

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

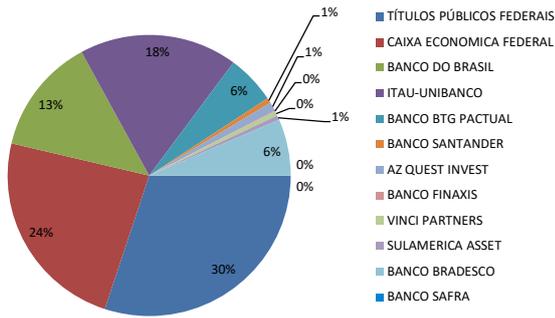
FUNDO	CATEGORIA	TIPO	SALDO APLICADO	DISPONIBILIDADE PARA RESGATE	ENQUADRAMENTO - RESOLUÇÕES CMN 4963/2021	LIMITE LEGAL	% APLICADO	TX ADM	TAXA PERFORMANCE	NÍVEL DE RISCO (Incerteza)
RENDA FIXA BANCO DO BRASIL 11.046.645/0001-81 BB FI PREVID. DI TÍTULOS PÚBLICOS RF	CDI	PAS	42.323.137,12	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	10,04%	0,10%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA CAIXA EC. FEDERAL 03.737.206/0001-97 CAIXA BRASIL FI REF DI LP	CDI	PAS	99.425.756,38	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	23,58%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO BRADESCO 03.399.411/0001-90 BRADESCO FI REF DI PREMIUM	CDI	PAS	25.581.324,71	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	6,07%	0,20%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA ITAU-UNIBANCO 00.832.435/0001-00 ITAU INSTITUCIONAL FI RF REFR. DI	CDI	PAS	72.041.407,94	D+0	ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	60,00%	17,08%	0,18%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2025 TPF	TÍTULO PÚBLICO FEDERAL	MARCAÇÃO NA CURVA	31.419.331,70	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	7,45%	0,00%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-44 NTN-B 2027 TPF	TÍTULO PÚBLICO FEDERAL	MARCAÇÃO NA CURVA	10.688.346,59	2027	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	2,53%	0,00%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-43 NTN-B 2030 TPF	TÍTULO PÚBLICO FEDERAL	MARCAÇÃO NA CURVA	5.925.717,57	2030	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	1,41%	0,00%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-44 NTN-B 2033 TPF	TÍTULO PÚBLICO FEDERAL	MARCAÇÃO NA CURVA	18.841.264,99	2033	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	4,47%	0,00%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2035 TPF	TÍTULO PÚBLICO FEDERAL	MARCAÇÃO NA CURVA	8.599.445,18	2035	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	2,04%	0,00%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2040 TPF	TÍTULO PÚBLICO FEDERAL	MARCAÇÃO NA CURVA	12.532.182,31	2040	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	2,97%	0,00%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-44 NTN-B 2045 TPF	TÍTULO PÚBLICO FEDERAL	MARCAÇÃO NA CURVA	30.529.874,03	2045	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	7,24%	0,00%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 NTN-B 2045 TPF	TÍTULO PÚBLICO FEDERAL	MARCAÇÃO NA CURVA	8.358.872,94	2045	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	100,00%	1,98%	0,00%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2025	LETRA FINANCEIRA	MARCAÇÃO NA CURVA	11.190.435,59	2025	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	2,65%	0,00%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-45 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2028	LETRA FINANCEIRA	MARCAÇÃO NA CURVA	6.650.720,19	2028	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	1,58%	0,00%	N POSSUI	MÉDIO
RENDA FIXA BTG PACTUAL CUSTÓDIA 30.306.294/0001-44 LETRA FINANCEIRA BTG PACTUAL 2030	LETRA FINANCEIRA	MARCAÇÃO NA CURVA	4.438.001,45	2030	ARTIGO 7º, INCISO IV	20,00%	1,05%	0,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA FIXA BANCO BTG PACTUAL 37.927.707/0001-58 BTG PACTUAL TESOURO SELIC DI INST FI RF	CDI	PAS	1.233.313,14	D+0	ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	100,00%	0,29%	0,08%	N POSSUI	BAIXO
RENDA FIXA BANCO PETRA 06.018.364/0001-85 FIDC PREMIUM	FIDC	EM LIQUIDAÇÃO	443.355,64	NA LIQUIDAÇÃO	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	IGC	PAS	2.279.895,20	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,54%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 17.413.636/0001-68 BB GLOBAL SELECT EQUIT EXTERIOR FIM	MERC. EXTERNO	ATIVO	9.730.589,68	D+5	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	2,31%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO DO BRASIL 09.005.805/0001-00 BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	AÇÕES LIVRES	ATIVO	2.176.126,82	D+3	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,52%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL VINCI PARTNERS 28.470.587/0001-11 VINCI MOSAICO FIA	AÇÕES LIVRES	ATIVO	2.200.026,76	D+32	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,52%	2,00%	20% do que exceder o benchmark	ALTO
RENDA VARIÁVEL AZ QUEST INVEST 11.392.165/0001-72 AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC FIA	SMALL CAPS	ATIVO	4.283.639,96	D+30	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,02%	2,00%	20% do que exceder o benchmark	ALTO
RENDA VARIÁVEL ITAU-UNIBANCO 08.817.414/0001-10 ITAU FICFIA RPI IBOVESPA	IBOVESPA	ATIVO	4.216.719,28	D+5	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	1,00%	1,00%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL SULAMÉRICA DTVM 11.458.144/0001-02 SULAMÉRICA FIA EQUITIES	AÇÕES LIVRES	ATIVO	2.230.922,92	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,53%	1,50%	20% do que exceder o benchmark	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO BRADESCO 06.988.623/0001-09 BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	SMALL CAPS	ATIVO	1.745.877,47	D+4	ARTIGO 8º, INCISO I	30,00%	0,41%	1,50%	N POSSUI	ALTO
RENDA VARIÁVEL BANCO SANTANDER 17.804.792/0001-50 SANTANDER GLOBAL EQUITIES EXT	MERC. EXTERNO	ATIVO	2.594.971,96	D+8	ARTIGO 9º, INCISO II	10,00%	0,62%	1,00%	N POSSUI	ALTO
TOTAL RENDA FIXA						100,00%	92,54%			
TOTAL RENDA VARIÁVEL						40,00%	7,46%			
TOTAL GERAL										
390.222.487,47										
31.458.770,05										
421.681.257,52										

