

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: **Relatório de Investimentos – Setembro/2018**

Data: 10/10/2018

RELATÓRIO N°. 029/2018 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **setembro/2018**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 05);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e performance dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos e Recursos Consolidados do FPREV (páginas 06 a 16);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV/ALEAM (páginas 16 a 17);
- 4) Recursos do Ministério Público - FPREV - (páginas 18)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (páginas 18 a 19);
- 6) Recursos do FFIN Executivo – (página 19 a 20);
- 7) Recursos da Taxa de Administração - (página 20);
- 7) Recursos dos Outros Poderes: Saldo e Composição – TCE e TJA (página 20 a 21);
- 8) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 22 a 25);
- 9) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 26 a 28).

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

No Brasil, o Banco Central manteve a taxa de juros em 6,5% a.a. No cenário global, os EUA aumentaram novamente as tarifas sobre as importações de produtos chineses.

No Brasil, o COPOM manteve a taxa de juros em 6,5% a.a., conforme o esperado. A decisão unânime contou com a avaliação de que a atividade segue em ritmo de recuperação gradual, enquanto a inflação corrente se encontra em nível apropriado e as expectativas inflacionárias permanecem ancoradas. A respeito do cenário global, foi mantida a visão de que o ambiente é desafiador, tendo como principais riscos a normalização das taxas de juros em economias avançadas e a tensão envolvendo o comércio internacional. Diante desse quadro, o COPOM segue com a avaliação de que manter a taxa de juros reflete o balanço de riscos prospectivo para a inflação, compatível com o processo de convergência da inflação para a meta. Ademais, o Banco Central reiterou que as condições econômicas prescrevem política monetária estimulativa. Sobre os próximos passos, o Banco Central revela sua dependência da evolução da atividade econômica, do balanço de riscos e das projeções e expectativas de inflação. A deterioração adicional do cenário de inflação e/ou o balanço de riscos implicaria redução gradual do estímulo monetário. Espera-se que a Selic seja mantida em 6,5% a.a. até o final desse ano, mas é possível que uma piora adicional do balanço de riscos, que comprometa a ancoragem das expectativas, pode antecipar um movimento de alta gradual dos juros.

Os dados econômicos confirmam a posição do COPOM quanto à recuperação gradual da economia e cenário de inflação acomodada. Em termos de atividade, o indicador mensal de atividade do Banco Central (IBC-Br) avançou 0,57% na margem, acima da nossa projeção (0,4%) e da projeção do mercado (0,2%). Comparado ao mesmo período em 2017, o crescimento foi de 2,6%, ante expansão de 1,9% em junho. Esse crescimento ocorreu a despeito da piora das pesquisas setoriais, realizadas pelo IBGE, que indicavam uma atividade mais fraca em julho, ainda como reflexo das distorções geradas pela paralisação no setor de transporte de cargas. Pode-se concluir que a recuperação em curso na economia se mantém lenta e errática. Diante desse cenário, mantem-se a projeção de crescimento em 0,4% nesse trimestre, e expansão de 1,2% no ano. A respeito da inflação, o IPCA-15 de setembro apresentou alta de 0,09%, abaixo da nossa expectativa (0,19%) e do mercado (0,18%). A média dos núcleos de inflação (exclui componentes voláteis), por sua vez, teve variação de 0,22%, ante projeção de 0,30%. Em termos

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

anuais, o IPCA-15 desacelerou de 4,5% para 4,2% entre agosto e setembro. Para esse ano projeta-se inflação de 4,3%, abaixo da meta de 4,5%.

No cenário global, a tensão comercial entre China e EUA ganhou novos contornos diante de uma segunda rodada de aumento de tarifas pelos EUA. O presidente Donald Trump anunciou uma tarifa extra de 10% sobre US\$ 200 bilhões em importações chinesas até o final desse ano. A partir de janeiro de 2019, essa tarifa será elevada para 25%. De modo geral, até momento, metade do total de US\$ 500 bilhões em produtos chineses importados pelos EUA tiveram suas tarifas aumentadas. O Primeiro-ministro da China, Li Keqiang, afirmou que a desvalorização cambial não será utilizada como instrumento de retaliação, em virtude de seus impactos negativos indiretos sobre a atividade. Por outro lado, as medidas de estímulo fiscal e monetário implementadas nos últimos meses deverão mitigar parte do efeito negativo sobre o PIB chinês no curto prazo. Para 2018, mantém-se a projeção de crescimento em 6,5%. O risco para a economia global reside na possibilidade de uma terceira rodada de tarifas, a qual teria um impacto potencial de reduzir o crescimento chinês em 1,5 p.p. até o final de 2019. Em resumo, a tensão comercial coloca um viés de baixa para a economia global no médio prazo, em especial na China e emergentes.

Nos EUA, o Banco Central (FED) elevou novamente a taxa de juros, sinalizando a continuidade do ciclo de aperto monetário. O comitê de política monetária (FOMC) elevou a taxa de juros em 25 pontos base, para o intervalo de 2,0% a 2,25% ao ano, em linha com a expectativa do mercado. A principal novidade no comunicado ficou por conta da exclusão do trecho que qualificava a condição atual da política monetária como ‘acomodatícia’. Em termos de projeções, as medianas para a taxa de juros foram mantidas para 2018, 2019 e 2020. Nesse caso, o FED trabalha com um cenário de uma alta adicional nesse ano, três altas em 2019 e mais uma alta em 2020. Pela primeira vez a divulgação da projeção de juros para 2021, a qual prevê manutenção dos juros no patamar de 3,38%. No balanço das projeções de crescimento (PIB) e inflação ao consumidor (PCE), o PIB de 2018 foi elevado de 2,8% para 3,1%, enquanto a projeção do PCE de 2019 cedeu de 2,1% para 2%. Diante do aperto do mercado de trabalho e das medidas recentes de estímulo fiscal, acredita-se que o cenário de inflação é condizente com a continuidade do aperto monetário pelo FED, com mais uma alta de juros em dezembro, e quatro altas adicionais em 2019.

Na Zona do Euro, o Banco Central (BCE) manteve a política monetária, enquanto o orçamento italiano aumentou o nível de incerteza dos agentes. Conforme o esperado, o BCE manteve a taxa principal de juros em zero e a taxa de depósito negativa em 0,4% a.a. Já a taxa de empréstimos

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

segue em 0,25% a.a. Nessa mesma linha, o programa de compra de títulos foi mantido em 15 bilhões de euros até dezembro. Em seu discurso, o presidente do BCE, Mário Draghi, fez questão de ressaltar que segue confiante com o cenário de crescimento na região, com riscos balanceados, embora reconheça o aumento da preocupação com a escalada da tensão comercial. Sem pressão inflacionária aparente nos próximos meses, e o aumento da incerteza em relação ao crescimento da região, o cenário mais provável é que Draghi deixe o comando do BCE em outubro de 2018 sem elevar os juros. O orçamento fiscal italiano para 2019, por sua vez, frustrou a expectativa do mercado. Para os próximos três anos, o governo italiano anunciou um déficit de 2,4% do PIB. O orçamento do governo anterior, em linha com a plano de redução da dívida italiana pela União Europeia (EU), compreendia um déficit de 0,8% do PIB em 2019. A expectativa do mercado era um déficit de no máximo 2% do PIB, o que em possibilitaria ao menos a estabilização da dívida. Com isso, a UE deverá rejeitar o orçamento italiano, após o seu recebimento em meados de outubro. Acredita-se que as partes chegarão a um acordo após a escalada das negociações até o final do ano e o provável rebaixamento da nota de crédito italiana pelas agências de rating nas próximas semanas. Fonte: SÍNTESE ECONÔMICA DE SETEMBRO – BRAM.

