

## **Relatório de Investimentos janeiro de 2018**

---

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 19/02/2018

### **RELATÓRIO N°. 08 / 2018 – COMIV**

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 02 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 04 a 13);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV/ALEAM (páginas 13 a 14);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV Executivo e ALE (página 14);
- 5) Recursos do Fundo Financeiro Executivo – FFIN - (página 15);
- 6) Recursos da Taxa de Administração - (página 15);
- 7) Recursos dos Outros Poderes: Saldo e Composição por órgão – TCE e TJA (página 16);
- 8) Enquadramento das Aplicações Financeiras, com base na legislação vigente (páginas 18 a 20);
- 9) Consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 21 a 23).

## **Relatório de Investimentos janeiro de 2018**

---

### **1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS**

**No Brasil, a atividade econômica registrou expansão em novembro, reforçando o cenário de recuperação da economia.**

O indicador de atividade do Banco Central (IBC-Br) apurou alta de 0,5% em novembro na comparação com outubro, com ajuste sazonal, após avanço de 0,35% em outubro. Na comparação anual, o indicador registrou alta de 2,9%. Ambos os resultados, na margem e anual, ficaram acima das expectativas do mercado, 0,4% e 2,8%, respectivamente para o mês. O avanço em novembro decorreu do crescimento dos setores industrial (0,2%), serviços (1,0%) e do comércio ampliado (2,5%) no mês. Caso o indicador do Banco Central fique estável em dezembro, a economia brasileira encerrará o quarto trimestre com alta de 0,8%, após avanço de 0,5% no trimestre anterior. No acumulado dos últimos 12 meses, o IBC-Br registra alta de 0,7%. Diante os dados mais positivos nos últimos meses, eleva-se a projeção de crescimento do PIB no quarto trimestre para 0,2% de 0,1% projetado anteriormente. Assim, a economia brasileira poderá encerrar o ano com expansão de 1,0%. Para 2018, espera-se a continuidade do processo de recuperação, estimulado pelos efeitos defasados da política monetária. Portanto a economia brasileira pode registrar expansão de 3% em 2018.

**Em termos de dinâmica inflacionária, o IPCA-15 de janeiro apresentou surpresa baixista, subindo 0,39%, abaixo da expectativa do mercado (0,43%).** A abertura mostrou que alimentos aceleraram para 0,76% em relação ao resultado anterior de -0,02%. Esse movimento foi explicado principalmente por itens consumidos em domicílio como tomate, batata e frutas. Outro grupo que também apresentou forte impacto foi Transportes que subiu 0,86%, após alta de 1,16% em dezembro. A principal influência veio de combustíveis que subiram 2,54%, com destaque para a gasolina e etanol. No outro sentido, houve queda do grupo Habitação com -0,41%, devido à deflação nas contas de energia elétrica com a volta da bandeira verde. No acumulado em 12 meses, o indicador acelerou para 3,02% de 2,94% registrado no final do ano passado. Apesar dessa piora marginal, os núcleos ainda mostram uma dinâmica favorável do cenário inflacionário. Serviços desaceleraram para 4,52% e a média dos núcleos está em 3,62%. Para 2018, projeta-se alta de 3,85% do IPCA, mantendo o comportamento benigno do ano passado.

## **Relatório de Investimentos janeiro de 2018**

---

**Nos Estados Unidos, o FED decidiu manter a taxa de juros entre 1% e 1,25% ao ano, em linha com o esperado pelo mercado.** De modo geral, o comunicado trouxe poucas novidades, reforçando a política de gradual aumento na taxa de juros. A respeito da atividade, o FED reforçou que o desempenho da atividade e do mercado de trabalho mantém a solidez dos últimos meses. A respeito da inflação, os membros do comitê pontuaram que o CPI segue abaixo da meta de 2%, embora também tenham destacado que as expectativas de inflação do mercado tiveram aumento recentemente. Por fim, sobre a evolução do cenário, o FED manteve a avaliação de que os riscos seguem balanceados. Vale destacar nessa parte do comunicado, que a menção ao fato da inflação ficar um pouco abaixo da meta de 2% no curto prazo foi substituída pela avaliação de que o CPI irá aumentar nesse ano. Assim, o comunicado da reunião corrobora um cenário de aumento de juros na reunião de março.

**Na Zona do Euro, o BCE sinalizou que pode alterar seu comunicado nas próximas reuniões.** A ata da última reunião do BCE revelou maior confiança dos membros acerca do processo de recuperação da atividade na região. No que concerne aos últimos números de inflação abaixo do esperado, os membros ressaltaram que as surpresas abrangeram questões pontuais. Apesar da confiança no cenário, os integrantes do BCE pontuaram que alguns fatores (tecnologia, globalização, etc.) podem afetar a relação entre atividade e inflação, exigindo cautela na condução da política monetária. Por fim, a grande novidade da ata ficou por conta da menção sobre a possibilidade de alteração gradual do comunicado nas próximas reuniões, caso o cenário continue evoluindo positivamente. Em linha com o cenário, avalia-se que essa interpretação do BCE revelada através da ata reduziu a probabilidade de extensão do programa de compras de título para além de setembro (cronograma atual). Os dados mais recentes de atividade fortalecem esse quadro de não continuidade das compras, sinalizando que a região deverá manter o ritmo de crescimento de 2,5% em 2018.

