

Relatório de Investimentos março de 2019

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: **Relatório de Investimentos – março/2019**

Data: 15/03/2019

RELATÓRIO Nº. 11/2019 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **março/2019**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 04);
- 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 05 a 15);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV/ALEAM (páginas 16 a 17);
- 4) Recursos do Ministério Público e Defensoria Pública - FPREV - (páginas 17 e 18)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (páginas 18 e 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 21 a 24);
- 9) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 25 e 26).

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Março mostrou-se mais um mês satisfatório no âmbito dos mercados globais, ainda que os riscos em torno da atividade econômica em determinadas regiões tenham aumentado. No que tange à atividade global, a agenda macro continuou mostrando moderação, mas ainda em patamar sólido. A manutenção das perspectivas positivas para as negociações comerciais entre China e EUA, assim como a postura bastante flexível por parte dos principais bancos centrais, foram favoráveis aos mercados. Por outro lado, o enfraquecimento adicional da atividade industrial na Europa levantou temores de mais intensa desaceleração econômica da região, fato que, juntamente ao impasse quanto ao Brexit, trouxe maior volatilidade aos ativos no final do mês. Nesse ambiente, a aversão ao risco oscilou mas encerrou o período relativamente estável, enquanto os principais ativos internacionais mostraram trajetória favorável.

Nos EUA, a agenda macro veio mista, indicando um ritmo de expansão moderado. No campo da atividade, as vendas ao varejo de fevereiro caíram 0,2% no ampliado e no núcleo, mas com revisão altista de dados anteriores. Já a produção da indústria avançou 0,1% em fevereiro. Por sua vez, as pesquisas regionais de atividade industrial vieram negativas em sua maioria, os dados do setor imobiliário vieram mistos, enquanto as pesquisas de confiança subiram. Pelo lado do emprego: i) o payroll revelou apenas 20 mil novos postos de trabalho em fevereiro, após alta de 311 mil em janeiro; ii) a taxa de desemprego caiu de 4,0% para 3,8%; e iii) os salários aceleraram de 3,2% para 3,4% na variação anual. No campo dos preços, o CPI recuou novamente no acumulado em 12 meses: o ampliado saiu de 1,6% para 1,5%, enquanto que o núcleo recuou de 2,2% para 2,1%.

Na Zona do Euro, as prévias dos PMIs mostraram enfraquecimento adicional: o da indústria caiu de 49,3 para 47,6, com o alemão voltando a 44,7, ambos nos menores patamares em ao menos seis anos. Por sua vez, o PMI dos serviços subiu de 51,2 para 52,8 entre janeiro e fevereiro.

Entre os emergentes, na China, os dados de atividade de fevereiro foram mistos, apesar das distorções associadas ao feriado de Ano Novo Lunar: i) a produção industrial desacelerou de 6,2% para 5,3% (+6,1% com ajuste sazonal); ii) as vendas no varejo recuaram de 9,0% para 8,2%; e iii) o investimento acelerou de 5,9% para 6,1%.

No âmbito dos BC's, o Banco Central americano (FED) manteve os juros entre 2,25% e 2,5%, anunciando que pretende encerrar em setembro a redução do seu balanço e também zerou, na mediana das suas projeções, a alta de juros para 2019. Além disso, o Banco Central Europeu renovou a postura dovish mantendo os juros estáveis em patamar negativo, prorrogando a

Relatório de Investimentos março de 2019

promessa de não elevação até ao menos o final de 2019 e anunciou um novo programa de liquidez para o sistema bancário, o TLTRO-III.

No ambiente doméstico, os dados foram mistos. No âmbito da atividade, a produção industrial recuou 0,7% em janeiro, ao passo que as vendas ao varejo no conceito restrito avançaram 0,4%. Já o IBC-BR, proxy mensal do BC para o PIB, recuou 0,4%. No mercado de trabalho, a taxa de desemprego da PNAD foi de 12,4% no trimestre encerrado em fevereiro, aumento de 0,4p.p. em comparação ao trimestre encerrado em janeiro (12,0%). No campo inflacionário, o IPCA acelerou de 0,32% para 0,43% em fevereiro, levando o acumulado em doze meses de 3,78% para 3,89%. No front monetário, o Copom manteve a taxa Selic em 6,5%. No campo das finanças públicas, o setor público consolidado apresentou déficit primário de R\$14,9 bilhões em fevereiro, R\$105,8 bilhões em 12 meses, equivalente a 1,54% do PIB.

Fonte: BB DTVM S.A – GESTÃO DE RECURSOS: CONJUNTURA MACRO ECONÔMICA.

Relatório de Investimentos março de 2019

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 (%)						
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 595.884.692,62	R\$ 498.300.303,01	0,5338	0,4841	0,4677	1,4929%	1,4929%	6,2193%	
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.307.143,19	R\$ 60.749.603,11	1,5783	0,4877	0,7337	2,8226%	2,8226%	NC	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 57.752,56	R\$ -	0,5189	0,4714	0,0470	1,0402%	1,0402%	NC	
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 44.277.599,93	R\$ 44.474.139,68	0,5679	0,4477	0,4439	1,4666%	1,4666%	NC	
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 43.110.130,82	R\$ 43.363.048,46	1,0480	0,5395	0,5867	2,1892%	2,1892%	7,6500%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 47.241.071,88	R\$ 47.672.829,20	2,4197	0,3558	0,9139	3,7235%	3,7235%	9,2600%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 236.431.023,01	R\$ 243.676.445,29	2,8809	0,5013	0,5446	3,9598%	3,9598%	8,9650%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 651.325.006,74	R\$ 656.304.086,11	1,5329	0,5239	0,7645	2,8451%	2,8451%	12,5155%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 73.613.174,67	R\$ 73.931.708,86	6,5272	0,5188	0,4327	7,5432%	7,5432%	NC	
SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	R\$ 78.761.184,31	R\$ 79.032.042,59	0,5475	0,5169	0,4687	1,5410%	1,5410%	6,3858%	
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 164.824.092,51	R\$ 166.088.292,20	1,5215	0,5295	0,7670	2,8418%	2,8418%	8,9756%	
BB PREVID RF IRF MI	R\$ 397.282.111,20	R\$ 399.023.858,72	0,5753	0,4388	0,4384	1,4595%	1,4595%	6,4471%	
BB PREVID TP VII	R\$ 18.788.442,69	R\$ 18.911.588,83	1,3413	0,5223	0,6554	2,5383%	2,5383%	9,3852%	
BB PREVID TP IX	R\$ 9.044.279,96	R\$ 9.084.817,38	0,5186	0,4724	0,4482	1,4461%	1,4461%	7,0020%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 536.583.111,54	R\$ 540.073.974,77	1,2153	0,6067	0,6505	2,4918%	2,4918%	8,6480%	
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ 110.669.181,84	R\$ 111.127.535,66	6,5819	0,4610	0,4141	7,5167%	7,5167%	NC	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II	R\$ 229.531.480,49	R\$ 236.410.972,34	2,3732	0,3396	0,3900	3,1215%	3,1215%	8,0436%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RE FIC FI	R\$ -	R\$ 100.076.570,43	-	-	0,0766	0,0766%	0,0766%	NC	
TOTAL	R\$ 3.297.731.479,96	R\$ 3.328.301.816,64							