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV

2.1 SALDOS E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS – FPREV – EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO %					
	31/08/2018	28/09/2018	jul/18	ago/18	set/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 344.735.849,45	R\$ 377.915.828,67	0,5299	0,5513	0,4630	1,5521%	4,7377%	6,7900%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 218.692.492,60	R\$ 218.893.729,08	0,5276	0,5492	0,4553	1,5400%	4,6530%	6,6600%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 70.282.380,53	R\$ 56.412.104,81	1,5048	(0,3397)	0,8576	2,0276%	1,2635%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 46.451.440,43	R\$ 48.722.910,16	0,6835	0,4065	0,5882	1,6874%	1,8095%	NC
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ -	R\$ -	1,3400	0,4639	-	1,8101%	7,1440%	10,1600%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 41.923.130,90	R\$ 42.433.702,09	1,1000	0,1551	1,2179	2,4900%	6,0561%	7,6800%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 43.725.684,56	R\$ 43.606.382,29	2,2200	(0,6309)	(0,2728)	1,2980%	3,2701%	2,9600%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 219.643.124,57	R\$ 221.084.637,66	0,9483	0,1400	0,6563	1,7531%	2,6181%	NC
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 604.559.680,46	R\$ 609.739.432,23	1,4619	(0,2703)	0,8568	2,0546%	5,5866%	NC
SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	R\$ 76.387.652,83	R\$ 76.743.064,96	0,5335	0,5320	0,4653	1,5386%	4,7855%	NC
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 153.040.189,50	R\$ 154.366.672,24	1,4557	(0,2753)	0,8668	2,0534%	2,9111%	NC
BB PREVID RF IRF MI	R\$ 469.141.034,01	R\$ 471.909.729,56	0,6756	0,3953	0,5902	1,6701%	4,6589%	6,5088%
BB PREVID TP VII	R\$ 18.058.086,14	R\$ 18.255.102,77	1,0126	(0,0490)	1,0910	2,0646%	5,7248%	7,2803%
BB PREVID TP IX	R\$ 8.785.982,88	R\$ 8.825.593,84	0,5039	0,6054	0,4508	1,5682%	5,8858%	7,5515%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 451.450.035,92	R\$ 474.098.327,73	1,2336	(0,0768)	1,1712	2,3406%	3,3688%	NC
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	R\$ 10.178.529,23	R\$ 10.225.135,57	0,5286	0,5586	0,4579	1,5530%	4,6929%	6,5200%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 206.311.470,47	R\$ 207.172.300,65	0,5700	0,3725	0,4172	1,3658%	4,8550%	6,3200%
TOTAL	R\$ 2.983.366.764,48	R\$ 3.040.404.654,31						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO %					
	31/08/2018	28/09/2018	jul/18	ago/18	set/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.162.812,79	R\$ 5.210.438,54	1,1293	(0,4224)	0,9225	1,6311%	4,2088%	NC
CAIXA FI JUROS E MOEDAS	R\$ 15.243.188,09	R\$ 15.326.196,40	0,5635	0,4176	0,5446	1,5334%	2,1767%	NC
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 5.232.167,63	R\$ 3.216.343,87	6,7205	(5,6082)	0,0207	0,7563%	-11,1121%	NC
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 27.393.608,59	R\$ 28.482.481,30	10,4528	(5,7190)	3,9749	8,2753%	-2,0474%	NC
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 15.499.343,89	R\$ 15.776.642,99	7,1000	(4,2300)	1,7891	4,4047%	-9,6376%	NC
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.022.743,42	R\$ 1.996.809,32	-	(0,7158)	(1,2821)	-1,9887%	-1,9887%	NC
SAFRA S&P REAIS	R\$ 5.131.719,81	R\$ 5.156.091,54	-	1,8739	0,4749	2,3577%	2,3577%	NC
SAFRA PREMIUM MULTMERCADO	R\$ 5.037.485,99	R\$ 5.068.386,72	-	0,0032	0,6134	0,6166%	0,6166%	NC
TOTAL	R\$ 80.723.070,21	R\$ 80.233.390,68						
TOTAL GERAL	R\$ 3.064.089.834,69	R\$ 3.120.638.044,99						

Quadro 1

Nota 1: Os percentuais de rentabilidade registrados no quadro acima são obtidos pela variação do valor das cotas de cada fundo de investimento. Essas variações não consideram as movimentações financeiras no período.

Nota 2: Em virtude de possibilidade de desenquadramento ao art. 14º da Resolução CMN nº. 3.922/2010, foi reduzido o montante aplicado nos fundos Bradesco IMA B5 e Caixa FIA Consumo. Operação registrada na ATA nº 143 COMIV e aprovado pelo CODIR em 26/09/2018. Os valores resgatados migraram para os fundos Bradesco DI Premium e Caixa FI IRF M1.

2.2 EVOLUÇÃO DOS SALDOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	jul/18	ago/18	set/18
BRADESCO	R\$ 633.710.722,58	R\$ 633.710.722,58	R\$ 653.221.662,56
CAIXA	R\$ 981.941.229,43	R\$ 981.941.229,43	R\$ 989.340.043,24
BANCO DO BRASIL	R\$ 947.435.138,95	R\$ 947.435.138,95	R\$ 973.088.753,90
ITAÚ	R\$ 231.989.343,59	R\$ 234.012.087,01	R\$ 235.170.888,53
SANTANDER	R\$ 256.821.450,92	R\$ 256.821.450,92	R\$ 259.592.218,50
SAFRA	R\$ -	R\$ 10.169.205,80	R\$ 10.224.478,26
TOTAL	R\$ 3.051.897.885,47	R\$ 3.064.089.834,69	R\$ 3.120.638.044,99

Quadro 2

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

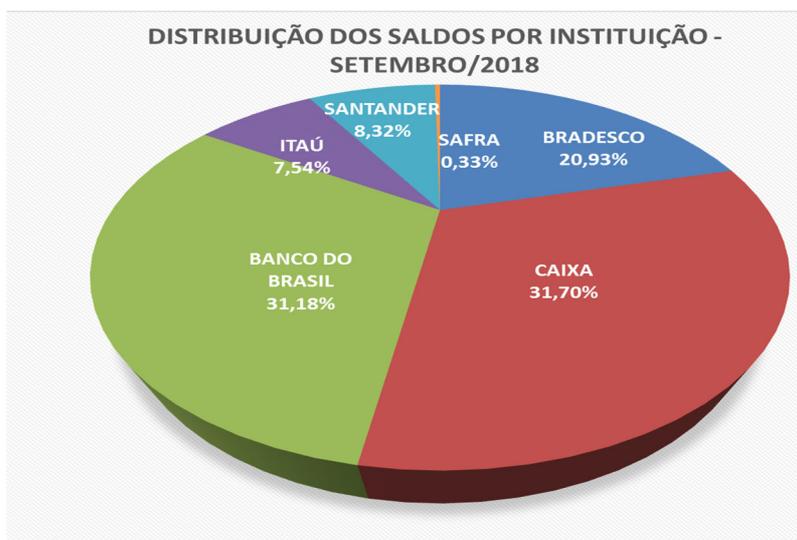


Gráfico 1

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	CDI	R\$ 683.777.758,28	21,91%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIM LP SAFRA CART PREMIUM MM	CDI ATIVO	R\$ 448.651.521,43	14,38%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF BB PREVID RF IRF M1	IRF M 1	R\$ 520.632.639,72	16,68%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF BB PREVID IDKA 2 TP RF	IMA B 5	R\$ 820.518.209,28	26,29%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BB PREVID TP VII BB PREVID TP IX	IPCA + 6%	R\$ 113.120.780,99	3,62%
SAFRA S&P REAIS	S&P 500	R\$ 5.156.091,54	0,17%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	IBOVESPA	R\$ 54.682.716,02	1,75%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 3.120.638.044,99	100%