**Na China, o crescimento econômico acelerou em 2017 e o país superou mais uma vez a meta de crescimento do ano (6,5%).** A economia chinesa cresceu 6,8% no quarto trimestre na comparação anual, e ficou estável frente ao trimestre anterior. O resultado foi ligeiramente acima da expectativa do mercado (6,7%). Com isso, a economia chinesa registrou expansão de 6,9% no ano, após avançar 6,7% em 2016. A aceleração do crescimento deveu-se ao melhor

## **Relatório de Investimentos janeiro de 2018**

---

desempenho do setor industrial, com alta de 6,6% em 2017 após avançar 6,0% em 2016. As vendas no varejo tiveram desempenho semelhante ao ano anterior, com alta de 10,2% frente 10,4% em 2016. Por sua vez, os investimentos em ativos fixos registraram moderação mais acentuada, com avanço de 7,2% em 2017 após crescimento de 8,1% no ano anterior. Para 2018, esperasse que a econômica chinesa deve apresentar moderação no ritmo de crescimento. **Fonte: SÍNTESE ECONÔMICA DE JANEIRO – BRAM.**

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2017	31/01/2018	nov/17	dez/17	jan/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 369.809.302,81	R\$ 371.933.497,23	0,5600	0,5300	0,5742	1,6735%	0,5742%	9,7900%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 225.073.146,92	R\$ 225.136.824,90	0,5600	0,5300	0,5669	1,6661%	0,5669%	9,3500%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 675.606.896,05	R\$ 695.393.443,24	0,5924	0,5678	0,5699	1,1636%	0,5699%	10,1786%
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 71.140.237,70	R\$ 71.897.611,01	0,8200	0,7000	1,0646	2,6066%	1,0646%	8,8000%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 42.186.863,88	R\$ 42.613.700,18	(0,0600)	1,0500	1,0118	2,0112%	1,0118%	12,8300%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 44.503.484,20	R\$ 45.860.257,88	(0,0870)	0,6000	3,0487	3,5768%	3,0487%	14,2600%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ -	R\$ 5.000.000,00	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%
SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	R\$ 247.141.436,85	R\$ 248.581.708,93	0,1392	0,5290	0,5830	1,2558%	0,5830%	NC
BB PREVID RF IRF MI	R\$ 801.696.778,50	R\$ 827.228.143,65	0,5893	0,5587	0,5852	1,7432%	0,5852%	10,1233%
BB PREVID TP VII	R\$ 31.110.172,04	R\$ 31.474.738,26	0,0491	0,7479	1,1718	1,9785%	1,1718%	12,1902%
BB PREVID TP IX	R\$ 8.574.434,23	R\$ 8.663.387,13	0,2136	0,3511	1,0374	1,6087%	1,0374%	10,2213%
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	R\$ 122.579.731,30	R\$ 123.281.345,04	0,5600	0,5300	0,5723	1,6715%	0,5723%	9,3300%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 53.075.785,65	R\$ 53.864.368,18	0,1300	0,8000	1,4858	2,4306%	1,4858%	NC
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.692.498.270,13</b>	<b>R\$ 2.750.929.025,63</b>						

Quadro 1

**Nota:** 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.

#### 2.2 EVOLUÇÃO DOS SALDOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	nov/17	dez/17	jan/18
BRADESCO	R\$ 592.045.540,68	R\$ 594.882.449,73	R\$ 597.070.322,13
CAIXA	R\$ 808.787.814,51	R\$ 833.437.481,83	R\$ 860.765.012,31
BANCO DO BRASIL	R\$ 816.656.460,06	R\$ 841.381.384,77	R\$ 867.366.269,04
ITAÚ	R\$ 174.591.750,29	R\$ 175.655.516,95	R\$ 177.145.713,22
SANTANDER	R\$ 245.840.936,16	R\$ 247.141.436,85	R\$ 248.581.708,93
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.637.922.501,70</b>	<b>R\$ 2.692.498.270,13</b>	<b>R\$ 2.750.929.025,63</b>

Quadro 2

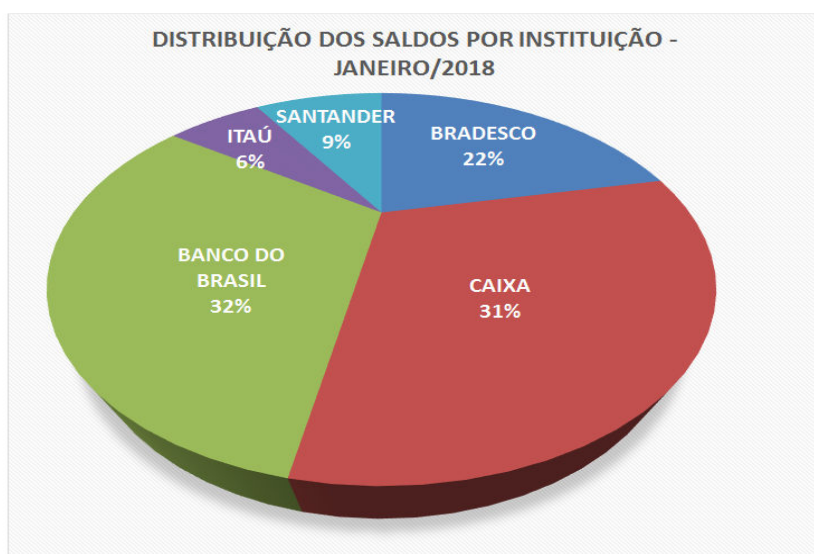


Gráfico 1

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 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 ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	CDI	R\$ 1.094.695.355,29	39,79%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF BB PREVID RF IRF M1	IRF M 1	R\$ 1.522.621.586,89	55,35%
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\$ 128.612.083,45	4,68%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	IBOVESPA	R\$ 5.000.000,00	0,18%
<b>TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO</b>		<b>R\$ 2.750.929.025,63</b>	<b>100%</b>