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.427.039,89	R\$ 5.444.620,10	0,5569	0,2783	0,3239	1,1633%	1,1633%	5,5816%	
CAIXA FI JUROS E MOEDAS	R\$ 15.686.136,27	R\$ 15.750.197,82	0,4802	0,4335	0,4084	1,3279%	1,3279%	NC	
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 3.712.197,70	R\$ 3.677.323,54	12,5536	(4,8664)	(0,9394)	6,0704%	6,0704%	NC	
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 34.773.787,02	R\$ 34.689.142,21	8,8078	(1,8618)	(0,2434)	6,5221%	6,5221%	17,4102%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 55.430.060,37	R\$ 54.991.135,02	9,8800	(1,5995)	(0,7900)	7,2683%	7,2683%	NC	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.595.550,86	R\$ 2.571.658,72	8,2878	(1,4913)	0,9205	7,6549%	7,6549%	NC	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ -	R\$ 16.942.267,59	-	-	0,1766	0,1766%	0,1766%	NC	
SAFRA S&P REAIS	R\$ 5.002.378,42	R\$ 5.101.237,05	7,5889	3,3828	1,9762	13,4265%	13,4265%	NC	
SAFRA PREMIUM MULTMERCADO	R\$ 5.227.907,23	R\$ 5.240.330,80	0,8706	0,3009	0,2371	1,4140%	1,4140%	NC	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 58.941.920,87	R\$ 67.549.649,33	12,3200	(1,9700)	(0,8100)	9,2154%	9,2154%	NC	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 35.146.441,19	R\$ 34.646.766,23	7,6200	(1,8562)	1,4219	7,1243%	7,1243%	NC	
TOTAL	R\$ 221.943.419,82	R\$ 246.604.328,41							
TOTAL GERAL	R\$ 3.519.674.899,78	R\$ 3.574.906.145,05							

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.

Relatório de Investimentos março de 2019

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	jan/19	fev/19	mar/19
BRADESCO	R\$ 654.663.980,36	R\$ 656.249.588,37	R\$ 559.049.906,12
CAIXA	R\$ 1.108.111.510,24	R\$ 1.120.823.380,91	R\$ 1.134.294.399,06
BANCO DO BRASIL	R\$ 1.059.475.966,68	R\$ 1.072.367.127,23	R\$ 1.078.221.775,36
ITAÚ	R\$ 276.374.819,23	R\$ 287.557.091,72	R\$ 410.992.604,10
SANTANDER	R\$ 277.745.616,61	R\$ 278.359.063,84	R\$ 279.809.477,00
SAFRA	R\$ 10.050.919,52	R\$ 10.230.285,65	R\$ 10.341.567,85
BEM DTVM	R\$ 37.197.062,14	R\$ 58.941.920,87	R\$ 67.549.649,33
BTG PACTUAL	R\$ 35.811.160,13	R\$ 35.146.441,19	R\$ 34.646.766,23
TOTAL	R\$ 3.459.431.034,91	R\$ 3.519.674.899,78	R\$ 3.574.906.145,05

Quadro 2

Nota 1: O fundo ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA é administrado pela instituição BEM DTVM S/A, o quadro acima registra o total de recursos por instituição administradora de recursos, de forma que a informação já foi ajustada.

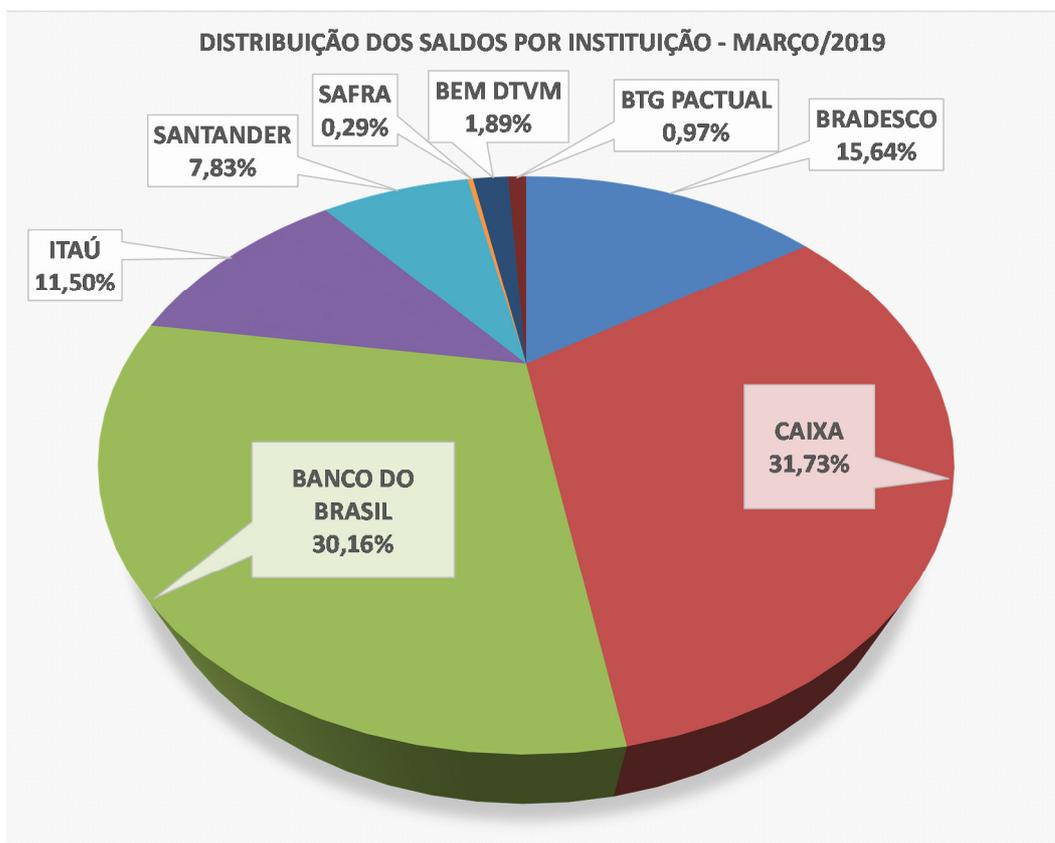


Gráfico 1

Relatório de Investimentos março de 2019

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 MAXI PODER PUBLICO SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	CDI	R\$ 577.332.345,60	16,15%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIM LP SAFRA CART PREMIUM MM SAFRA S&P REAIS ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA I RF FIC FI	CDI ATIVO	R\$ 606.255.753,73	16,96%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF BB PREVID RF IRF M1	IRF M 1	R\$ 443.497.998,40	12,41%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 883.141.981,42	24,70%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 540.073.974,77	15,11%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP BB PREVID RF IMA B5+	IMA B 5+	R\$ 185.059.244,52	5,18%
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\$ 119.032.283,87	3,33%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA BTG ABSOLUTO FIQ FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	IBOVESPA	R\$ 220.512.562,74	6,17%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 3.574.906.145,05	100%