Quadro 3

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

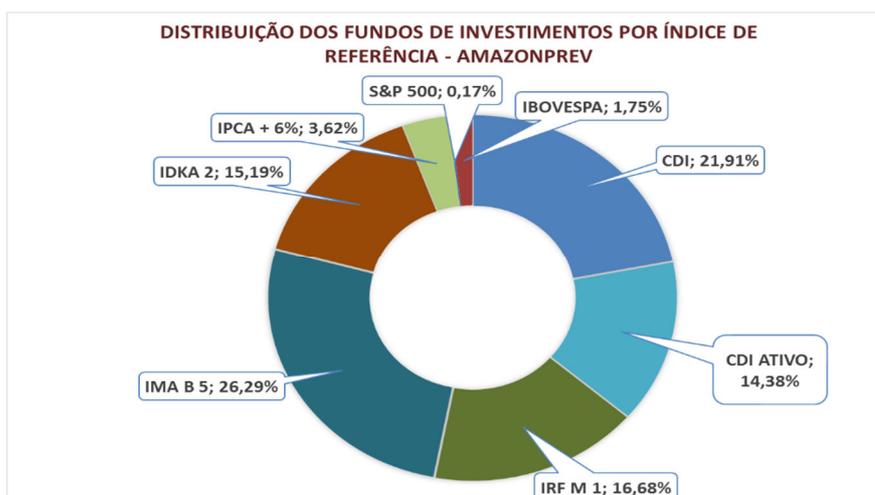


Gráfico 2

2.4 COMPARATIVO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA =

ÍNDICE	set/18	ACUMULADO 2018	12 MESES
CDI	0,4700%	4,8100%	6,6600%
IMA-B 5	0,8855%	4,9807%	6,5333%
IMA-B	-0,1494%	2,8821%	2,5735%
IMA B 5+	-1,0342%	0,8259%	-0,7832%
IRF M 1	0,6057%	4,8457%	6,7896%
IDKA 2	1,3591%	6,1422%	8,4924%
S&P 500	0,4300%	8,9900%	15,6600%
IBOVESPA	3,4800%	3,8500%	6,8000%

Quadro 4

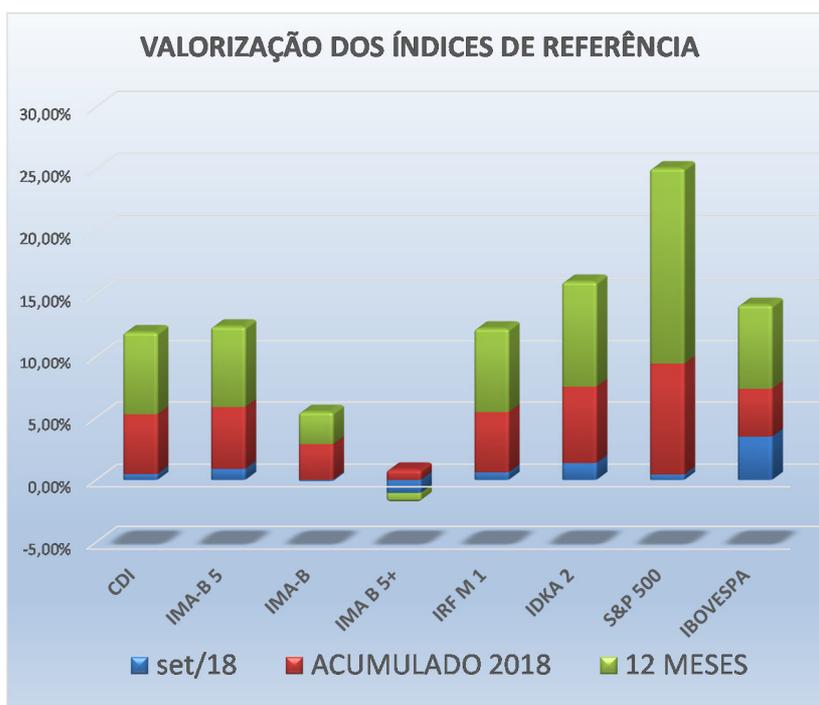


Gráfico 3.

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2018	28/09/2018	jul/18	ago/18	set/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 144.710.132,58	R\$ 146.167.528,84	4,7417	0,4341%	1,0071%	4,7568%	9,0523%	9,8078%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 146.048.566,71	R\$ 147.533.266,50	6,5622	0,4435%	1,0166%	6,5778%	6,5950%	6,2071%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 148.510.051,66	R\$ 150.054.935,44	6,7386	0,4671%	1,0403%	6,7546%	6,7719%	6,3833%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 151.186.093,13	R\$ 152.723.043,84	7,7778	0,4436%	1,0166%	7,7936%	6,7799%	5,7003%
TOTAL GERAL	R\$ 590.454.844,09	R\$ 596.478.774,62						

Quadro 5.

Nota 1: Conforme Deliberação do CODIR de 13/07/2018, com base no Parecer COMIV nº. 2027/2018 de 28/06/2018, foi aprovada a alteração na metodologia de contabilização dos Títulos Públicos que serão mantidos na Carteira até o vencimento, de forma que esses ativos serão registrados pelo valor de custo de aquisição acrescidos dos rendimentos do período. Fica o registro de que a NTN – B remuneram IPCA + Tx de juros contratada no ato da aquisição do ativo (ver quadro 6).

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS – TPF

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
PREÇO UNITÁRIO ATUAL	R\$ 3.391,357978	R\$ 3.395,472186	R\$ 3.401,603505	R\$ 3.443,586107
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45
VALOR ATUAL	R\$ 146.167.528,84	R\$ 147.533.266,50	R\$ 150.054.935,44	R\$ 152.723.043,84
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 6

2.7 SALDOS CVS - FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/08/2018	28/09/2018
CVS - A	R\$ 1.746.145,74	R\$ 1.728.692,42
CVS - B	R\$ 11.299.380,90	R\$ 11.186.403,10
CVS - C	R\$ 226.513,56	R\$ 224.249,48
CVS - D	R\$ 1.239.127,56	R\$ 1.226.738,04
TOTAL	R\$ 14.511.167,76	R\$ 14.366.083,04

Quadro 7

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/18	R\$ 45.365,76	R\$ 144.957,83	R\$ 190.323,59
fev/18	R\$ 44.946,11	R\$ 145.084,72	R\$ 190.030,83
mar/18	R\$ 44.526,14	R\$ 145.084,72	R\$ 189.610,86
abr/18	R\$ 44.106,16	R\$ 145.084,72	R\$ 189.190,88
mai/18	R\$ 43.686,19	R\$ 145.084,72	R\$ 188.770,91
jun/18	R\$ 43.266,22	R\$ 145.084,72	R\$ 188.350,94
jul/18	R\$ 42.846,25	R\$ 145.084,72	R\$ 187.930,97
ago/18	R\$ 42.426,28	R\$ 145.084,72	R\$ 187.511,00
set/18	R\$ 42.006,30	R\$ 145.084,72	R\$ 187.091,02
TOTAL	R\$ 393.175,41	R\$ 1.305.635,59	R\$ 1.698.811,00

Quadro 8

2.9 CONTROLE DE RECEBIMENTO DE ALUGUEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2018			TOTAL
MÊS	UEA	SEAS	
jan/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/18	R\$ -	R\$ 394.023,20	R\$ 394.023,20
mar/18	R\$ 53.422,83	R\$ 267.638,40	R\$ 321.061,23
abr/18	R\$ 106.845,66	R\$ -	R\$ 106.845,66
mai/18	R\$ -	R\$ 40.145,76	R\$ 40.145,76
jun/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
jul/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
ago/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
set/18	R\$ -	R\$ 669.096,00	R\$ 669.096,00
TOTAL	R\$ 160.268,49	R\$ 1.370.903,36	R\$ 1.531.171,85

Quadro 9

2.10 CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL DA UEA - 2017/2018

Referência: 6º Aditivo ao TC 017/11 (abril a set/16) e 7º Termo Aditivo (out/16 a março/17)

Valor Global: R\$ 560.939,60

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	CRÉDITO	SALDO
abr/16	29/06/16	0004202	R\$ 53.422,83	R\$ 507.516,77
mai/16	29/06/16	0004203	R\$ 53.422,83	R\$ 454.093,94
jun/16	29/06/16	0004204	R\$ 53.422,83	R\$ 400.671,11
jul/16	29/06/16	0004205	R\$ 53.422,83	R\$ 347.248,28
ago/16	11/11/16	0004649	R\$ 53.422,83	R\$ 293.825,45
set/16	11/11/16	0004650	R\$ 53.422,83	R\$ 240.402,62
out/16	09/02/17	0000506	R\$ 40.067,12	R\$ 200.335,50
nov/16	09/02/17	0000507	R\$ 40.067,12	R\$ 160.268,38
dez/16	PENDENTE	PENDENTE		R\$ 160.268,38
jan/17	25/04/17	0001620	R\$ 40.067,12	R\$ 120.201,26
fev/17	05/06/17	0002638	R\$ 40.067,12	R\$ 80.134,14
mar/17	05/06/17	0002647	R\$ 40.067,12	R\$ 40.067,02