Quadro 3

### DISTRIBUIÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR ÍNDICE - AMAZONPREV

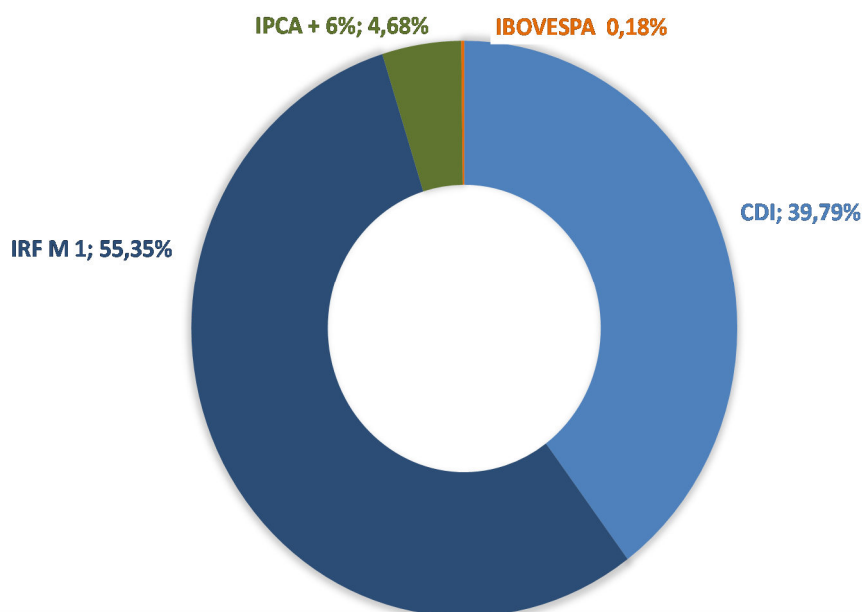


Gráfico 2

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 2.4 COMPARATIVO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA

ÍNDICE	jan/18	ACUMULADO 2018	12 MESES
CDI	0,5800%	0,5800%	9,4000%
IMA-B 5	1,3336%	1,3336%	12,7749%
IMA-B	3,4013%	3,4013%	14,4931%
IMA B 5+	4,9485%	4,9485%	15,7404%
IRF M 1	0,5924%	0,5924%	10,3545%
IBOVESPA	11,1400%	11,1400%	31,3000%

Quadro 4

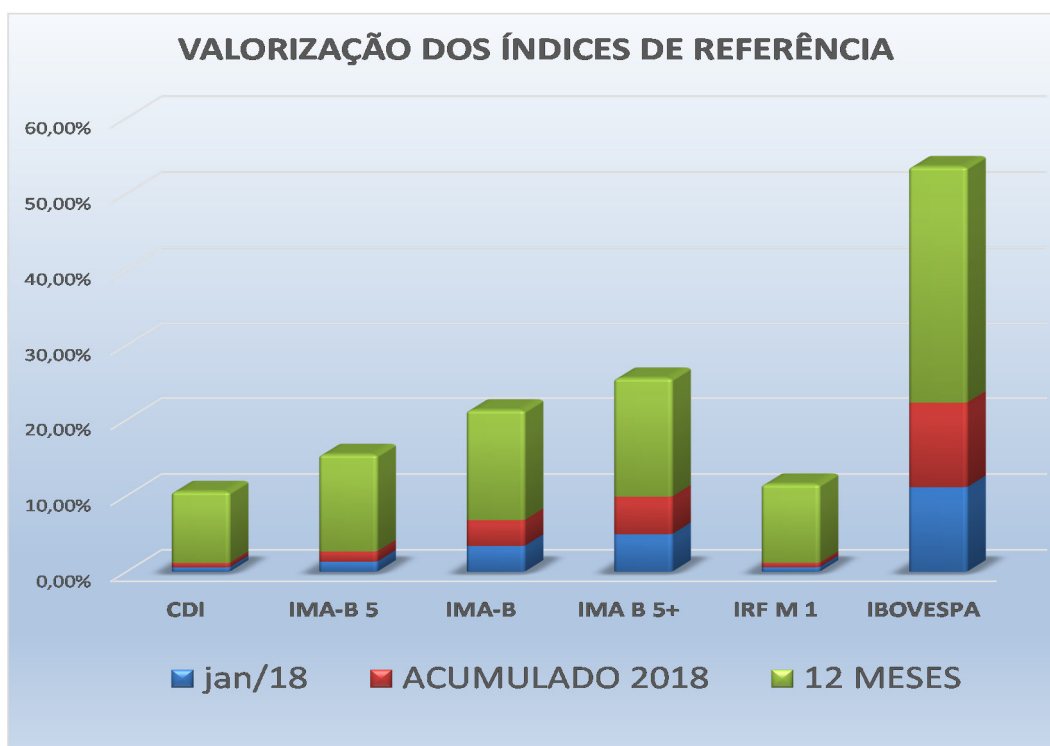


Gráfico 3.

### 2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2017	31/01/2018	nov/17	dez/17	jan/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 138.697.677,52	R\$ 141.744.949,15	(0,2862)	0,9919	4,4291	5,1630%	4,4291	17,4699%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 143.688.125,41	R\$ 150.124.075,84	(0,5397)	0,7912	4,5147	4,7731%	4,5147	16,6169%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 145.880.650,77	R\$ 152.414.806,85	(0,5397)	0,7912	4,4185	4,6767%	4,4185	16,5096%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 148.632.384,43	R\$ 157.132.274,28	(0,5784)	0,9382	5,6654	6,0399%	5,6654	19,5378%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 576.898.838,13</b>	<b>R\$ 601.416.106,11</b>						

Quadro 5

**Nota:** Conforme estabelece o MPS através da Portaria nº. 65/2014, os recursos aplicados pelos RPPS em cotas de fundos de investimento ou em títulos de emissão do Tesouro Nacional, integrantes da carteira própria do RPPS, deverão ser marcados a mercado, no mínimo mensalmente, mediante a

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

utilização de metodologias de apuração consentâneas com os parâmetros reconhecidos pelo mercado financeiro, de forma a refletir o seu valor real, e as normas baixadas pelo Banco Central do Brasil e a Comissão de Valores Mobiliários. Portanto, valores informados estão calculados com base no Preço Médio de Mercado divulgado em 31/01/18 pela Associação Brasileira das Entidades do Mercado Financeiro e de Capitais – ANBIMA.