Quadro 3

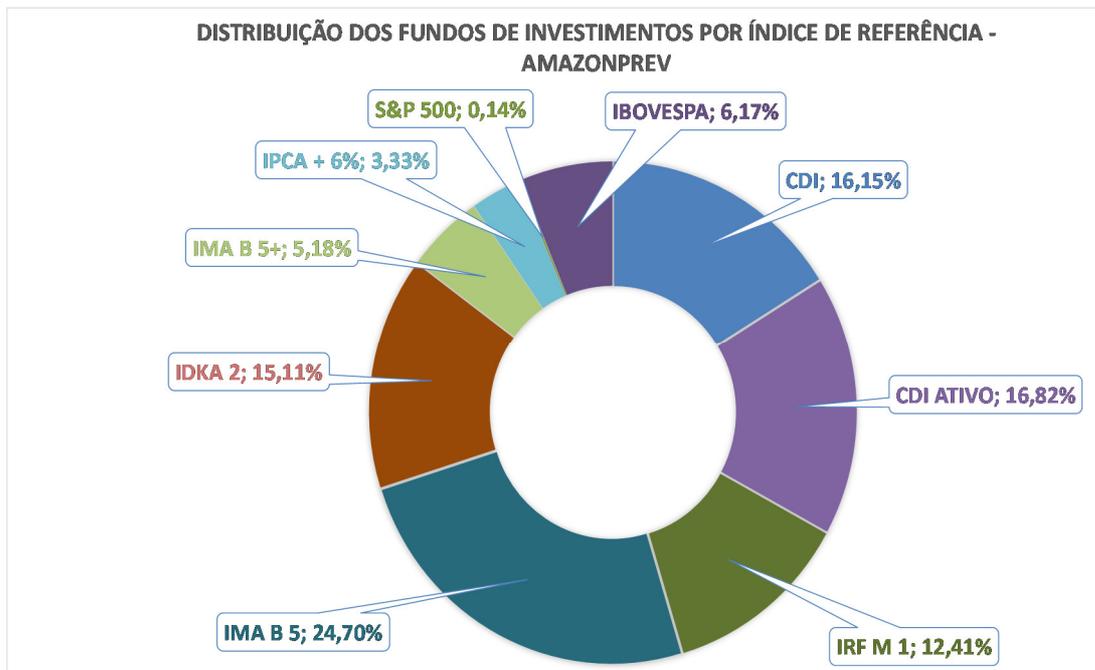


Gráfico 2

Relatório de Investimentos março de 2019

2.4 COMPARATIVO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA

ÍNDICE	mar/19	ACUMULADO 2019	12 MESES
CDI	0,4700%	1,5100%	6,3400%
IMA-B 5	0,7845%	2,8952%	9,1912%
IMA-B	0,5799%	5,5450%	13,7092%
IMA B 5+	0,4317%	7,6600%	17,2834%
IRF M 1	0,4720%	1,5259%	6,6847%
IDKA 2	0,6702%	2,4797%	9,1875%
IBOVESPA	-0,1800%	8,5600%	11,7700%

Quadro 4

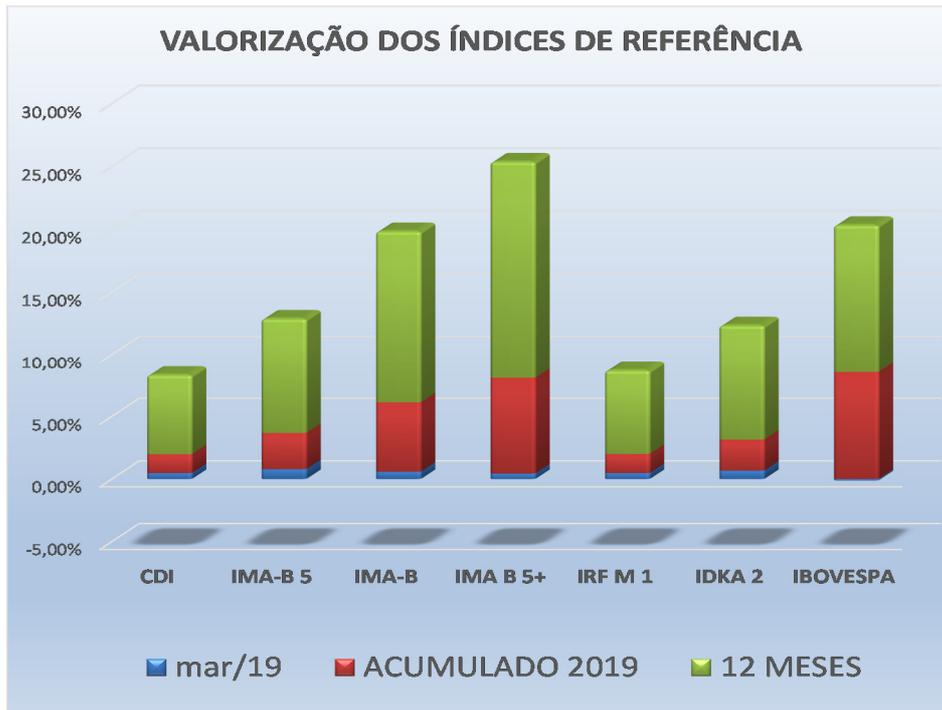


Gráfico 3.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 147.629.782,49	R\$ 149.517.274,41	0,8463	0,9569	1,2785	3,1129%	3,1129%	8,6203%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 149.176.941,30	R\$ 151.098.372,15	0,8557	0,9663	1,2880	3,1419%	3,1419%	7,9332%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 151.916.910,31	R\$ 153.909.696,83	0,8794	0,9900	1,3118	3,2144%	3,2144%	8,3147%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 154.483.540,07	R\$ 156.473.345,50	0,8557	0,9663	1,2880	3,1420%	3,1420%	7,3551%
TOTAL GERAL	R\$ 603.207.174,17	R\$ 610.998.688,89						

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).

Relatório de Investimentos março de 2019

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
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\$ 149.517.274,41	R\$ 151.098.372,15	R\$ 153.909.696,83	R\$ 156.473.345,50
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	
	31/01/2019	28/02/2019
CVS - A	R\$ 1.658.879,14	R\$ 1.641.425,82
CVS - B	R\$ 10.734.491,90	R\$ 10.621.514,10
CVS - C	R\$ 215.193,16	R\$ 212.929,08
CVS - D	R\$ 1.177.179,96	R\$ 1.164.790,44
TOTAL	R\$ 13.785.744,16	R\$ 13.640.659,44

Quadro 7

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/19	R\$ 40.326,42	R\$ 145.084,72	R\$ 185.411,14
fev/19	R\$ 39.906,45	R\$ 145.084,72	R\$ 184.991,17
TOTAL	R\$ 80.232,87	R\$ 290.169,44	R\$ 370.402,31

Quadro 8

2.9 CONTROLE DE RECEBIMENTO DE ALUGUEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2019				TOTAL
MÊS	UEA	SEAS		
jan/19	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
fev/19	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
mar/19	R\$ 116.361,92	R\$ 267.638,40	R\$ 384.000,32	
TOTAL	R\$ 116.361,92	R\$ 267.638,40	R\$ 384.000,32	

Nota 1: Recebido no dia 18.03.19 o pagtº de 2 (duas) parcelas da UEA ref. aos meses de jan e fev/19.