Quadro 10

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

2.11 CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL DA UEA - 2017/2018

Processo Administrativo nº. 2017/00006856 - UEA

Valor Global: R\$ 641.073,96

Termo de Contrato nº 06/2017 - UEA

Valor Mensal R\$ 53422,83

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	CRÉDITO	SALDO
abr/17	PENDENTE	PENDENTE	R\$ -	R\$ 641.073,96
mai/17	24/07/17	0004586	R\$ 53.422,83	R\$ 587.651,13
jun/17	11/08/17	0005156	R\$ 53.422,83	R\$ 534.228,30
jul/17	04/09/17	0005658	R\$ 53.422,83	R\$ 480.805,47
ago/17	04/09/17	0005658	R\$ 53.422,83	R\$ 427.382,64
set/17	19/12/17	0007271	R\$ 53.422,83	R\$ 373.959,81
out/17	19/12/17	0007270	R\$ 53.422,83	R\$ 320.536,98
nov/17	19/12/17	0007272	R\$ 53.422,83	R\$ 267.114,15
dez/17	19/12/17	0007310	R\$ 53.422,83	R\$ 213.691,32
jan/18	06/03/18	0011474	R\$ 53.422,83	R\$ 160.268,49
fev/18	25/04/18	0027026	R\$ 53.422,83	R\$ 106.845,66
mar/18	25/04/18	0027045	R\$ 53.422,83	R\$ 53.422,83

Quadro 11

Nota 1: Celebrado o Termo de Contrato 006/2017-UEA com valor mensal de 53.422,83 pelo prazo de 12 meses.

Nota 2: Recebidos no mês de abril/18 da UEA, pagtº. ref. aos aluguéis dos meses de fev e mar/18.

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

2.12 CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - SEAS

CONTRATO	Nº PARCELA	Nº OB	DATA PAGAMENTO	PARCELA	COMPETÊNCIA	vencimento	VALOR (R\$)
PAGO POR INDENIZAÇÃO			18/11/14	PAGO		out/14	R\$ 155.900,00
PAGO POR INDENIZAÇÃO			12/12/14	PAGO		nov/14	R\$ 155.900,00
PAGO POR INDENIZAÇÃO			30/12/14	PAGO		dez/14	R\$ 155.900,00
PAGO POR INDENIZAÇÃO			10/04/15	PAGO		jan/15	R\$ 160.800,00
PAGO POR INDENIZAÇÃO			10/04/15	PAGO		fev/15	R\$ 160.800,00
TOTAL							R\$ 789.300,00
CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - SEAS -							
CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12		06/05/15	PAGO		mar/15	10/04/2015 R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	2/12		16/06/15	PAGO		abr/15	10/05/2015 R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	3/12		16/06/15	PAGO		mai/15	10/06/2015 R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	4/12		10/07/15	PAGO		jun/15	10/07/2015 R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	5/12		10/08/15	PAGO		jul/15	10/08/2015 R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	6/12		10/09/15	PAGO		ago/15	10/09/2015 R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	7/12		09/11/15	PAGO		set/15	10/10/2015 R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	8/12		24/11/15	PAGO		out/15	10/11/2015 R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	9/12		21/01/16	PAGO		nov/15	10/12/2015 R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	10/12		26/03/16	PAGO		dez/15	10/01/2016 R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	11/12		30/05/16	PAGO		jan/16	10/02/2016 R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	12/12		30/05/16	PAGO		fev/16	10/03/2016 R\$ 160.800,00
TOTAL A RECEBER CT 2/2015							R\$ 1.929.600,00
TOTAL RECEBIDO CT 2/2015							R\$ 1.929.600,00
SALDO CT 2/2015							R\$ -
CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12						R\$ 48.240,00
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12	30147	06/07/17	PAGO 21 DIAS		mar/16	1 PARCIAL R\$ 124.897,92
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	2/12		31/01/17	PAGO		abr/16	10/05/2016 R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	3/12	9993	14/03/2017	PAGO		mai/16	10/06/2016 R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	4/12		31/01/17	PAGO		jun/16	10/07/2016 R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	5/12			PENDENTE		jul/16	10/08/2016 R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	6/12			PENDENTE		ago/16	10/09/2016 R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	7/12			PENDENTE		set/16	10/10/2016 R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	8/12			PENDENTE		out/16	10/11/2016 R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	9/12			PENDENTE		nov/16	10/12/2016 R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	10/12			PENDENTE		dez/16	10/01/2017 R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	11/12			PENDENTE		jan/17	10/02/2017 R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	12/12			PENDENTE		fev/17	10/03/2017 R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	12/12	31093	07/07/17	PAGO		mar/17	1 PARCIAL R\$ 53.527,68
TOTAL RECEBIDO 1TAC							R\$ 713.702,40
TOTAL A RECEBER 1TAC							R\$ 2.141.107,20
SALDO 1 TAC							R\$ 1.427.404,80
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12	36300	11/08/17	PAGO 21 DIAS		mar/17	2 PARCIAL R\$ 92.186,56
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12			PENDENTE		mar/17	2 PARCIAL R\$ 1.486,88
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	2/12	23739	05/06/16	PAGO		abr/17	10/05/2017 R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	3/12	30146	06/07/17	PAGO		mai/17	10/06/2017 R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	4/12	40592	01/09/17	PAGO		jun/17	10/07/2017 R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	5/12	40593	01/09/17	PAGO		jul/17	10/08/2017 R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	6/12	53846	14/12/17	PAGO		ago/17	10/09/2017 R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	7/12	54764	18/12/17	PAGO		set/17	10/10/2017 R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	8/12	8369	23/02/18	PAGO		out/17	10/11/2017 R\$ 126.384,80
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	8/12			PENDENTE		out/17	R\$ 7.434,40
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	9/12	8366	23/02/18	PAGO		nov/17	10/12/2017 R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	10/12	8367	23/02/18	PAGO		dez/17	10/01/2018 R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	11/12	17829	27/03/18	PAGO		jan/18	10/02/2018 R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	12/12	17831	27/03/18	PAGO		fev/18	10/03/2018 R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	12/12	31155	10/05/18	PAGO 9 dias		mar/18	10/04/2018 R\$ 40.145,76
TOTAL RECEBIDO 2TAC							R\$ 1.596.909,12
TOTAL A RECEBER 2TAC							R\$ 1.605.830,40
SALDO							R\$ 8.921,28
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12			pendente 21 dias		mar/18	10/04/2018 R\$ 93.673,44
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	2/12	71036	12/09/18	PAGO		abr/18	10/05/2018 R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	3/12	71037	12/09/18	PAGO		mai/18	10/06/2018 R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	4/12	71038	12/09/18	PAGO		jun/18	10/07/2018 R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	5/12	75324	26/09/18	PAGO		jul/18	10/08/2018 R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	6/12	75323	26/09/18	PAGO		ago/18	10/09/2018 R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	7/12					set/18	10/10/2018 R\$ 133.819,20

1.710.571,84

Quadro 12

*Nota: o valor da dívida principal, até 30/09/18, está no valor de

* Nota: 1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS - valor mensal de R\$ 178.425,60.

** Nota: 2TAC CONTRATO 002/2015-SEAS - valor mensal de R\$ 133.819,20.

*** Nota: 3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS - valor mensal de R\$ 133.819,20.

Fonte: GERA/COMAP.