### 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\$ 3.288,745920	R\$ 3.455,099559	R\$ 3.455,099559	R\$ 3.543,005057
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
<b>VALOR ATUAL</b>	<b>R\$ 141.744.949,15</b>	<b>R\$ 150.124.075,84</b>	<b>R\$ 152.414.806,85</b>	<b>R\$ 157.132.274,28</b>
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%
INSTITUIÇÃO CUSTODIANTE	SELIC	SELIC	SELIC	SELIC

Quadro 6

### 2.7 SALDOS CVS - FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	29/12/2017	31/01/2018
CVS - A	R\$ 1.885.772,30	R\$ 1.868.318,98
CVS - B	R\$ 12.203.088,95	R\$ 12.090.225,50
CVS - C	R\$ 244.626,20	R\$ 242.362,12
CVS - D	R\$ 1.338.231,18	R\$ 1.325.854,20
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 15.671.718,63</b>	<b>R\$ 15.526.760,80</b>

Quadro 7

### 2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/18	R\$ 45.365,76	R\$ 144.957,83	R\$ 190.323,59
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 45.365,76</b>	<b>R\$ 144.957,83</b>	<b>R\$ 190.323,59</b>

Quadro 8



## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 2.9 CONTROLE DE RECEBIMENTO DE ALUGUEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2018			TOTAL
MÊS	UEA	SEAS	
jan/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>

Quadro 9

**Nota:** Não foram recebidos pagamentos ref. a aluguéis no mês de jan/18.

### 2.10 CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - UEA - 2017

**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

### 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\$ 53.422,83**

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

Quadro 11

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

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - SEAS - 2016/2017

Processo Administrativo nº. 018.01777.14-SEAS

Valor Global R\$ 2.141.102,40

1º Aditivo ao Termo de Contrato nº.002/2015-SEAS

Valor Mensal R\$ 178.425,20

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	CRÉDITO	SALDO
mar/16	05/07/17	0030147	R\$ 53.527,68	R\$ 2.087.574,72
abr/16	31/01/17	0004493	R\$ 178.425,60	R\$ 1.909.149,12
mai/16	14/03/17	0009993	R\$ 178.425,60	R\$ 1.730.723,52
jun/16	31/01/17	0004492	R\$ 178.425,60	R\$ 1.552.297,92

Quadro 12

Nota: Atualizado após conciliação junto aos extratos bancários e Sistema AFI.

Fonte: GERAFF

### 2.12 CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - SEAS - 2017/2018

2º Aditivo ao Termo de Contrato nº.002/2015-SEAS

Valor Global R\$ 1.605.830,40

Valor Mensal R\$ 133.819,20

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	CRÉDITO	SALDO
mar/17	07/07/17	0031093	R\$ 124.897,92	R\$ 1.480.932,48
abr/17	02/06/17	0023739	R\$ 133.819,20	R\$ 1.347.113,28
mai/17	05/07/17	0030146	R\$ 133.819,20	R\$ 1.213.294,08
mar/17	10/08/17	0036300	R\$ 92.186,56	R\$ 1.121.107,52
jun/17	01/09/17	0040592	R\$ 133.819,20	R\$ 987.288,32
jul/17	01/09/17	0040593	R\$ 133.819,20	R\$ 853.469,12
ago/17	14/12/17	0053846	R\$ 133.819,20	R\$ 719.649,92
set/17	18/12/17	0054764	R\$ 133.819,20	R\$ 585.830,72

Quadro 13

### CONTROLE - TERMO DE CONFISSÃO DE DÍVIDA - SEAS

Valor Global: R\$ 4.566.330,41

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	VALOR DEVIDO (a)	VALOR RECEBIDO (b)	DIFERENÇA (b-a)	SALDO DEVEDOR
Entrada	28/10/14	0066143	R\$ 180.797,23	R\$ 183.728,15	R\$ 2.930,92	R\$ 4.382.602,26
jan/15	01/04/15	0014147	R\$ 154.905,21	R\$ 151.974,29	R\$ 2.930,92	R\$ 4.230.627,97
fev/15	01/04/15	0014148	R\$ 153.301,63	R\$ 153.301,63	R\$ -	R\$ 4.077.326,34
mar/15	17/04/15	0017173	R\$ 151.698,05	R\$ 151.698,05	R\$ -	R\$ 3.925.628,29
abr/15	28/05/15	0023911	R\$ 150.094,46	R\$ 150.094,46		R\$ 3.775.533,83
mai/15	16/06/15	0026742	R\$ 148.490,88	R\$ 148.490,88		R\$ 3.627.042,95
jun/15	10/07/15	0030543	R\$ 146.887,30	R\$ 146.887,30		R\$ 3.480.155,65
jul/15	10/08/15	0035833	R\$ 145.283,71	R\$ 145.283,71		R\$ 3.334.871,94
ago/15	10/09/15	0041482	R\$ 143.680,13	R\$ 143.680,13		R\$ 3.191.191,81
set/15	24/11/15	0054929	R\$ 142.076,55	R\$ 142.076,55		R\$ 3.049.115,26
out/15	24/11/15	0054930	R\$ 140.472,27	R\$ 140.472,27		R\$ 2.908.642,99
nov/15	21/01/16	0000909	R\$ 138.869,38	R\$ 138.869,38		R\$ 2.769.773,61
dez/15	21/01/16	0000911	R\$ 137.265,80	R\$ 137.265,80		R\$ 2.632.507,81
jan/16	30/05/16	0024970	R\$ 135.662,22	R\$ 135.662,22		R\$ 2.496.845,59
fev/16	30/05/16	0024971	R\$ 134.058,63	R\$ 134.058,63		R\$ 2.362.786,96
mar/16	30/05/16	0024976	R\$ 132.455,05	R\$ 132.455,05		R\$ 2.230.331,91
abr/16	30/05/16	0024973	R\$ 130.851,47	R\$ 130.851,47		R\$ 2.099.480,44
mai/16	30/05/16	0024973	R\$ 129.247,89	R\$ 129.247,89		R\$ 1.970.232,55
jun/16	29/09/16	0041630	R\$ 127.644,30	R\$ 127.644,30		R\$ 1.842.588,25

Quadro 14

## **Relatório de Investimentos janeiro 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 GERAf e COMAP em razão da necessidade de outras propostas. Aguardando novas propostas para prestação dos serviços. Fonte: GERAf/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 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 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. Fonte: GERAf/COMAP.

