,22	19,21%
	TOTAL	R\$ 428.162.102,18	100,00%

LUIZ GUSTAVO PERES MACEDO
Economista /Corecon 32.356
Certificação RPPS: CGINV I

DAVID JOSÉ FRANÇO
Presidente
Certificações RPPS: CGINV I e DIRIG I



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: NÚCLEO DE GERENCIAMENTO DE INVESTIMENTOS

MÊS: JUNHO/2024

FOLHAS 136/143 – PROCESSO 3665/2023

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

ATA Nº 24/2024

DATA: 25/07/2024

	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 junho de 2024 foi de 1,14%, influenciada positivamente 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



no segmento de renda fixa, cujo retorno no mês de referência foi de 0,87% e onde a Fundação possui maior exposição; seguida pelo segmento de investimento no exterior com retorno de 10,12% no mês analisado e por fim o segmento de renda variável (fundos de ações) com retorno de 1,12%, porém com pouca exposição devido seu perfil de risco. 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 acumulado no 1º semestre está acima da meta gerencial, que mede a possibilidade de retorno dentro o perfil de risco da Fundação e que registrou no acumulado até junho um percentual de 2,59%, ante 5,13% da rentabilidade da carteira. Quanto a meta atuarial, esta encerrou os seis primeiros meses de 2024 em 4,91%. Sendo assim, a Fundação obteve rentabilidade de 104,48% da meta atuarial no acumulado no ano, até 30/06/2024. Em volume de recursos, a Fundação encerrou o mês de junho com R\$ 428.162.102,13 aplicados em fundos de investimentos, títulos públicos federais e letras financeiras. Os rendimentos acumulados no ano somam R\$ 20.906.687,41 sendo que este saldo está em verificação pela consultoria.

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: JUNHO/2024

ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 14/2024 DATA: 06/08/2024

	SIM	NÃO
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 144 e aprova referido relatório de investimentos base Junho/2024, conforme item 04, da Ata da Reunião Ordinária nº 24/2024, de 25 de julho 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: JUNHO/2024

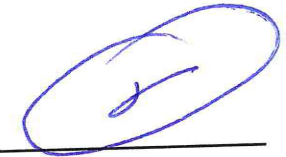
ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL
ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 15/2024 DATA: 07/08/2024


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

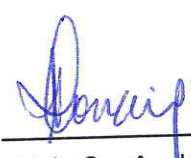
Observações: Este Conselho recebe os autos (Processo 3665/2023) e toma conhecimento da análise elaborada pelo Núcleo de Gerenciamento de Investimentos e da manifestação do Comitê de Investimentos, as fls 144, e aprova o referido relatório de investimento base JUNHO/2024, conforme item 04 da Ata da Reunião Ordinária 24/2024 do Comitê de Investimento. (fl 145). Toma conhecimento também da aprovação do Conselho Curador, conforme fl 150.



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