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

IMÓVEIS DO COMPLEXO IPIXUNA E DUQUE DE CAXIAS. Encaminhado memorando nº 180/2016 à DIRAF dando conhecimento sobre as licitações dos imóveis declaradas desertas. Encaminhado memorando nº 345/2016 com histórico da locação dos imóveis. Deliberação da Diretoria, do dia 31/08/2016, que a GEJUR analise a possibilidade de contratação de corretor de imóveis, através de procedimento licitatório, para locação dos imóveis. Em resposta através de parecer no processo 2014.A.04879, a GEJUR opina pela possibilidade de contratação de corretor de imóveis, com a ressalva que o percentual referente pagamento dos honorários seja pago diretamente pelo locatário. Em elaboração de Projeto Básico para encaminhar para Licitação. Em abril, o corretor de imóvel, mandou as propostas com os ajustes, em elaboração processo licitatório. Em razão da irregularidade fiscal da empresa Corretora de imóveis, será realizada nova pesquisa de mercado para proposta de serviços. Aguardando proposta de empresa Corretora de Imóveis. Em elaboração pela COMAP de projeto básico. Recebido documentação e certidões de regularidade fiscal da empresa corretora de imóveis para compor o processo. Solicitado ajustes de proposta e regularização de certidões fiscais. Projeto básico em ajustes pela GERAFF e COMAP em razão da necessidade de outras propostas. Aguardando novas propostas para prestação dos serviços. Não recebido propostas para prestação dos serviços neste mês. Dificuldades para recebimento de propostas. Reiterado pedido de propostas, caso negativo, apresentar justificativas. **Em razão da dificuldade em obter mais propostas para prestação dos serviços, será consultado a GEJUR para manifestação sobre a possibilidade dar prosseguimento ao processo sem as três propostas de preços. Em resposta a GEJUR sinaliza pela possibilidade de usar uma proposta, tendo que apresentar justificativa. Fonte: GERAFF/COMAP.**

IMÓVEL NO MUNICÍPIO DE TEFÉ: Foi elaborado o processo administrativo nº 2014.A.04022 que deverá ser encaminhado à Comissão Geral de Licitação para os procedimentos licitatórios e posteriormente a alienação do imóvel, localizado em Tefé. O processo estava na Gerência Jurídica para reanálise do processo de abertura de procedimento licitatório. O processo foi encaminhado pela GEJUR em outubro/14 a PGE para consulta sobre o tema, mas até o mês de novembro de 2015 não retornou para Amazonprev. O processo retornou da PGE em 11/12/2015 com a recomendação da necessidade de autorização legislativa prévia para alienação do imóvel, podendo ser uma autorização de forma genérica na LC 30/2001 e que já consta no projeto de alteração da LC 30/2001 encaminhada a Casa Civil. No mês de novembro/17 houve alteração da LC 30/2001 com inclusão da possibilidade da alienação dos bens imóveis. Em

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

elaboração processo para deliberação da Diretoria para alienação do imóvel. Processo em fase de ajustes pela COMAP para dar prosseguimento aos procedimentos de alienação. Encaminhado processo 2014.A.04022 à GEJUR para emissão de parecer. Processo ainda na GEJUR para manifestação. **O processo ainda não retornou da GEJUR para dar prosseguimento. Processo devolvido da GEJUR e encaminhado ao GADIR para conhecimento e deliberação da Diretoria. Processo na COMAP para dar prosseguimento e atender a deliberação da Diretoria. Fonte: GERA/COMAP.**

IMÓVEIS EM LITÍGIO

Imóvel	Localização	Valor do Imóvel	Situação
Travessa Rio Branco s/n, Parintins - AM	Parintins	R\$ 137.100,00	Solicitado por parte da Amazonprev a ampliação de penhora de bens para pagamento da Amazonprev, deferida pelo Juiz
Av. Governador Gilberto Mestrinho - Fonte Boa - AM	Fonte Boa	R\$ 352.000,00	A Amazonprev elaborou a réplica da contestação de posse, mas até o momento não há notícias de novo trâmite processual.

Quadro 13

Nota: O Município de Fonte Boa continua em correição desde novembro de 2014. O Juiz Rafael Rodrigo da Silva Raposo, lotado na Vara de Fonte Boa, assumiu o cargo há quase um ano, porém ainda não analisou os autos da Amazonprev. **Fonte:** GEJUR.

2.14 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	31/08/2018	28/09/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.064.089.834,69	R\$ 3.120.638.044,99
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 590.454.844,09	R\$ 596.478.774,62
TÍTULOS CVS	R\$ 14.511.167,76	R\$ 14.366.083,04
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 5.748,19	R\$ 34,21
TOTAL	R\$ 3.733.589.594,73	R\$ 3.796.010.936,86

Quadro 14

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

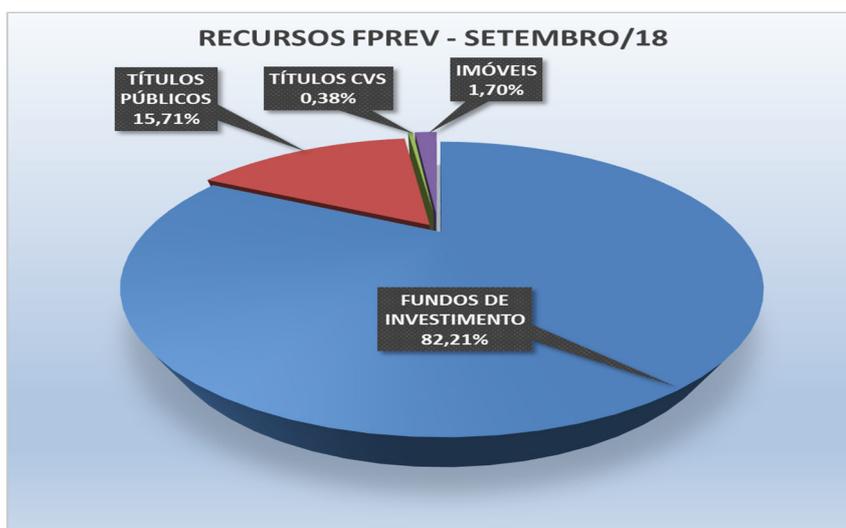


Gráfico 4

2.15 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
jan/18	R\$ 3.432.495.345,53	2,47%	2,47%	24,58%
fev/18	R\$ 3.476.496.589,48	1,28%	3,79%	22,11%
mar/18	R\$ 3.535.665.708,63	1,70%	5,55%	21,86%
abr/18	R\$ 3.575.920.197,63	1,14%	6,76%	22,04%
mai/18	R\$ 3.561.828.017,47	-0,39%	6,34%	20,65%
jun/18	R\$ 3.598.964.002,84	1,04%	7,44%	20,22%
jul/18	R\$ 3.698.286.196,44	2,76%	10,41%	19,65%
ago/18	R\$ 3.733.589.594,73	0,95%	11,46%	18,50%
set/18	R\$ 3.796.010.936,86	1,67%	13,33%	18,04%

Quadro 15

2.16 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO

IPCA

PERÍODO	TAXA
setembro/17	0,16%
agosto/18	-0,09%
setembro/18	0,48%
Acumulado no ano de 2018	3,34%
Acumulado nos últimos 12 meses	4,53%
Meta Atuarial no mês	0,9691%

Quadro 16

DESCRIÇÃO	SETEMBRO/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2005 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,8024%	5,0498%	6,4305%	406,9197%
META ATUARIAL	0,9691%	7,9595%	10,7971%	371,8316%
RESULTADO ATUARIAL	-0,1651%	-2,6952%	-3,9411%	7,4366%

Quadro 17

Nota: Rentabilidade validada pelo atuário.

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

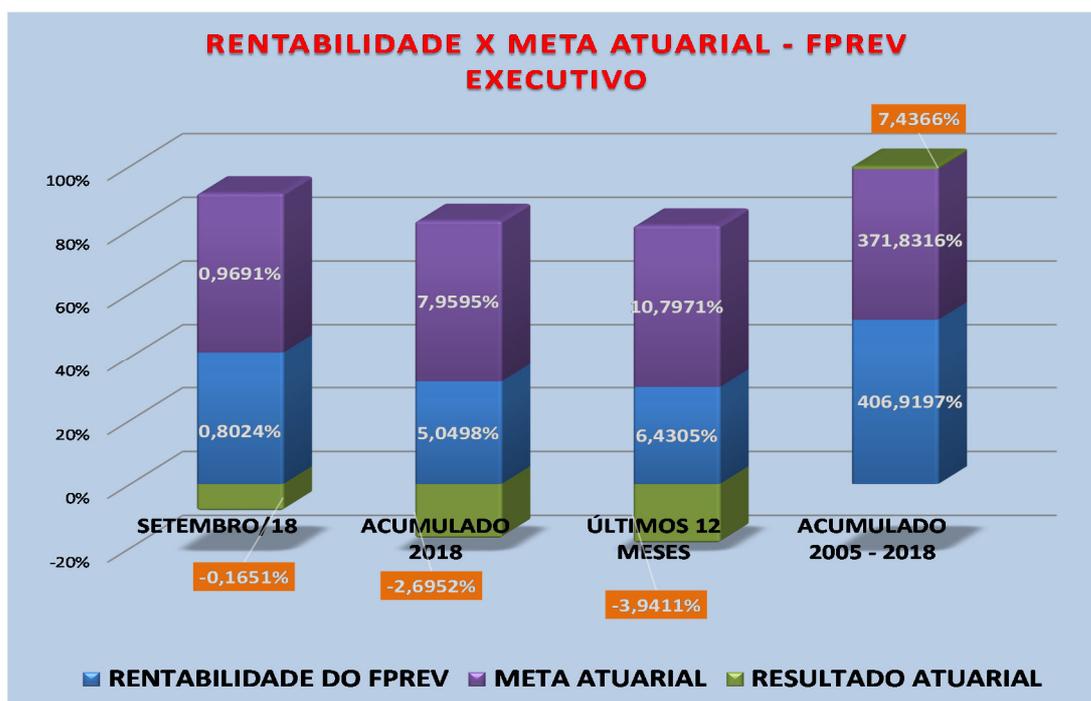


Gráfico 5.