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 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 15

**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	
	29/12/2017	31/01/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 2.692.498.270,13	R\$ 2.750.929.025,63
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 576.898.838,13	R\$ 601.416.106,11
TÍTULOS CVS	R\$ 15.671.718,63	R\$ 15.526.760,80
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 3.349.596.826,89</b>	<b>R\$ 3.432.399.892,54</b>

Quadro 16

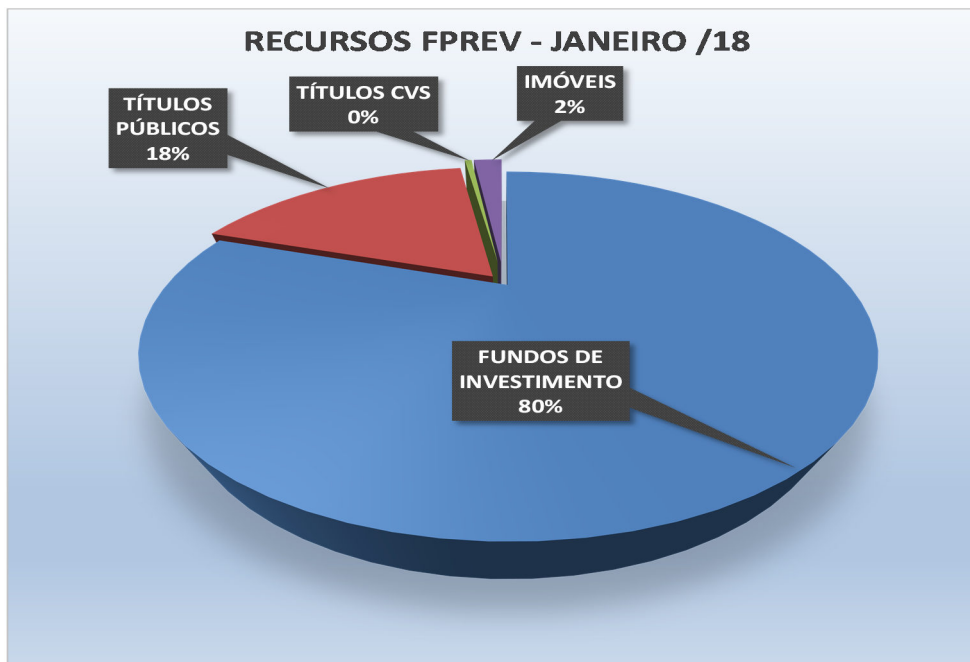


Gráfico 4

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 2.15 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
jan/17	R\$ 2.755.208.511,82	2,01%	2,01%	33,22%
fev/17	R\$ 2.847.106.582,51	3,34%	5,41%	34,04%
mar/17	R\$ 2.901.303.752,77	1,90%	7,42%	31,38%
abr/17	R\$ 2.930.172.240,47	1,00%	8,48%	28,32%
mai/17	R\$ 2.952.298.019,40	0,76%	9,30%	27,23%
jun/17	R\$ 2.993.728.697,93	1,40%	10,84%	25,95%
jul/17	R\$ 3.091.042.425,42	3,25%	14,44%	26,78%
ago/17	R\$ 3.150.753.915,37	1,93%	16,65%	26,54%
set/17	R\$ 3.215.911.304,31	2,07%	19,06%	26,45%
out/17	R\$ 3.252.585.663,77	1,14%	18,05%	25,80%
nov/17	R\$ 3.290.522.494,61	1,17%	19,43%	25,94%
dez/17	R\$ 3.349.596.826,89	1,80%	24,01%	24,01%
<b>jan/18</b>	<b>R\$ 3.432.399.892,54</b>	<b>2,47%</b>	<b>2,47%</b>	<b>24,58%</b>

Quadro 17

### 2.16 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO

PERÍODO	TAXA
jan/17	0,38%
dez/17	0,44%
<b>jan/18</b>	<b>0,29%</b>
Acumulado no ano de 2018	0,29%
Acumulado nos últimos 12 meses	2,86%
<b>Meta Atuarial no mês</b>	<b>0,7782%</b>

Quadro 18

### 2.17 RENTABILIDADE FPREV EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	JAN/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2005 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	1,2688%	1,2688%	11,8248%	388,6743%
META ATUARIAL	0,7782%	0,7782%	9,0264%	340,4459%
<b>RESULTADO ATUARIAL</b>	<b>0,4868%</b>	<b>0,4868%</b>	<b>2,5668%</b>	<b>10,9499%</b>