Nota 2: Recebido no dia 26.03.19 o pagtº de 2 (duas) parcelas da SEAS ref. aos meses de jan e fev/19.

Quadro 9

Relatório de Investimentos março de 2019

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)

Referência: Contrato nº 017/2011 - 6º aditivo E 7º Aditivo parcela mensal R\$ 53.422,83
 CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - UEA Valor Global: 641.073,96

CONTRATO	DATA PAGAMENTO	PARCELA	DOC. OB	COMP	vencimento	VALOR	SITUAÇÃO
6º ADITIVO	26/09/16	PARC 01/12	4202	abr/16	31/05/2016	R\$ 53.422,83	pago
6º ADITIVO	26/09/16	PARC 02/12	4203	mai/16	30/06/2016	R\$ 53.422,83	pago
6º ADITIVO	26/09/16	PARC 03/12	4204	jun/16	31/07/2016	R\$ 53.422,83	pago
6º ADITIVO	26/09/16	PARC 04/12	4205	jul/16	31/08/2016	R\$ 53.422,83	pago
6º ADITIVO	11/11/16	PARC 05/12	4649	ago/16	30/09/2016	R\$ 53.422,83	pago
6º ADITIVO	11/11/16	PARC 06/12	4650	set/16	31/10/2016	R\$ 53.422,83	pago
7º ADITIVO	09/02/17	PARC 07/12	507	out/16	30/11/2016	R\$ 40.067,12	pago
7º ADITIVO	09/02/17	PARC 08/12	506	nov/16	31/12/2016	R\$ 40.067,12	pago
7º ADITIVO		PARC 09/12		dez/16	31/01/2017	R\$ 40.067,12	pendente
7º ADITIVO	25/04/17	PARC 10/12	1620	jan/17	28/02/2017	R\$ 40.067,12	pago
7º ADITIVO	06/06/17	PARC 11/12	2638	fev/17	31/03/2017	R\$ 40.067,12	pago
7º ADITIVO	06/06/17	PARC 12/12	2647	mar/17	30/04/2017	R\$ 40.067,12	pago
TOTAL						R\$ 560.939,70	

Referência: Contrato nº 06/2017 parcela mensal R\$ 53.422,83
 CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - UEA Valor Global: 641.073,96

CONTRATO	DATA PAGAMENTO	PARCELA	DOC. OB	COMP	vencimento	VALOR	SITUAÇÃO
06/2017		PARC 1/12		abr/17	30/05/2017	R\$ 53.422,83	pendente
06/2017	22/07/17	PARC 2/12	4586	mai/17	30/06/2017	R\$ 53.422,83	PAGO
06/2017	11/08/17	PARC 03/12	5156	jun/17	30/07/2017	R\$ 53.422,83	PAGO
06/2017	04/09/17	PARC 04/12	5658	jul/17	30/08/2017	R\$ 53.422,83	PAGO
06/2017	04/09/17	PARC 05/12	5668	ago/17	30/09/2017	R\$ 53.422,83	PAGO
06/2017	18/12/17	PARC 06/12	7271	set/17	30/10/2017	R\$ 53.422,83	PAGO
06/2017	18/12/17	PARC 07/12	7270	out/17	30/11/2017	R\$ 53.422,83	PAGO
06/2017	18/12/17	PARC 08/12	7272	nov/17	30/12/2017	R\$ 53.422,83	PAGO
06/2017	18/12/17	PARC 09/12	7310	dez/17	30/01/2018	R\$ 53.422,83	PAGO
06/2017	05/03/18	PARC 10/12	11474	jan/18	28/02/2018	R\$ 53.422,83	PAGO
06/2017	24/04/18	PARC 11/12	27026	fev/18	30/03/2018	R\$ 53.422,83	PAGO
06/2017	24/04/18	PARC 12/12	27045	mar/18	30/04/2018	R\$ 53.422,83	PAGO
TOTAL						R\$ 641.073,96	

CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - UEA

CONTRATO	DATA PAGAMENTO	PARCELA	DOC. OB	COMP	vencimento	VALOR	SITUAÇÃO
SEM CONTRATO				abr/18	30/05/2018	R\$ 53.422,83	pendente
SEM CONTRATO				mai/18	30/06/2018	R\$ 53.422,83	pendente
SEM CONTRATO				jun/18	30/07/2018	R\$ 53.422,83	pendente
SEM CONTRATO				jul/18	30/08/2018	R\$ 53.422,83	pendente
SEM CONTRATO				ago/18	30/09/2018	R\$ 53.422,83	pendente
SEM CONTRATO				set/18	10 dias	R\$ 17.807,61	pendente
TOTAL						R\$ 284.921,76	

Quadro 10

Relatório de Investimentos março de 2019

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

CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - UEA - CONTRATO 27/2018

parcela mensal R\$ 58.180,96

CONTRATO	DATA PAGAMENTO	PARCELA	DOC. OB	COMP	vencimento	VALOR	SITUAÇÃO
27/2018	21/12/2018	1/12	5134	set/18	20 dias	R\$ 38.787,31	PAGO
27/2018	21/12/2018	2/12	5136	out/18	30/11/2018	R\$ 58.180,96	PAGO
27/2018	21/12/2018	3/12	5137	nov/18	30/12/2018	R\$ 58.180,96	PAGO
27/2018	21/12/2018	4/12	5138	dez/18	30/12/2018	R\$ 58.180,96	PAGO
27/2018		5/12		jan/19	30/12/2018	R\$ 58.180,96	PENDENTE
27/2018		6/12		fev/19	30/12/2018	R\$ 58.180,96	
27/2018		7/12		mar/19	30/12/2018	R\$ 58.180,96	
27/2018		8/12		abr/19	30/12/2018	R\$ 58.180,96	
27/2018		9/12		mai/19	30/01/2019	R\$ 58.180,96	
27/2018		10/12		jun/19	28/02/2019	R\$ 58.180,96	
27/2018		11/12		jul/19	30/03/2019	R\$ 58.180,96	
27/2018		12/12		ago/19	30/04/2019	R\$ 58.180,96	
TOTAL						R\$ 678.777,87	

OBS: O VALOR DA DIVIDA PRINCIPAL, ATÉ 31/01/19, ESTÁ NO VALOR DE R\$ 436.592,67

Quadro 11

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			9 DIAS	mar/16	1 PARCIAL	R\$ 48.240,00
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12	30147	06/07/17	PAGO 21 DIAS	mar/16	2 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

Relatório de Investimentos março de 2019

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	10/11/2017	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	94277	05/12/18	PAGO	set/18	10/10/2018	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	8/12	94278	05/12/18	PAGO	out/18	10/11/2018	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	9/12	2060	18/12/18	PAGO	nov/18	10/12/2018	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	10/12	7114	26/12/18	PAGO	dez/18	10/01/2019	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	11/12				jan/19	10/02/2019	R\$ 133.819,20

*Nota: o valor da dívida principal, até 31/01/19, está no valor de

1.712.058,72

* 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.