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

3.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos –ALE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2018	28/09/2018	jul/18	ago/18	set/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO FI REF. FEDERAL EXTRA	R\$ 3.311.533,41	R\$ 3.326.705,59	0,5300	0,5525	0,4571	1,5475%	4,6600%	NC	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 3.349.446,76	R\$ 3.473.217,36	0,9433	0,1400	0,6563	1,7481%	4,2414%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -							
TOTAL	R\$ 6.660.980,17	R\$ 6.799.922,95							

Quadro 18

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2018	28/09/2018	jul/18	ago/18	set/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 1.993.252,02	R\$ 2.013.515,01	6,5622	0,4435%	1,0200%	6,5778%	6,5950%	10,1427%
TOTAL GERAL	R\$ 1.993.252,02	R\$ 2.013.515,01						

Quadro 19.

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	jul/18	ago/18	set/18
SALDO ANTERIOR	8.251.023,62	8.522.044,39	8.654.232,19
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	98.647,18	100.428,57	101.797,94
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	172.373,59	31.759,23	57.407,83
SALDO FINAL	8.522.044,39	8.654.232,19	8.813.437,96

Quadro 20

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	31/08/2018	28/09/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 6.660.980,17	R\$ 6.799.922,95
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 1.993.252,02	R\$ 2.013.515,01
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 8.654.232,19	R\$ 8.813.437,96

Quadro 21

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
ago/17	R\$ 6.976.419,44	2,38%	23,25%	37,97%
set/17	R\$ 7.138.676,97	2,33%	26,12%	37,40%
out/17	R\$ 7.245.680,53	1,50%	33,51%	35,88%
nov/17	R\$ 7.349.135,69	1,43%	35,41%	35,41%
dez/17	R\$ 7.574.592,78	3,07%	33,82%	33,82%
jan/18	R\$ 7.784.283,78	2,77%	32,44%	27,36%
fev/18	R\$ 7.911.489,25	1,63%	29,44%	26,32%
mar/18	R\$ 8.048.711,42	1,73%	6,26%	26,54%
abr/18	R\$ 8.223.861,55	2,18%	8,57%	27,19%
mai/18	R\$ 8.150.747,92	-0,89%	7,61%	23,46%
jun/18	R\$ 8.251.023,62	1,23%	8,93%	21,08%
jul/18	R\$ 8.522.044,39	3,28%	12,51%	22,15%
ago/18	R\$ 8.654.232,19	1,55%	14,25%	21,23%
set/18	R\$ 8.813.437,96	1,84%	16,36%	21,64%

Quadro 22

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

DESCRIÇÃO	SETEMBRO/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2012 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,6633%	4,7914%	5,9436%	119,549751%
META ATUARIAL	0,9691%	7,9595%	10,7971%	117,298127%
RESULTADO ATUARIAL	-0,3029%	-2,9345%	-4,3805%	1,036191%

Quadro 23

Nota: Obs: Rentabilidade validada pelo atuário.

4. RECURSOS DO MINISTÉRIO PÚBLICO /MPE-PGJ – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos –MPE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2018	28/09/2018	jul/18	ago/18	set/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI REF DI PREMIUM	R\$ 97.414.926,59	R\$ 97.868.059,47	0,5299	0,5543	0,4651	1,5572%	2,4571%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,01						
TOTAL	R\$ 97.414.927,59	R\$ 97.868.060,48						

Quadro 24.

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

DESCRIÇÃO	SETEMBRO/18	ACUMULADO 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,4652%	2,9559%
META ATUARIAL	0,9691%	4,4062%
RESULTADO ATUARIAL	-0,4991%	-1,3891%

Quadro 25.

Nota: Registra-se que Ministério Público Estadual, representado pela Procuradoria Geral de Justiça do Estado do Amazonas – PGJ/AM, depositou no dia 04/05/2018, o valor de R\$ 95.520.906,30 a título de contribuições passadas, corrigidas pela meta atuarial do período de janeiro/2004 a novembro/17, devidas ao Fundo Previdenciário de seus servidores conforme disposto no Termo de Compromisso de Adesão, celebrado com esta Unidade Gestora de Previdência em 14/11/2017. Considerando que as ações operacionais do processo de adesão ainda estão em curso, não estão sendo repassadas as contribuições mensais nem executadas as despesas previdenciárias, o que poderá alterar o resultado atuarial.

5. CONSOLIDADO – FPREV

5.1 Evolução dos Recursos Consolidados – ALE FPREV, EXECUTIVO E MPE.

ANO	ALE FPREV	EXEC. FPREV	MPE FPREV	TOTAL FPREV
2004	R\$ -	R\$ 15.862.618,50	R\$ -	R\$ 15.862.618,50
2005	R\$ -	R\$ 57.510.136,49	R\$ -	R\$ 57.510.136,49
2006	R\$ -	R\$ 83.649.681,60	R\$ -	R\$ 83.649.681,60
2007	R\$ -	R\$ 75.698.485,78	R\$ -	R\$ 75.698.485,78
2008	R\$ -	R\$ 179.805.240,72	R\$ -	R\$ 179.805.240,72
2009	R\$ -	R\$ 341.872.841,56	R\$ -	R\$ 341.872.841,56
2010	R\$ -	R\$ 489.868.867,80	R\$ -	R\$ 489.868.867,80
2011	R\$ -	R\$ 657.928.672,97	R\$ -	R\$ 657.928.672,97
2012	R\$ 436.901,72	R\$ 936.612.579,50	R\$ -	R\$ 937.049.481,22
2013	R\$ 1.239.708,12	R\$ 1.166.915.511,62	R\$ -	R\$ 1.168.155.219,74
2014	R\$ 2.509.280,78	R\$ 1.571.464.403,45	R\$ -	R\$ 1.573.973.684,23
2015	R\$ 3.643.310,21	R\$ 2.012.490.466,39	R\$ -	R\$ 2.016.133.776,60
2016	R\$ 5.660.283,00	R\$ 2.700.997.719,11	R\$ -	R\$ 2.706.658.002,11
2017	R\$ 7.574.592,78	R\$ 3.349.596.826,89	R\$ -	R\$ 3.357.171.419,67
2018	R\$ 8.813.437,96	R\$ 3.796.010.936,86	R\$ 97.868.060,48	R\$ 3.902.692.435,30

Quadro 26

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

5.2 Resumo da rentabilidade 2018 – ALE FPREV, EXECUTIVO E MPE.

Mês	Receitas	Despesas	Saldo	3.357.171.419,67
jan/18	41.653.212,18	1.259.551,29	40.393.660,89	3.440.184.176,32
fev/18	28.289.917,62	1.162.275,60	27.127.642,02	3.484.408.078,74
mar/18	30.689.645,26	1.331.523,40	29.358.121,86	3.543.714.420,05
abr/18	29.217.580,21	1.356.698,77	27.860.881,44	3.584.144.059,18
mai/18	119.241.731,96	1.363.754,02	117.877.977,94	3.665.960.737,15
jun/18	32.029.606,75	822.507,98	31.207.098,77	3.703.582.328,39
jul/18	31.932.761,61	2.080.315,11	29.852.446,50	3.803.175.542,76
ago/18	32.641.595,98	1.353.348,22	31.288.247,76	3.839.658.754,50
set/18	34.199.496,93	1.633.978,49	32.565.518,44	3.902.692.435,30
out/18	0,00	0,00	0,00	0,00
nov/18	0,00	0,00	0,00	0,00
dez/18	0,00	0,00	0,00	0,00
			Meta	7,96%
			Rentabilidade	5,06%
			Resultado	-2,69%

Quadro 27. Validado pelo atuário.

6. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

6.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Investimentos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)				
	31/08/2018	28/09/2018	jul/18	ago/18	set/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.612.109,67	R\$ 2.543.749,94	0,5205	0,5403	0,4500	2,0259%	4,6096%	6,3980%
BRADESCO FI RF IRF M1 - COMPREV	R\$ 8.173.428,91	R\$ 8.066.835,72	0,6600	0,3785	0,5821	1,6292%	4,6191%	6,4818%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 10.785.539,58	R\$ 10.610.586,66						

Quadro 28

6.2 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit - FFIN ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2018	28/09/2018
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 6.668,32	R\$ 5.837,68
TOTAL	R\$ 6.668,32	R\$ 5.837,68

Quadro 29.

6.3 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	jul/18	ago/18	set/18
SALDO ANTERIOR	R\$ 19.657,15	R\$ 1,00	R\$ 6.668,32
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 853.619,67	R\$ 882.095,41	R\$ 869.868,60
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.754.531,03	R\$ 1.277.759,11	R\$ 1.335.033,86
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
SAIDAS FINANCEIRAS	(2.627.806,85)	(2.153.187,20)	(2.205.733,10)
SALDO FINAL	R\$ 1,00	R\$ 6.668,32	R\$ 5.837,68

Quadro 30

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

6.4 Disponibilidade Financeira – FFIN EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/08/2018	28/09/2018
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 109.214,90	R\$ 660.400,42
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ -	R\$ 2.753.952,99
REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ -

Quadro 31

Nota: Salários Não Reclamados referem-se aos proventos de aposentadoria ou pensão que são devolvidos pelo Banco devido a inconsistências bancárias na folha de pagamento.

Nota: Valor de Cobertura do Déficit referente à IRRF s/ folha de pagamento de Setembro/2018, regularizado em outubro/2018.

7. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

7.1 SALDOS E PERFORMANCE DOS RECURSOS – TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2018	28/09/2018	jul/18	ago/18	set/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.200.098,72	R\$ 1.176.639,59	0,5205	0,5403	0,4500	2,0206%	4,5887%	6,3768%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 35.215.422,84	R\$ 36.870.607,61	0,6835	0,4065	0,5887	1,6879%	4,6876%	6,5665%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 36.415.522,56	R\$ 38.047.248,20						

Quadro 32

8. RECURSOS DOS OUTROS PODERES – TJA E TCE

8.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/08/2018	28/09/2018	jul/18	ago/18	set/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FI REF. DI FEDERAL EXTRA	R\$ 99.450.895,39	R\$ 99.905.806,75	0,5276	0,5525	0,4571	1,5451%	3,6787%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 133.692.753,60	R\$ 135.906.747,71	0,6835	0,4065	0,5887	1,6879%	4,6876%	6,5621%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 128.718.384,91	R\$ 130.904.948,62	0,6756	0,3953	0,5901	1,6700%	4,6543%	6,5040%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 361.862.033,90	R\$ 366.717.503,08						

Quadro 33

8.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	jul/18	ago/18	set/18
SALDO ANTERIOR	352.391.415,50	357.416.025,65	361.862.033,90
REPASSES FINANCEIROS	3.000.312,32	3.009.050,50	3.002.032,15
VARIAÇÃO FINANCEIRA	2.250.472,37	1.584.308,47	2.001.618,23
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(226.174,54)	(147.350,72)	(148.181,20)
SALDO FINAL	R\$ 357.416.025,65	R\$ 361.862.033,90	R\$ 366.717.503,08

Quadro 34

Nota: Os Repasses e as Saídas Financeiras são representados pelos créditos recebidos e pagamento dos pensionistas desses órgãos, ambos registrados sob regime de Caixa.

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

8.3 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/08/2018	28/09/2018	jul/18	ago/18	set/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FI REF. DI FEDERAL EXTRA	R\$ 42.771.604,34	R\$ 42.967.251,53	0,5276	0,5525	0,4571	1,5451%	3,6787%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 54.004.802,57	R\$ 54.652.566,70	0,6835	0,4065	0,5887	1,6879%	4,6876%	6,5621%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 52.464.114,43	R\$ 53.103.564,17	0,6756	0,3953	0,5901	1,6700%	4,6543%	6,5040%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 141,06	R\$ -						
TOTAL	R\$ 149.240.662,40	R\$ 150.723.382,40						

Quadro 35

8.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	jul/18	ago/18	set/18
SALDO ANTERIOR	146.378.613,42	147.917.423,59	149.240.662,40
REPASSES FINANCEIROS	811.326,36	815.319,44	809.419,26
VARIAÇÃO FINANCEIRA	920.493,98	657.808,11	823.189,48
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(193.010,17)	(149.888,74)	(149.888,74)
SALDO FINAL	R\$ 147.917.423,59	R\$ 149.240.662,40	R\$ 150.723.382,40

Quadro 36

Nota: Os Repasses e as Saídas Financeiras são representados pelos créditos recebidos e pagamento dos pensionistas desses órgãos, ambos registrados sob regime de Caixa.

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

9. ENQUADRAMENTO

9.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2018	LIMITE DA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
TÍTULOS DO TN	R\$ 598.492.289,63	13,59%	40,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 655.918.242,35				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 18.255.102,77				
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.825.593,84				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 474.098.327,73				
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 154.366.672,24	52,03%	40,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 8.066.835,72				
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 276.152.832,18				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 609.739.432,23				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 42.433.702,09				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 43.606.382,29				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 3.720.389,53				
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 365.093.492,95				
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 475.783.888,14				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 56.412.104,81				
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 207.172.300,65	32,23%	15%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 224.557.855,02				
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ -				
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 76.743.064,96				
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 10.225.135,57				
TÍTULOS CVS	R\$ 14.366.083,04	0,33%	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	-	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.324.029.727,74	98,18%			

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2018	LIMITE DA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 15.776.642,99	0,36%	1%	30%	art. 8º, inciso I, "a"
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.216.343,87				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 1.996.809,32	0,77%	2%	20%	art. 8º, inciso II, "a"
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 28.482.481,30				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 5.156.091,54				
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.210.438,54	0,70%	1%	10%	art. 8º, inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.068.386,72				
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.326.196,40				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 80.233.390,68	1,82%			

TOTAL GERAL DA CARTEIRA	R\$ 4.404.263.118,42	100,00%
--------------------------------	-----------------------------	----------------

Quadro 37

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

9.2 Enquadramento II – Limites Gerais – art. 13º - Res. CMN 3922/10 atualizada pela Res. N° 4.604/17.

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	TOTAL DOS RECURSOS DO RPPS	% CARTEIRA	Res. n° 3.922/2010 atualizada pela Res. n° 4.604/2017
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 3.720.389,53	R\$ 4.404.263.118,42	0,08%	20%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 365.093.492,95		8,29%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 475.783.888,14		10,80%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 56.412.104,81		1,28%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 207.172.300,65		4,70%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 224.557.855,02		5,10%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ -		0,00%	
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 76.743.064,96		1,74%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 10.225.135,57		0,23%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 15.776.642,99		0,36%	

Quadro 38

Nota: Enquadramento II - Art. 13. As aplicações em cotas de um mesmo fundo de investimento a que se referem o art. 7º, incisos III, IV e art. 8º, I, não podem exceder a 20% (vinte por cento) das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social.