Quadro 19

**Nota:** Rentabilidade do FPREV validada pelo atuário.

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

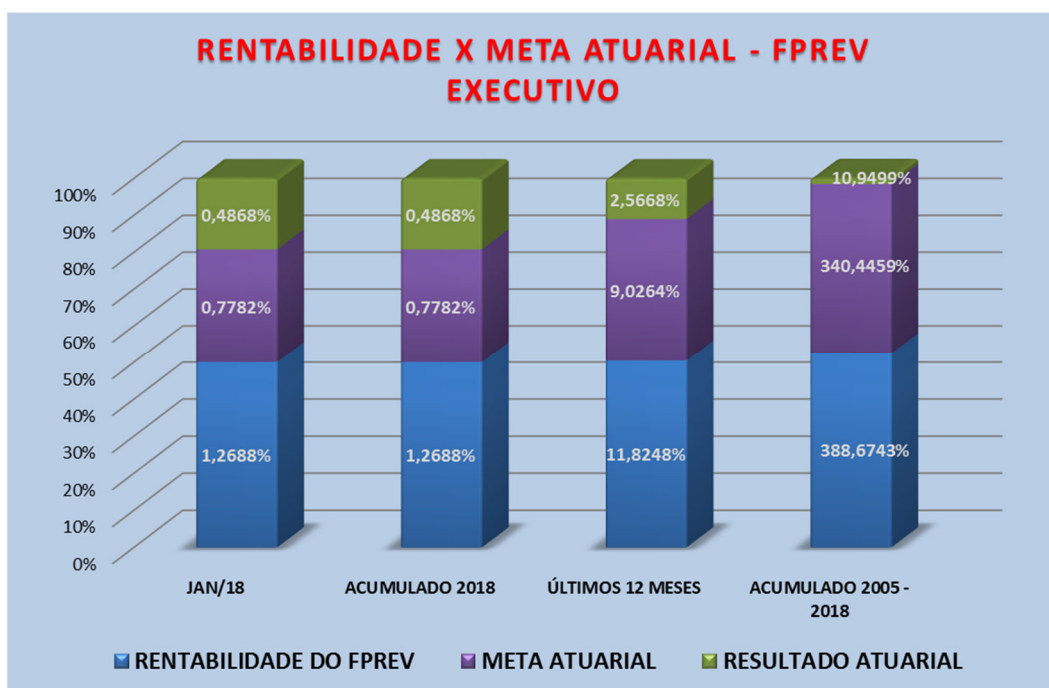


Gráfico 5.

### 3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/12/2017	31/01/2018	nov/17	dez/17	jan/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 856.813,76	R\$ 861.735,34	0,5600	0,5300	0,5741	1,6733%	0,5741	9,7900%
BRASESCO FI RF IRF MI	R\$ 4.756.742,00	R\$ 4.873.674,40	0,6100	0,5600	0,5764	1,7566%	0,5764	10,1800%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 5.613.555,76</b>	<b>R\$ 5.735.409,74</b>						

Quadro 20

#### 3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/12/2017	31/01/2018	nov/17	dez/17	jan/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 1.961.037,02	R\$ 2.048.874,04	(0,5397)	0,7912	4,4185	4,6767%	4,4185	16,5096%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 1.961.037,02</b>	<b>R\$ 2.048.874,04</b>						

Quadro 21

#### 3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	nov/17	dez/17	jan/18
SALDO ANTERIOR	7.245.680,53	7.349.135,69	7.574.592,78
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	90.888,15	179.975,72	89.577,05
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	12.567,01	46.665,74	120.113,95
<b>SALDO FINAL</b>	<b>7.349.135,69</b>	<b>7.574.592,78</b>	<b>7.784.283,78</b>

Quadro 22

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	29/12/2017	31/01/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.613.555,76	R\$ 5.735.409,74
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 1.961.037,02	R\$ 2.048.874,04
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 7.574.592,78</b>	<b>R\$ 7.784.283,78</b>

Quadro 23

### 3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
jan/17	R\$ 5.877.592,09	3,84%	3,84%	54,91%
fev/17	R\$ 6.111.857,30	3,99%	7,98%	51,53%
mar/17	R\$ 6.263.169,08	2,48%	10,65%	47,00%
abr/17	R\$ 6.360.541,05	1,55%	12,37%	42,62%
mai/17	R\$ 6.465.577,61	1,65%	14,23%	41,46%
jun/17	R\$ 6.602.039,70	2,11%	16,64%	39,50%
jul/17	R\$ 6.814.460,07	3,22%	20,39%	39,10%
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%	2,77%	32,44%

Quadro 24

### 3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

DESCRIÇÃO	JAN/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES
RENTABILIDADE DO FPREV	1,5857%	1,5857%	11,6649%
META ATUARIAL	0,7782%	0,7782%	9,0260%
<b>RESULTADO ATUARIAL</b>	<b>0,8013%</b>	<b>0,8013%</b>	<b>2,4204%</b>

Quadro 25

Nota: Obs: Rentabilidade calculada e validada pelo atuário – ALE/FPREV

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 4. CONSOLIDADOS FPREV ALE E EXECUTIVO

#### 4.1 Evolução dos Recursos Consolidados – ALE FPREV e EXECUTIVO

ANO	ALE FPREV	EXEC. FPREV	TOTAL FPREV
2004	R\$ -	R\$ 15.862.618,50	R\$ 15.862.618,50
2005	R\$ -	R\$ 57.510.136,49	R\$ 57.510.136,49
2006	R\$ -	R\$ 83.649.681,60	R\$ 83.649.681,60
2007	R\$ -	R\$ 75.698.485,78	R\$ 75.698.485,78
2008	R\$ -	R\$ 179.805.240,72	R\$ 179.805.240,72
2009	R\$ -	R\$ 341.872.841,56	R\$ 341.872.841,56
2010	R\$ -	R\$ 489.868.867,80	R\$ 489.868.867,80
2011	R\$ -	R\$ 657.928.672,97	R\$ 657.928.672,97
2012	R\$ 436.901,72	R\$ 936.612.579,50	R\$ 937.049.481,22
2013	R\$ 1.239.708,12	R\$ 1.166.915.511,62	R\$ 1.168.155.219,74
2014	R\$ 2.509.280,78	R\$ 1.571.464.403,45	R\$ 1.573.973.684,23
2015	R\$ 3.643.310,21	R\$ 2.012.490.466,39	R\$ 2.016.133.776,60
2016	R\$ 5.660.283,00	R\$ 2.700.997.719,11	R\$ 2.706.658.002,11
2017	R\$ 7.574.592,78	R\$ 3.349.596.826,89	R\$ 3.357.171.419,67
<b>2018</b>	<b>R\$ 7.784.283,78</b>	<b>R\$ 3.432.399.892,54</b>	<b>R\$ 3.440.184.176,32</b>

Quadro 26

#### 4.2 Rentabilidade Consolidada – ALE FPREV e EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	JAN/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES
RENTABILIDADE CONSOLIDADA	1,2695%	1,2695%	11,8276%
META ATUARIAL	0,7782%	0,7782%	9,0260%
RESULTADO ATUARIAL	0,4875%	0,4875%	2,5697%