Quadro 12

Fonte: GERAF/COMAP.

IMÓVEIS DO COMPLEXO IPIXUNA E DUQUE DE CAXIAS. 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 da 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 GERAF 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. Recebido nova proposta atualizada para os serviços, sendo encaminhados os processos para GEJUR para elaboração de parecer. A GEJUR informa que diante da impossibilidade de contratar por dispensa empresa de corretagem de imóveis, sinalizou com a opção de se fazer um processo de credenciamento. A COMAP está elaborando parecer com sugestões referente aos imóveis do Complexo Ipixuna. Parecer nº 3725/2018 retornou da GERAF para ajustes e posterior deliberação do CODIR. Aguardando a conclusão do estudo do Controle Interno – CONTRIN para o uso do Complexo Ipixuna. Fonte: GERAF/COMAP.

IMÓVEL NO MUNICÍPIO DE TEFÊ: No mês de novembro/17 houve alteração da LC 30/2001 com inclusão da possibilidade da alienação dos bens imóveis. Em elaboração processo para deliberação da Diretoria para alienação do imóvel. Processo em fase de ajustes pela COMAP para dar prosseguimento aos procedimentos de alienação.

Relatório de Investimentos março de 2019

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. Aguardando avaliação do imóvel para dar prosseguimento no processo. Segundo informações do setor de engenharia da SEINFRA, previsto para novembro/18 a conclusão da avaliação dos imóveis. Recebido em novembro/18 as avaliações dos imóveis para dar continuidade ao processo de alienação do

Imóvel de Tefé. Em fase de elaboração de parecer para ser submetido ao CODIR. Parecer está para ajustes na COMAP e posterior envio à Diretoria. Fonte: GERA/COMAP.

LOCAÇÃO DO IMÓVEL SEAS: celebrado o 3º Termo Aditivo ao Contrato nº 02/2015-SEAS com vigência até 09/03/2019. Em negociação para celebração do Termo de Confissão de Dívida dos valores em aberto. Encaminhado o ofício nº 3862 /2018 solicitando o pagamento referente ao mês de novembro de 2018. Encaminhado o Ofício nº. 4193 /2018 solicitando o pagamento do mês de dezembro/18. Encaminhado o Ofício nº. 245 /2019 solicitando o pagamento do mês de janeiro /19. Encaminhado o Ofício nº. 760 /2019 solicitando o pagamento do mês de fevereiro/19. Encaminhado o Ofício nº. 1196 /2019 solicitando o pagamento do mês de março/19. Encaminhado o Ofício nº. 1263/2019 reiterando a solicitação para celebração do termo de confissão de dívida Fonte: GERA/COMAP.

LOCAÇÃO DO IMÓVEL UEA: celebrado o novo Termo de Contrato nº 27/2018 com vigência, partir de setembro de 2018. Encaminhado o Ofício nº. 3443 /2018 com os valores para compor Termo de Confissão de Dívida, com todas as parcelas vencidas, até dia 10/09/2018, (dezembro/16, abril/17, abril/18, maio/18, junho/18, julho/18, agosto/18 e 10 dias de setembro/18. Encaminhado os Ofícios nº. 4209 /2018, nº. 4210 /2018, nº. 4211 /2018 e nº. 4212/2018 solicitando o pagamento dos meses de setembro a dezembro de 2018, respectivamente. Encaminhado o Ofício nº. 759 /2019 solicitando o pagamento do mês de fevereiro/2019. Encaminhado o Ofício nº. 1195/2019 solicitando o pagamento do mês de março/19. Encaminhado o Ofício nº. 1262/2019 reiterando a solicitação para celebração do termo de confissão de dívida. 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

Relatório de Investimentos março de 2019

2.13 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	28/02/2019	29/03/2019
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.519.674.899,78	R\$ 3.574.906.145,05
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 603.207.174,17	R\$ 610.998.688,89
TÍTULOS CVS	R\$ 13.640.659,44	R\$ 13.640.659,44
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00	R\$ 62.060.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 39.439,91	R\$ 9.004.710,95
TOTAL	R\$ 4.198.622.173,30	R\$ 4.270.610.204,33

Quadro 14

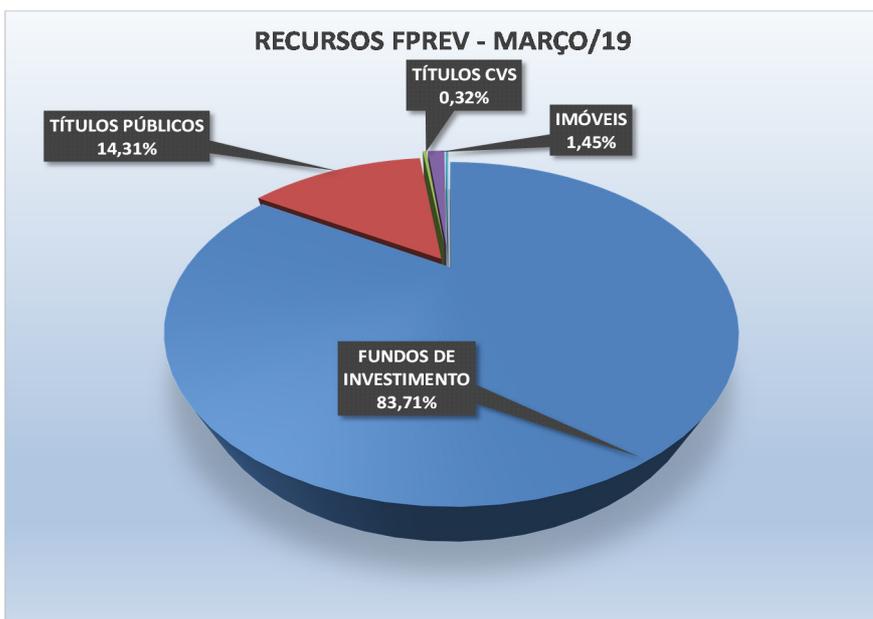


Gráfico 4

2.14 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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%
out/18	R\$ 3.892.701.887,62	2,55%	16,21%	19,68%
nov/18	R\$ 3.938.714.727,46	1,18%	17,59%	19,70%
dez/18	R\$ 4.052.222.964,81	2,88%	20,98%	20,98%
jan/19	R\$ 4.144.928.828,18	2,29%	2,29%	20,76%
fev/19	R\$ 4.198.622.173,30	1,30%	3,61%	20,77%
mar/19	R\$ 4.270.610.204,33	1,71%	5,39%	20,79%

Quadro 15

Relatório de Investimentos março de 2019

2.15 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO

PERÍODO	TAXA
março/18	0,09%
fevereiro/19	0,43%
março/19	0,75%
Acumulado no ano de 2019	1,51%
Acumulado nos últimos 12 meses	4,58%
Meta Atuarial no mês	1,2404%

Quadro 16

DESCRIÇÃO	MARÇO/19	ACUMULADO 2019	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2005 - 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	0,5921%	2,7604%	8,5594%	437,3332%
META ATUARIAL	1,2404%	2,9965%	10,8499%	395,0210%
RESULTADO ATUARIAL	-0,6404%	-0,2292%	-2,0663%	8,5475%

Quadro 17

Nota: Rentabilidade validada pelo atuário.