DIOGO NUNES PEREIRA
Economista /Corecon 33.492

DAVID JOSÉ FRANCO
Presidente – FUNPREV

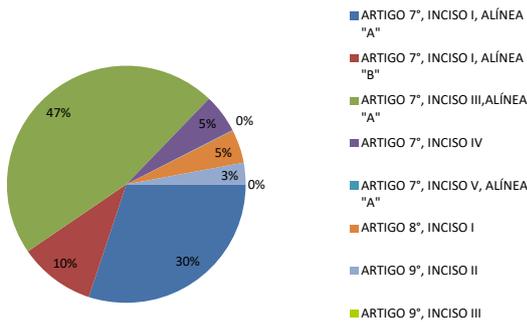
RESUMO DAS APLICAÇÕES FINANCEIRAS COM BASE NO FECHAMENTO DO MÊS DE SETEMBRO/2024

DIVERSIFICAÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



INSTITUIÇÃO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	126.895.035,31	30,09%
CAIXA ECONOMICA FEDERAL	99.425.756,38	23,58%
BANCO DO BRASIL	56.509.748,82	13,40%
ITAU-UNIBANCO	76.258.127,22	18,08%
BANCO BTG PACTUAL	23.512.470,37	5,58%
BANCO SANTANDER	2.594.971,96	0,62%
AZ QUEST INVEST	4.283.639,96	1,02%
BANCO FINAXIS	443.355,64	0,11%
VINCI PARTNERS	2.200.026,76	0,52%
SULAMERICA ASSET	2.230.922,92	0,53%
BANCO BRADESCO	27.327.202,18	6,48%
BANCO SAFRA	-	0,00%
BANCO BNP PARIBAS	-	0,00%
TOTAL	421.681.257,52	100,00%

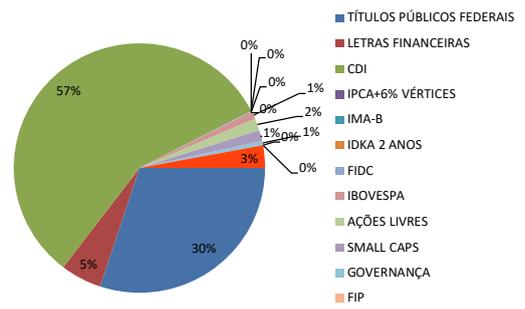
DIVERSIFICAÇÃO POR ENQUADRAMENTO LEGAL



ENQUADRAMENTO LEGAL	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "A"	126.895.035,31	30,09%
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	43.556.450,26	10,33%
ARTIGO 7º, INCISO III, ALÍNEA "A"	197.048.489,03	46,73%
ARTIGO 7º, INCISO IV	22.279.157,23	5,28%
ARTIGO 7º, INCISO V, ALÍNEA "A"	443.355,64	0,11%
ARTIGO 8º, INCISO I	19.133.208,41	4,54%
ARTIGO 9º, INCISO II	12.325.561,64	2,92%
ARTIGO 9º, INCISO III	-	0,00%
TOTAL	421.681.257,52	100,00%

DIOGO NUNES PEREIRA
Economista /Corecon 33.492

DIVERSIFICAÇÃO POR ÍNDICES FINANCEIROS



CATEGORIA	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	126.895.035,31	30,09%
LETRAS FINANCEIRAS	22.279.157,23	5,28%
CDI	240.604.939,29	57,06%
IPCA+6% VÉRTICES	-	0,00%
IMA-B	-	0,00%
IDKA 2 ANOS	-	0,00%
FIDC	443.355,64	0,11%
IBOVESPA	4.216.719,28	1,00%
AÇÕES LIVRES	6.607.076,50	1,57%
SMALL CAPS	6.029.517,43	1,43%
GOVERNANÇA	2.279.895,20	0,54%
FIP	-	0,00%
MULTIMERCADOS	-	0,00%
MERCADO EXTERIOR	12.325.561,64	2,92%
TOTAL	421.681.257,52	100,00%