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

9.3 Enquadramento III – Limites Gerais – art. 13º - Res. CMN 3922/10 atualizada pela Res. N° 4.604/17.

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. n° 3.922/2010 atualizada pela Res. n° 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 655.918.242,35	R\$ 12.769.780.117,05	5,14%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 18.255.102,77	R\$ 635.876.147,99	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX - 15/08/2018	R\$ 8.825.593,84	R\$ 119.615.081,57	7,38%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 474.098.327,73	R\$ 6.551.962.373,55	7,24%	
SANTANDER FIC INST. REF DI	R\$ 76.743.064,96	R\$ 4.677.542.364,69	1,64%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 154.366.672,24	R\$ 1.229.629.546,20	12,55%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 28.482.481,30	R\$ 579.828.286,30	4,91%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 207.172.300,65	R\$ 2.286.042.286,58	9,06%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 10.225.135,57	R\$ 1.123.037.722,39	0,91%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 15.776.642,99	R\$ 698.161.207,05	2,26%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIS FIC FI	R\$ 1.996.809,32	R\$ 1.022.715.143,34	0,20%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 276.152.832,18	R\$ 19.832.435.937,17	1,39%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 609.739.432,23	R\$ 8.106.459.151,64	7,52%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 224.557.855,02	R\$ 2.463.089.662,35	9,12%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 42.433.702,09	R\$ 248.448.940,63	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 43.606.382,29	R\$ 177.956.766,18	24,50%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.210.438,54	R\$ 259.847.156,25	2,01%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.216.343,87	R\$ 31.100.975,76	10,34%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 365.093.492,95	R\$ 7.806.938.354,46	4,68%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 56.412.104,81	R\$ 532.135.371,32	10,60%	
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 8.066.835,72	R\$ 1.529.875.360,39	0,53%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 3.720.389,53	R\$ 421.385.149,48	0,88%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 475.783.888,14	R\$ 8.306.202.940,79	5,73%	

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. n° 3.922/2010 atualizada pela Res. n° 4.604/2017
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.326.196,40	R\$ 604.840.992,06	2,53%	5%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 5.156.091,54	R\$ 451.807.986,08	1,14%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.068.386,72	R\$ 2.104.373.760,71	0,24%	

Quadro 39

Nota 1: Art. 14 O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em um mesmo fundo de investimento deverá representar, no máximo, 15% (quinze por cento) do patrimônio líquido (PL) do fundo;

Nota 2: Art. 14 § 1º O limite de que trata o caput será de até 5% (cinco por cento) do patrimônio líquido dos fundos de investimento de que tratam os incisos VII do art. 7º, III e IV do art. 8º (ver Enquadramento 1);

Nota 3: Art. 14 § 3º. Em caso de os limites de que tratam o caput e o § 1º deste artigo serem ultrapassados em decorrência de resgate de cotas do fundo por outros cotistas, o regime próprio de previdência social deverá adequar-se em até 120 dias;

Nota 4: Art. 21. § 1º As aplicações que apresentem prazos para vencimento, resgate, carência ou para conversão de cotas de fundos de investimento previstas em seu regulamento então vigente poderão ser mantidas em carteira até a respectiva data, caso superior ao prazo previsto no caput. Assim, considera-se que os fundos Caixa FI Brasil 2020 V TP RF e Caixa FI Brasil 2024 VI TP RF encontram-se enquadrados, pois o resgate dessas aplicações ocorrerá no vencimento dos TPF que compõe a carteira dos fundos, ou seja, 16/08/2020 e 16/08/2024, respectivamente.

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

9.4 Enquadramento IV – Limites Gerais – art. 14º - A - Res. CMN 3922/10

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA AGOSTO/18) EM R\$ BI	TOTAL RECURSOS - AMAZONPREV	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Res. nº. 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB DTVM S.A	R\$ 913.523,66	R\$ 1.157.097.266,69	0,1267%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 650.653,71	R\$ 235.170.888,53	0,0361%	
BRADESCO	R\$ 597.027,99	R\$ 909.076.711,15	0,1523%	
CAIXA	R\$ 307.823,76	R\$ 1.220.243.182,62	0,3964%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	R\$ 256.645,63	R\$ 259.592.218,50	0,1011%	
BANCO SAFRA	R\$ 100.004,10	R\$ 10.224.478,26	0,0102%	

Quadro 40

Nota 1: Art. 14-A. O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica.

Nota 2: Para fins desse enquadramento, é aplicado o Ranking ANBIMA, atualizado, para o Gestores de Recursos de Terceiros.

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

10. TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.120.638.044,99
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 596.478.774,62
CVS	R\$ 14.366.083,04
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE DE FINANCEIRA	R\$ 34,21
TOTAL	R\$ 3.796.010.936,86

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA - ALE FPREV E ALE FFIN

DESCRIÇÃO	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 6.799.922,95
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.013.515,01
ALE FPREV DISPONIBILIDADE DE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ -
ALE FFIN DISPONIBILIDADE DE FINANCEIRA	R\$ 5.837,68
TOTAL	R\$ 8.819.275,64

MPE FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 97.868.059,47
MPE FPREV DISPONIBILIDADE DE FINANCEIRA	R\$ 1,01
TOTAL	R\$ 97.868.060,48

TAXA DE ADM. FFIN EXECUTIVO, COMPREV, SAL. NÃO RECL. E DISP. FINANCEIRA

DESCRIÇÃO	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	R\$ 38.047.247,20
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 2.543.749,94
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 8.066.835,72
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM.	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - FFIN	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ 2.753.952,99
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 660.400,42
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -
TOTAL	R\$ 52.072.188,27

OUTROS PODERES

ORGÃOS	SALDO
TJ/AM	R\$ 366.717.503,08
TCE/AM	R\$ 150.723.382,40
DISPONIBILIDADE DE FINANCEIRA - TJA/TCE	R\$ -
TOTAL	R\$ 517.440.885,48
TOTAL GERAL	4.472.211.346,73

Quadro 41

Relatório de Investimentos Setembro de 2018

10.1 CONSOLIDADO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	FPREV PODER EXECUTIVO	FPREV - ALE	TOTAL - FPREV
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.120.638.044,99	R\$ 6.799.922,95	R\$ 3.127.437.967,94
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 596.478.774,62	R\$ 2.013.515,01	R\$ 598.492.289,63
CVS	R\$ 14.366.083,04	R\$ -	R\$ 14.366.083,04
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ -	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 34,21	R\$ 1,00	R\$ 35,21
TOTAL	R\$ 3.796.010.936,86	R\$ 8.813.438,96	R\$ 3.804.824.375,82

DESCRIÇÃO	FFIN - PODER EXECUTIVO	FFIN - ALE	TOTAL FFIN
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 2.543.749,94	R\$ -	R\$ 2.543.749,94
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 5.837,68	R\$ 5.837,68
TOTAL	R\$ 2.543.749,94	R\$ 5.837,68	R\$ 2.549.587,62

DESCRIÇÃO	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	SALARIOS NÃO RECLAMADOS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 38.047.247,20	R\$ -	R\$ 38.047.247,20
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 660.400,42	R\$ 660.401,42
TOTAL	R\$ 38.047.248,20	R\$ 660.400,42	R\$ 38.707.648,62

DESCRIÇÃO	COMPREV	DISP. COBERTURA DEFICIT E REPASSE PATRONAIS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 8.066.835,72	R\$ -	R\$ 8.066.835,72
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ 2.753.952,99	R\$ 2.753.952,99
TOTAL	R\$ 8.066.835,72	R\$ 2.753.952,99	R\$ 10.820.788,71

DESCRIÇÃO	RECURSOS TJ/AM	RECURSOS TCE/AM	TOTAL RECURSOS TCE E TJ
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 366.717.503,08	R\$ 150.723.382,40	R\$ 517.440.885,48
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 366.717.503,08	R\$ 150.723.382,40	R\$ 517.440.885,48

DESCRIÇÃO	RECURSOS MPE FPREV		TOTAL RECURSOS MPE FPREV
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 97.868.059,47	R\$ -	R\$ 97.868.059,47
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,01	R\$ -	R\$ 1,01
TOTAL	R\$ 97.868.060,48	R\$ -	R\$ 97.868.060,48

TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV			R\$ 4.472.211.346,73
--	--	--	-----------------------------

Quadro 42

Relatório de Investimentos Setembro de 2018



Gráfico 6.

Nota: Conforme PPA 2018-2022 o valor projetado para 2018, no total de R\$ 4.357.626,00, já foi superado no mês de agosto/2018.

Sem mais a informar, segue para Superior Consideração.

Respeitosamente,

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Leonardo Cavalcanti
Membro

Renízio Ferreira
Membro