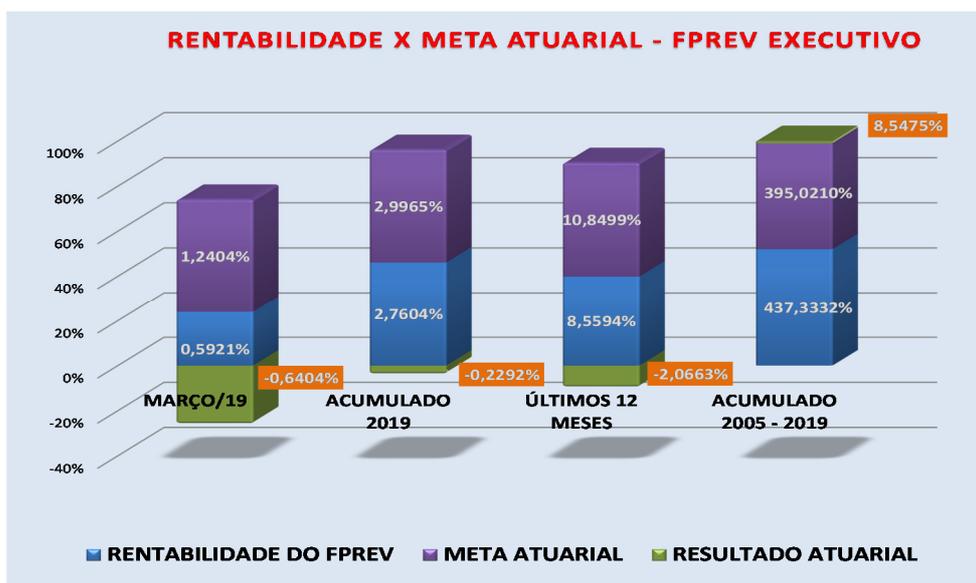


Gráfico 5

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRASESCO FI REF. FEDERAL EXTRA	R\$ 3.518.721,13	R\$ -	0,5274	0,4800	0,0717	1,0824%	1,0824%	NC	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 2.322.453,05	R\$ 4.102.108,44	2,8809	0,5013	0,5446	3,9598%	3,9598%	NC	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃ DINÂMICA II	R\$ 2.324.413,13	R\$ 4.095.561,73	2,3732	0,3396	0,3909	3,1223%	3,1223%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 112.177,01							
TOTAL	R\$ 8.165.587,31	R\$ 8.309.847,18							

Quadro 18

Relatório de Investimentos março de 2019

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.035.947,67	R\$ 2.062.171,11	0,8557	0,9663	1,2880	3,1419%	3,1419%	7,9332%
TOTAL GERAL	R\$ 2.035.947,67	R\$ 2.062.171,11						

Quadro 19.

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS - ALE FPREV	jan/19	fev/19	mar/19
SALDO ANTERIOR	9.650.491,60	10.037.031,39	10.201.534,98
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	239.632,65	108.995,35	112.177,01
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	146.907,14	55.508,24	58.306,30
SALDO FINAL	10.037.031,39	10.201.534,98	10.372.018,29

Quadro 20

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS FPREV ALE	SALDO	
	28/02/2019	29/03/2019
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 8.165.587,31	R\$ 8.197.670,17
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.035.947,67	R\$ 2.062.171,11
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 112.177,01
TOTAL	R\$ 10.201.534,98	R\$ 10.372.018,29

Quadro 21

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
fev/18	R\$ 7.911.489,25	1,63%	4,45%	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\$ 8.992.274,76	3,91%	18,72%	24,11%
out/18	R\$ 9.012.136,46	0,22%	18,98%	22,63%
nov/18	R\$ 9.198.813,51	2,07%	21,44%	25,17%
dez/18	R\$ 9.650.491,60	4,91%	27,41%	27,41%
jan/19	R\$ 10.037.031,39	4,01%	4,01%	28,94%
fev/19	R\$ 10.201.534,98	1,64%	5,71%	28,95%
mar/19	R\$ 10.372.018,29	1,67%	7,48%	28,87%

Quadro 22

Relatório de Investimentos março de 2019

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

DESCRIÇÃO	MARÇO/19	ACUMULADO 2019	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2012 - 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	0,6027%	2,6804%	7,6801%	131,243233%
META ATUARIAL	1,2404%	2,9965%	10,8499%	127,977845%
RESULTADO ATUARIAL	-0,6299%	-0,3069%	-2,8595%	1,432327%

Quadro 23

4. RECURSOS DO MPE e DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FI REF DI PREMIUM	R\$ 100.366.428,07	R\$ 100.835.610,35	0,5336	0,4841	0,4700	1,4950%	1,4950%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 100.366.428,07	R\$ 100.835.610,35						

Quadro 24.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

DESCRIÇÃO	MARÇO/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	0,4675%	1,4925%
META ATUARIAL	1,2404%	2,9965%
RESULTADO ATUARIAL	-0,7634%	-1,4602%

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.

4.3 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos –DPE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FEDERAL EXTRA REF DI	R\$ 3.077.433,76	R\$ 3.721.235,02	0,5274	0,4792	0,4537	1,4675%	1,4675%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 3.077.433,76	R\$ 3.721.235,02						

Quadro 26

4.4 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

DESCRIÇÃO	MARÇO/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	0,5193%	1,5751%
META ATUARIAL	1,2404%	2,9965%
RESULTADO ATUARIAL	-0,7123%	-1,3800%

Quadro 27

Relatório de Investimentos março de 2019

5. CONSOLIDADO – FPREV

5.1 Evolução dos Recursos Consolidados – FPREV.

ANO	ALE FPREV	EXEC. FPREV	MPE FPREV	DPE 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\$ 9.650.491,60	R\$ 4.052.222.964,81	R\$ 99.352.766,72	R\$ 2.441.450,05	R\$ 4.163.667.673,17
2019	R\$ 10.372.018,29	R\$ 4.270.610.204,33	R\$ 100.835.610,35	R\$ 3.721.235,02	R\$ 4.385.539.067,99

Quadro 28

5.2 Resumo da rentabilidade 2019 – FPREV.

Mês	Receitas	Despesas	Saldo	Patrimônio	Ganhos
				4.163.667.673,17	Financeiros
jan/19	25.980.772,80	1.624.312,33	24.356.460,47	4.257.303.053,36	69.278.919,72
fev/19	36.824.540,83	1.577.166,50	35.247.374,33	4.312.267.570,11	19.717.142,42
mar/19	49.517.522,09	1.653.421,67	47.864.100,42	4.385.539.067,99	25.407.397,46
abr/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
mai/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
jun/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
jul/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
ago/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
set/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
out/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
nov/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
dez/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Meta				3,00%	114.403.459,60
Rentabilidade				2,73%	
Resultado				-0,26%	

Quadro 29. Validado pelo atuário.

6. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

6.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Investimentos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.121.974,62	R\$ 20.246.443,06	0,5189	0,4714	0,4461	1,4433%	1,4433%	6,0589%
BRADESCO FI RF IRF MI TP - COMPREV	R\$ 8.275.944,42	R\$ 8.308.002,42	0,5569	0,4456	0,4498	1,4592%	1,4592%	6,4200%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 100,00						
TOTAL	R\$ 12.397.920,04	R\$ 28.554.545,48						

Quadro 30

Relatório de Investimentos março de 2019

6.2 Defensoria Pública - FFIN

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FI REF FEDERAL EXTRA	R\$ -	R\$ -	0,4794	-		1,1330%	0,4794%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 22.401,63	R\$ 25.271,76						
TOTAL	R\$ 22.401,63	R\$ 25.271,76						

Quadro 31

Saldos e Performance dos Fundos de Investimentos – ALE FFIN

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 1.016.760,21	-	-	0,4461	0,4461%	0,4461%	0,0000%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ -	R\$ 1.016.760,21						

Quadro 32

6.3 Disponibilidade Financeira – FFIN EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	28/02/2019	29/03/2019
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 140.839,38	R\$ 142.105,98
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 274.121,90	R\$ 720.821,17
REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ 32.789,91

Quadro 33

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, já regularizado.

6.4 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit - FFIN ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	28/02/2019	29/03/2019
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 807.367,68	R\$ 39.554,46
TOTAL	R\$ 807.367,68	R\$ 39.554,46

Quadro34.

6.5 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	jan/19	fev/19	mar/19
SALDO ANTERIOR	R\$ 1.940,70	R\$ 15.064,07	R\$ 807.367,68
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 3.684.769,54	R\$ 3.006.642,93	R\$ 1.623.050,94
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.704.970,41	R\$ 2.109.106,48	R\$ 1.459.425,28
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -
SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$ 5.376.616,58	-R\$ 4.323.445,80	-R\$ 3.850.289,44
SALDO FINAL	R\$ 15.064,07	R\$ 807.367,68	R\$ 39.554,46

Quadro 35

7. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

7.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.106.379,64	R\$ 1.430.742,83	0,5189	0,4714	0,4461	1,4433%	1,4433%	6,0590%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 43.495.057,27	R\$ 43.688.123,48	0,5679	0,4477	0,4439	1,4666%	1,4666%	6,5046%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 44.601.437,91	R\$ 45.118.867,31						

Quadro 36

Relatório de Investimentos março de 2019

7.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 431.228,05	R\$ 433.193,53	0,5189	0,4714	0,4537	1,4509%	1,4509%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 431.228,05	R\$ 433.193,53						

Quadro 37

8. RECURSOS DOS OUTROS PODERES – TJA E TCE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO IRF MI - TJA	R\$ 111.390.391,57	R\$ 116.938.205,43	0,5569	0,4456	0,4498	1,4592%	1,4592%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 143.160.030,06	R\$ 143.795.489,85	0,5679	0,4477	0,4439	1,4665%	1,4665%	6,5046%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 137.983.260,60	R\$ 138.588.201,01	0,5753	0,4388	0,4384	1,4595%	1,4595%	6,4475%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 3.023.239,31	R\$ 147.297,40						
TOTAL	R\$ 395.556.921,54	R\$ 399.469.193,69						

Quadro 38

8.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	jan/19	fev/19	mar/19
SALDO ANTERIOR	385.358.674,15	390.798.649,50	395.556.921,54
REPASSES FINANCEIROS	3.400.607,98	3.171.654,71	2.153.952,38
VARIAÇÃO FINANCEIRA	2.187.782,77	1.735.032,73	1.905.617,17
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(148.415,40)	(148.415,40)	(147.297,40)
SALDO FINAL	R\$ 390.798.649,50	R\$ 395.556.921,54	R\$ 399.469.193,69

Quadro 39

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

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	28/02/2019	29/03/2019	jan/19	fev/19	mar/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO IRF MI - TCE	R\$ 47.534.833,80	R\$ 49.247.887,56	0,5569	0,4456	0,4498	1,4592%	1,4592%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 56.732.176,37	R\$ 56.983.999,60	0,5679	0,4477	0,4439	1,4665%	1,4665%	6,5046%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 55.127.009,79	R\$ 55.368.695,31	0,5753	0,4388	0,4384	1,4595%	1,4595%	6,4475%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 766.970,49	R\$ 167.496,42						
TOTAL	R\$ 160.160.990,45	R\$ 161.768.078,89						

Quadro 40

8.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	jan/19	fev/19	mar/19
SALDO ANTERIOR	157.043.146,18	158.706.894,80	160.160.990,45
REPASSES FINANCEIROS	902.592,16	941.692,02	894.800,93
VARIAÇÃO FINANCEIRA	890.692,90	703.669,42	879.783,93
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(129.536,44)	(191.265,79)	(167.496,42)
SALDO FINAL	R\$ 158.706.894,80	R\$ 160.160.990,45	R\$ 161.768.078,89

Quadro 41

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 março de 2019

9. ENQUADRAMENTO

9.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2019	LIMITE DA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
TÍTULOS DO TN	R\$ 613.060.860,00	12,38%	11,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	R\$ 592.980.755,04				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 18.911.588,83				
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 9.084.817,38				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 111.127.535,66				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 540.073.974,77				
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 166.088.292,20	55,00%	50,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BRADESCO FI RF IRFM I TP	R\$ 174.494.095,41				
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	R\$ 288.941.752,61				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 656.304.086,11				
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 73.931.708,86				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.363.048,46				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 47.672.829,20				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 22.693.946,10				
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 4.154.428,55				
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 599.135.913,36				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.749.603,11	27,36%	40%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II	R\$ 240.506.534,07				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC FI	R\$ 100.076.570,43				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 247.778.553,73				
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 79.132.042,59				
TÍTULOS CVS	R\$ 13.640.659,44	0,28%	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	-	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.703.903.595,91	95,02%			