Quadro 27

### 5. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

#### 5.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Investimentos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2017	31/01/2018	nov/17	dez/17	jan/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 23.399.396,31	R\$ 560.651,18	0,5500	0,5200	0,5742	1,6533%	0,5742	9,7900%
BRADESCO FI RF IRF M1 - COMPREV	R\$ 6.216.974,02	R\$ 6.247.329,19	0,6100	0,5600	0,5764	1,7566%	0,5764	10,1800%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 500,00	R\$ 1,00						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 29.616.870,33</b>	<b>R\$ 6.807.981,37</b>						

Quadro 28

#### 5.2 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit – FFIN ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/12/2017	31/01/2018
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 5.127,51	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 5.127,51</b>	<b>R\$ -</b>



## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

Quadro 29

### 5.3 Composição do Recursos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	nov/17	dez/17	jan/18
SALDO ANTERIOR	-	-	R\$ 5.127,51
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 799.626,11	R\$ 1.570.647,85	R\$ 782.408,91
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.366.760,83	R\$ 1.290.908,89	R\$ 1.253.069,69
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -
SAIDAS FINANCEIRAS	(2.166.386,94)	(2.856.429,23)	(2.040.606,11)
<b>SALDO FINAL</b>	<b>-</b>	<b>R\$ 5.127,51</b>	<b>-</b>

Quadro 30

### 5.4 Disponibilidade Financeira – FFIN EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	29/12/2017	31/01/2018
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 104.667,05	R\$ 129.822,89
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 340.756,18	R\$ -
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:** Saldo de Cobertura de Déficit referente a IRRF de pensionistas 13º salário pago em janeiro/2018.

## 6. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

### 6.1 SALDOS E PERFORMANCE DOS RECURSOS – TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2017	31/01/2018	nov/17	dez/17	jan/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.182.788,59	R\$ 2.316.860,61	0,5500	0,5200	0,5594	1,6383%	0,5594	9,7900%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 25.369.238,13	R\$ 25.513.807,06	0,5924	0,5678	0,5699	1,7401%	0,5699	10,1786%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 26.552.027,72</b>	<b>R\$ 27.830.668,67</b>						

Quadro 32

## 7. RECURSOS DOS OUTRO PODERES – TJA E TCE

### 7.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2017	31/01/2018	nov/17	dez/17	jan/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO IRF MI - TJA	R\$ 90.374.095,95	R\$ 90.892.084,82	0,6100	0,5600	0,5764	1,7566%	0,5764%	10,1800%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 119.991.312,90	R\$ 122.009.076,52	0,5924	0,5678	0,5699	1,7401%	0,5699%	10,1786%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 115.252.255,26	R\$ 117.260.509,61	0,5893	0,5587	0,5852	1,7432%	0,5852%	10,1233%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 325.617.664,11</b>	<b>R\$ 330.161.670,95</b>						

Quadro 33

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 7.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	nov/17	dez/17	jan/18
SALDO ANTERIOR	314.104.167,29	318.606.816,56	325.617.664,11
REPASSES FINANCEIROS	2.790.711,26	5.451.832,83	2.827.643,26
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.873.641,14	1.794.684,63	1.877.282,35
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(161.703,13)	(235.669,91)	(160.918,77)
<b>SALDO FINAL</b>	<b>R\$ 318.606.816,56</b>	<b>R\$ 325.617.664,11</b>	<b>R\$ 330.161.670,95</b>

Quadro 34

**Nota 1:** Os Repasses e as Saídas Financeiras são representados pelos créditos recebidos e pagamento dos pensionistas desses órgãos, ambos registrados sob regime de Caixa.

**Nota 2:** A Variação Financeira indicada no quadro acima, representa a Rentabilidade das aplicações, porém são consideradas as movimentações de aplicação e resgate do período e tende a acompanhar a performance dos fundos de investimentos. (Quadro 33).

### 7.3 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2017	31/01/2018	nov/17	dez/17	jan/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO IRF M1 - TCE	R\$ 39.971.472,49	R\$ 40.087.406,36	0,6100	0,5600	0,5764	1,7566%	0,5764%	10,1800%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF - TCE	R\$ 49.608.415,35	R\$ 50.011.606,60	0,5924	0,5678	0,5699	1,7401%	0,5699%	10,1786%
BB PREV. RF IRF M1 - TCE	R\$ 48.089.085,97	R\$ 48.491.002,44	0,5893	0,5587	0,5852	1,7432%	0,5852%	10,1233%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 137.668.973,81</b>	<b>R\$ 138.590.015,40</b>						

Quadro 35

### 7.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	nov/17	dez/17	jan/18
SALDO ANTERIOR	133.260.340,17	135.284.796,08	137.668.973,81
REPASSES FINANCEIROS	1.370.552,07	1.797.884,68	-
VARIAÇÃO FINANCEIRA	796.190,41	763.103,89	932.414,35
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(142.286,57)	(176.810,84)	(11.372,76)
<b>SALDO FINAL</b>	<b>135.284.796,08</b>	<b>R\$ 137.668.973,81</b>	<b>R\$ 138.590.015,40</b>

Quadro 36

**Nota 1:** Os Repasses e as Saídas Financeiras são representados pelos créditos recebidos e pagamento dos pensionistas desses órgãos, ambos registrados sob regime de Caixa.

**Nota 2:** A Variação Financeira indicada no quadro acima, representa a Rentabilidade das aplicações, porém são consideradas as movimentações de aplicação e resgate do período e tende a acompanhar a performance dos fundos de investimentos. (Quadro 35).