DIVERSIFICAÇÃO POR SEGMENTO



SEGMENTO	SALDO APLICADO	% DA CARTEIRA
RENDA FIXA	390.222.487,47	92,54%
RENDA VARIÁVEL	31.458.770,05	7,46%
TOTAL	421.681.257,52	100,00%

RESULTADO PARCIAL ACUMULADO NO ANO ATÉ O MÊS CORRENTE	% DA CARTEIRA
RENTABILIDADE NO MÊS	0,52%
META ATUARIAL NO MÊS	0,84%
SOMENTE RENDIMENTOS NO ANO	8,04%
EVOLUÇÃO DO PATRIMÔNIO NO ANO	-0,47%
META GERENCIAL ANO	5,17%
META ATUARIAL ANO	7,10%
ATINGIMENTO DA META ATUARIAL NO ANO	113,24%

PRAZO DE LIQUIDAÇÃO E RISCO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS			
(NÍVEL DE INCERTEZA)		MONTANTE APLICADO	PERCENTUAL
BAIXO	ATÉ 1 ANO	R\$ 378.690.410,19	89,80%
	ATÉ 5 ANOS	R\$ 6.650.720,19	1,58%
ALTO	ACIMA DE 5 ANOS	R\$ 36.340.127,14	8,62%
	TOTAL	R\$ 421.681.257,52	100,00%

DAVID JOSÉ FRANÇO
Presidente – FUNPREV



RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS
SETOR RESPONSÁVEL PELA ELABORAÇÃO: DIVISÃO FINANCEIRA
MÊS: SETEMBRO/2024
FOLHAS 183/186 – PROCESSO 3665/2023

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS
ATA Nº 34/2024 **DATA: 17/10/2024**

	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 com ressalvas ao percentual aplicado no fundo de investimento Caixa Brasil Referenciados DI Longo Prazo, ao limite inferior



**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 artigo 7º, I, b e ao limite superior no artigo 7º, I, a que já estão em fase de regularização, tendo em vista que o Comitê já fez as recomendações necessárias e o Conselho Curador irá deliberar na próxima reunião. O Comitê observa que a rentabilidade da carteira no mês de setembro de 2024 foi de 0,52%, influenciada positivamente pelo resultado no segmento de renda fixa, cujo retorno no mês de referência foi de 0,78% e onde a Fundação possui maior exposição. O segmento de renda variável (fundos de ações) e o segmento de investimento no exterior puxaram a rentabilidade da carteira no mês para baixo com retornos de -3,03% e -1,96% respectivamente, 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 até 30/09/2024 está acima da meta gerencial, que mede a possibilidade de retorno dentro o perfil de risco da Fundação e que registrou no acumulado até setembro um percentual de 5,17%, ante 8,04% da rentabilidade da carteira. Quanto a meta atuarial, esta encerrou os nove primeiros meses de 2024 em 7,10%. Sendo assim, a Fundação obteve rentabilidade de 113,24% da meta atuarial no acumulado no ano, até 30/09/2024. Em volume de recursos, a Fundação encerrou o mês de setembro com R\$ 421.681.257,52 aplicados em fundos de investimentos, títulos públicos federais e letras financeiras. Os rendimentos acumulados no ano somam R\$ 33.453.208,26.

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: SETEMBRO/2024

ANÁLISE DO CONSELHO CURADOR

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 20/2024 DATA: 22/10/2024

	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, à folha nº 189 e aprova referido relatório de investimentos base Setembro/2024, conforme item 6, da Ata da Reunião Ordinária nº 34/2024, de 17 de outubro 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: AGOSTO/2024

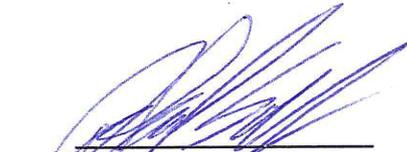
ANÁLISE DO CONSELHO FISCAL

ATA REUNIÃO ORDINÁRIA Nº 20/2024

DATA: 23/10/2024

	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 189, e aprova o referido relatório de investimento base SETEMBRO/2024, conforme item 06 da Ata da Reunião Ordinária 34/2024 do Comitê de Investimento. (fls 190). Toma conhecimento também da aprovação do Conselho Curador, conforme fl. 195



Rafael Vicentin Ferrero Salla
Presidente do Conselho Fiscal



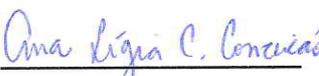
Marta Alves de Castro Correa
Secretária do Conselho Fiscal



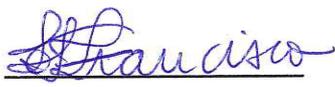
Ricardo Alonso Senfuegos
Membro do Conselho Fiscal



Augusto Mendes
Membro do Conselho Fiscal



Ana Lúcia Corrêa da Conceição
Membro do Conselho Fiscal



Giane Fátima Silva Francisco
Membro do Conselho Fiscal