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2019	LIMITE DA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 54.991.135,02				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.677.323,54				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.571.658,72	4,34%	8%	20%	art. 8º, inciso II, "a"
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 16.942.267,59				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 67.549.649,33				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 34.646.766,23				
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 34.689.142,21				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 5.101.237,05				
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.444.620,10	0,64%	3%	10%	art. 8º, inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.240.330,80				
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.750.197,82				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 246.604.328,41	4,98%			

TOTAL GERAL DA CARTEIRA	R\$ 4.950.507.924,32	100,00%			
--------------------------------	-----------------------------	----------------	--	--	--

Quadro 42

Relatório de Investimentos março de 2019

9.2 Enquadramento II – Limites Gerais – art. 13º - Res. CMN 3922/10

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Res. nº . 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 592.980.755,04	11,98%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 18.911.588,83	0,38%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 9.084.817,38	0,18%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 111.127.535,66	2,24%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 540.073.974,77	10,91%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 166.088.292,20	3,35%	
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 174.494.095,41	3,52%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 288.941.752,61	5,84%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 656.304.086,11	13,26%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 73.931.708,86	1,49%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.363.048,46	0,88%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 47.672.829,20	0,96%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 22.693.946,10	0,46%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 4.154.428,55	0,08%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 599.135.913,36	12,10%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.749.603,11	1,23%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II	R\$ 240.506.534,07	4,86%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC FI	R\$ 100.076.570,43	2,02%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 247.778.553,73	5,01%	
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 79.132.042,59	1,60%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 54.991.135,02	1,11%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 16.942.267,59	0,34%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.677.323,54	0,07%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.571.658,72	0,05%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 67.549.649,33	1,36%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 34.646.766,23	0,70%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 34.689.142,21	0,70%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 5.101.237,05	0,10%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.444.620,10	0,11%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.240.330,80	0,11%	
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.750.197,82	0,32%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 4.323.806.404,88		
TOTAL DOS RECURSOS DO RPPS	R\$ 4.950.507.924,32		

Quadro 43

Nota: Enquadramento II Limite por fundo de Investimento - Art. 13. As aplicações em cotas de um mesmo fundo de investimento não podem exceder a 20% (vinte por cento) das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social.

Relatório de Investimentos março de 2019

9.3 Enquadramento III – Limites Gerais – art. 14º - Res. CMN 3922/10

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Res. n° 3.922/2010 atualizada pela Res. n° 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 592.980.755,04	10.181.411.879,74	5,82%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 18.911.588,83	658.743.010,56	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX - 15/08/2018	R\$ 9.084.817,38	115.283.048,48	7,88%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 111.127.535,66	1.460.761.923,79	7,61%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 540.073.974,77	7.065.416.524,02	7,64%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 166.088.292,20	1.303.513.436,22	12,74%	
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 174.494.095,41	1.288.250.914,24	13,55%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 288.941.752,61	15.289.754.586,12	1,89%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 656.304.086,11	9.063.168.823,86	7,24%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 73.931.708,86	1.787.394.613,51	4,14%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.363.048,46	253.890.273,53	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 47.672.829,20	194.551.918,98	24,50%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 22.693.946,10	337.170.583,09	6,73%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 4.154.428,55	6.882.839.151,15	0,06%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 599.135.913,36	7.139.076.176,08	8,39%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.749.603,11	657.710.238,08	9,24%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II	R\$ 240.506.534,07	2.885.249.673,01	8,34%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC FI	R\$ 100.076.570,43	1.275.120.676,99	7,85%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 247.778.553,73	4.443.179.516,96	5,58%	
SANTANDER FIC INST. REF DI	R\$ 79.132.042,59	4.811.886.716,20	1,64%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 54.991.135,02	908.559.424,87	6,05%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.677.323,54	61.507.531,22	5,98%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.571.658,72	1.364.027.993,30	0,19%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 16.942.267,59	1.105.442.852,71	1,53%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 67.549.649,33	477.925.158,59	14,13%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 34.646.766,23	903.663.757,93	3,83%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 34.689.142,21	628.242.667,76	5,52%	
TOTAL	R\$ 4.292.270.019,11			

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\$ 15.750.197,82	445.016.794,96	3,54%	5%
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.444.620,10	271.216.204,76	2,01%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 5.101.237,05	360.386.681,09	1,42%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.240.330,80	1.959.561.124,05	0,27%	
TOTAL	R\$ 31.536.385,77			

TOTAL	R\$ 4.323.806.404,88
--------------	-----------------------------

Quadro 44

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

Relatório de Investimentos março de 2019

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.

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA FEV/19) 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\$ 971.006,53	R\$ 1.272.178.671,68	0,1310%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 678.191,45	R\$ 415.088.165,83	0,0612%	
BRADESCO	R\$ 594.300,61	R\$ 861.227.986,53	0,1449%	
CAIXA	R\$ 341.611,82	R\$ 1.382.864.120,43	0,4048%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	R\$ 258.294,70	R\$ 279.909.477,00	0,1084%	
BANCO BTG	R\$ 97.602,77	R\$ 34.646.766,23	0,0355%	
BANCO SAFRA	R\$ 96.209,75	R\$ 10.341.567,85	0,0107%	
ICATÚ	R\$ 20.061,97	R\$ 67.549.649,33	0,3367%	

Quadro 45

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 março de 2019

10. TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO FPREV - EXECUTIVO	R\$ 3.575.006.145,05
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 610.998.688,89
CVS	R\$ 13.640.659,44
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00
DEFENSORIA PÚBLICA - FPREV	R\$ 3.721.235,02
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 9.004.710,95
TOTAL	R\$ 4.274.431.439,35

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA - ALE FPREV E ALE FFIN

DESCRIÇÃO	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 8.197.670,17
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.062.171,11
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 112.177,01
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 1.016.760,21
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 39.555,46
TOTAL	R\$ 11.428.333,96

MPE FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 100.835.610,35
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
TOTAL	R\$ 100.835.610,35

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

DESCRIÇÃO	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	R\$ 45.118.866,31
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$ 433.193,53
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 20.246.443,06
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 8.308.002,42
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA DPE - FFIN	R\$ 25.271,76
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM.	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - FFIN	R\$ 100,00
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ 720.821,17
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 142.105,98
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ 32.789,91
TOTAL	R\$ 75.027.595,14

OUTROS PODERES

ORGÃOS	SALDO
TJ/AM	R\$ 399.321.896,29
TCE/AM	R\$ 161.600.582,47
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA/TCE	R\$ 314.793,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA - FPREV	R\$ 1.124.231,98
TOTAL	R\$ 562.361.504,56
TOTAL GERAL	5.024.084.483,36

Quadro 46

Relatório de Investimentos março de 2019



Gráfico 6.

Nota: Conforme PPA 2019-2021 o valor projetado para 2019, equivale ao total de R\$ 5.274.918,303.

Sem mais a informar, segue para Superior Consideração.

Respeitosamente,

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Leonardo Cavalcanti
Membro

Renízio Ferreira
Membro

Marcos Souza
Membro-ALE

Bruno Barroso
Membro-ALE