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 8. ENQUADRAMENTO

#### 8.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% DA CARTEIRA	LIMITES PERMITIDOS	Res. n° 3.922/2010 atualizada pela Res. n° 4.604/2017
TÍTULOS DO TN	R\$ 603.464.980,15			
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 992.979.655,70			
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 31.474.738,26			
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.663.387,13	67,49%	100,00%	Inciso I, b
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 892.927.933,42			
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 42.613.700,18			
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 45.860.257,88			
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.877.511,79			
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 225.136.824,90			
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 372.795.232,57			
BRADESCO FI RF IRFM 1	R\$ 142.100.494,77	31,98%	40%	Inciso IV, a
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 53.864.368,18			
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 71.897.611,01			
SANTANDER FIC INST. RE REF DI	R\$ 248.581.708,93			
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 123.281.345,04			
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.000.000,00	0,13%	10%	art. 8º, inciso III
TITULOS CVS	R\$ 15.526.760,80	0,40%	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 3.879.046.510,71</b>	<b>100,00%</b>		

Quadro 37

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

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\$ 2.877.511,79	R\$ 3.879.176.335,60	0,07%	20%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 225.136.824,90		5,80%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 372.795.232,57		9,61%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 53.864.368,18		1,39%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 123.281.345,04		3,18%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 71.140.237,70		1,83%	
SANTANDER FIC INST. RE REF DI	R\$ 248.581.708,93		6,41%	
BRADESCO FI RF IRFM 1	R\$ 142.100.494,77		3,66%	

Quadro 38

**Nota 1:** Art. 13. As aplicações em cotas de um mesmo fundo de investimento a que se referem o art. 7º, incisos III e IV não podem exceder a 20% (vinte por cento) das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social.

**Nota 2:** O Total dos Recursos considera os valores aplicados em Fundos de Investimentos e Títulos Públicos acrescido do valor de Disponibilidade Financeira. Não considera o valor de Imóveis.

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 992.979.655,70	12.260.945.818,60	8,10%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 31.474.738,26	1.171.096.134,77	2,69%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.663.387,13	364.006.432,77	2,38%	
SANTANDER FIC INST. REF DI	R\$ 248.581.708,93	5.575.075.065,03	4,46%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 53.864.368,18	902.047.888,80	5,97%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 123.281.345,04	1.382.546.657,33	8,92%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 892.927.933,42	17.470.086.690,73	5,11%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 71.897.611,01	1.336.682.662,13	5,38%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 42.613.700,18	249.502.874,65	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 45.860.257,88	187.154.803,05	24,50%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.000.000,00	202.037.761,89	2,47%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 225.136.824,90	5.801.176.208,58	3,88%	
BRADESCO FI RF IRFM 1	R\$ 142.100.494,77	819.390.721,96	17,34%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.877.511,79	303.224.689,79	0,95%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 372.795.232,57	9.348.518.776,52	3,99%	

#### Quadro 39

**Nota 1:** Art. 14 § 1º 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 § 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 3:** 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, nos anos de 2020 e 2024.

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA DEZ/17) 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\$ 851.853,32	R\$ 1.033.117.781,09	0,1213%	5%
BRADESCO	R\$ 613.733,76	R\$ 742.910.064,03	0,1210%	
ITAÚ UNIBANCO SA	R\$ 602.591,10	R\$ 177.145.713,22	0,0294%	
CAIXA	R\$ 273.545,86	R\$ 1.053.299.502,49	0,3851%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	R\$ 259.825,35	R\$ 248.581.708,93	0,0957%	

#### 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 para o Gestores de Recursos de Terceiros.

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 9. TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV

#### FPREV PODER EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 2.750.929.025,63
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 601.416.106,11
CVS	R\$ 15.526.760,80
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 3.432.399.892,54</b>

#### ASSEMBLEIA LEGISLATIVA - ALE

DESCRIÇÃO	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 5.735.409,74
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.048.874,04
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ -
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 7.784.283,78</b>

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

DESCRIÇÃO	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	R\$ 27.830.667,67
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 560.651,18
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 6.247.329,19
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM.	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - FFIN	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ -
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 129.822,89
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 34.768.472,93</b>

#### OUTROS PODERES

ORGÃOS	SALDO
TJ/AM	R\$ 330.161.670,95
TCE/AM	R\$ 138.590.015,40
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA/TCE	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 468.751.686,35</b>
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>3.943.704.335,60</b>

Quadro 41

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018

### 9.1 CONSOLIDADO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	FPREV PODER EXECUTIVO	FPREV - ALE	TOTAL - FPREV
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 2.750.929.025,63	R\$ 5.735.409,74	R\$ 2.756.664.435,37
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 601.416.106,11	R\$ 2.048.874,04	R\$ 603.464.980,15
CVS	R\$ 15.526.760,80	R\$ -	R\$ 15.526.760,80
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ -	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 3.432.399.892,54</b>	<b>R\$ 7.784.283,78</b>	<b>R\$ 3.440.184.176,32</b>

DESCRIÇÃO	FFIN - PODER EXECUTIVO	FFIN - ALE	TOTAL FFIN
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 6.807.980,37	R\$ -	R\$ 6.807.980,37
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ -	R\$ 1,00
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 6.807.981,37</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ 6.807.981,37</b>

DESCRIÇÃO	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	SALARIOS NÃO RECLAMADOS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 27.830.667,67	R\$ -	R\$ 27.830.667,67
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 129.822,89	R\$ 129.823,89
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 27.830.668,67</b>	<b>R\$ 129.822,89</b>	<b>R\$ 27.960.491,56</b>

DESCRIÇÃO	RECURSOS TJ/AM	RECURSOS TCE/AM	RECURSOS TCE/AM
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 330.161.670,95	R\$ 138.590.015,40	R\$ 468.751.686,35
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 330.161.670,95</b>	<b>R\$ 138.590.015,40</b>	<b>R\$ 468.751.686,35</b>

<b>TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV</b>	<b>R\$ 3.943.704.335,60</b>
--	-----------------------------

Quadro 42

## Relatório de Investimentos janeiro de 2018



Gráfico 5

Sem mais a informar, segue para Superior Consideração.

Respeitosamente,

**Alan Nascimento**  
Coordenador

**Bruno Costa Novo**  
Secretário

**Leonardo Cavalcanti**  
Membro

**Renízio Ferreira**  
Membro