

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: **Relatório de Investimentos – Maio/2021**

Data: 15/06/2021

RELATÓRIO Nº. 006 / 2021 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **maio/2021**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 06);
- 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 do FPREV Executivo (páginas 07 a 12)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 12 a 14)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 15)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 16)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 17 a 18)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (página 19 a 20)
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (página 21 a 22)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 23 a 24)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (páginas 24 a 25)
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 26 a 31)
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 31 a 32)
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 33)
- 14) Relatório de Riscos da Carteira (página 34 a 38)
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 39).
- 16) Parecer do Conselho Fiscal (página 40).
- 17) Parecer do Conselho de Administração (página 41).



1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Com apoio dos Relatórios: Carta do Gestor emitido pela BRAM Asset Management:

O Banco Central elevou a taxa básica de juros em 75 pb. Em decisão unânime, a autoridade monetária decidiu por aumentar a taxa Selic de 2,75% para 3,50%. O movimento marca a continuidade do processo de ajuste da taxa de juros iniciado na reunião de março. No comunicado divulgado após a decisão, o Banco Central frisou que a evolução recente da atividade econômica tem surpreendido positivamente a despeito da segunda onda da pandemia, e que os preços internacionais de commodities permanecem em elevação, gerando pressão sobre a inflação no curto prazo. Além disso, as expectativas de inflação atualmente se situam acima da meta estabelecida para 2021 e ao redor da meta para 2022. Para a próxima reunião, o Banco Central indicou um aperto monetário de mesma magnitude. Segundo o comitê, essa visão continuará dependendo da evolução da atividade econômica, do balanço de riscos e das projeções e expectativas de inflação. O documento reforça que a incerteza a respeito do ritmo de crescimento da economia segue acima da usual. Nesse sentido, a autoridade monetária avalia que o cenário indica ainda ser apropriada a manutenção de algum estímulo monetário ao longo do processo de recuperação econômica, embora essa posição possa ser revista no futuro de modo a garantir o cumprimento da meta de inflação. Espera-se que o ciclo de elevação da taxa de juros continue nas próximas reuniões, com a Selic alcançando 6,50% ao final do ciclo de ajuste. Em termos de atividade, o Índice do Banco Central de atividade (IBC-Br) recuou 1,6% na margem em março. O indicador prévio do PIB registrou queda menos intensa do que projetado e a mediana do mercado (ambas em -3,4%). O resultado refletiu as quedas da produção industrial (-2,4%), das vendas no varejo ampliado (-5,3%) e do volume de serviços (-4,0%) no mês. Na comparação interanual, o índice teve alta de 6,3%. Com isso, o IBC-Br passou a se situar 1,0% acima do patamar pré-pandemia (média de janeiro e fevereiro de 2020). Já os indicadores antecedentes de abril e maio sugerem uma contração inferior à anteriormente prevista no 2º trimestre. A prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15), por sua vez, ficou abaixo do esperado. Nessa divulgação, o índice subiu 0,44% surpreendendo o consenso de mercado (0,56%) e ficando aquém da nossa expectativa (0,53%). A principal contribuição para o desvio de projeção veio de passagens aéreas, que marcou deflação de 29% nessa leitura, enquanto a expectativa para esse item era de uma leve alta. Essa queda inesperada evidencia os efeitos desinflacionários das restrições de mobilidade impostas no começo do ano para o setor de serviços. Por outro lado, o setor de bens segue com inflação elevada, com destaque para vestuário, artigos de residência e automóveis. Com relação aos núcleos, que são métricas que excluem ou suavizam itens com inflação volátil, a leitura do IPCA-15 de maio mostrou uma leve elevação na margem, de forma que, na média dos últimos três meses, as medidas mais acompanhadas pelo Banco Central seguem próximas do teto da meta para esse ano. Nos



últimos 12 meses, a média dos núcleos acumula alta de 4,1%. Para o ano corrente, o cenário de inflação segue pressionado. A alta de preços de commodities, os problemas climáticos recentes no Brasil e o aumento da demanda por bens impõem uma trajetória desafiadora para a inflação nos próximos meses. Aliado a isso, há uma expectativa de realinhamento de preços, em especial no setor de serviços, de forma mais pronunciada no segundo semestre, à medida que avance o processo de vacinação. Esse efeito já ocorre em algumas economias desenvolvidas. Nossa projeção para o IPCA deste ano é de 5,6%.

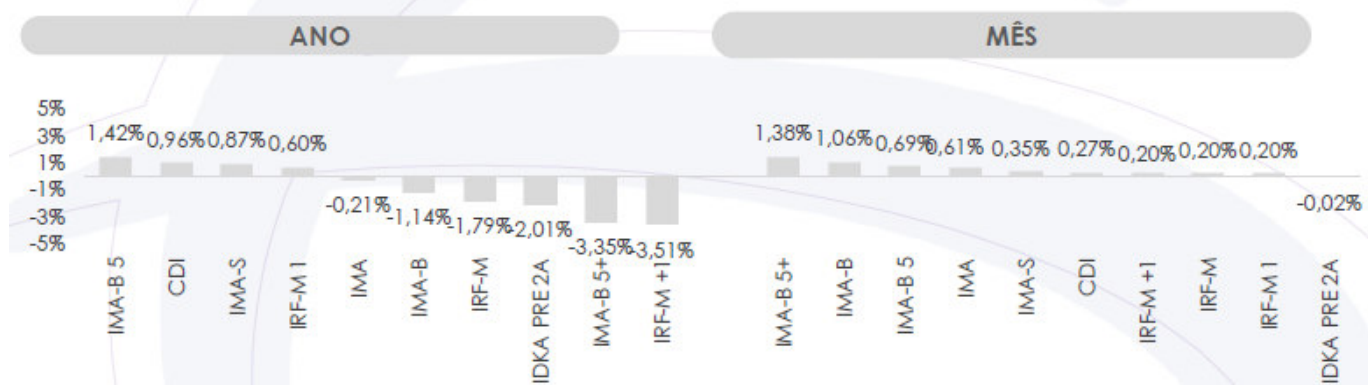
No cenário internacional, destaque para a surpresa negativa no mercado de trabalho dos EUA, que registrou a criação de 266 mil vagas de emprego em abril. A expectativa era de criação de 1 milhão de vagas. A taxa de desemprego aumentou para 6,1%, ante 6,0% em março. Esse aumento é explicado pelo avanço da população ocupada abaixo do aumento da população à procura de emprego. A taxa de participação da população economicamente ativa (PEA) subiu de 61,5% para 61,7%. Os salários, por sua vez, aceleraram acima do esperado, com alta na margem de 0,7%, ante expectativa de estabilidade. O número de empregados ainda se mantém cerca de 8 milhões abaixo do pré-crise. Medidas qualitativas do mercado de trabalho mencionadas pelo Fed, como a taxa de desemprego de grupos vulneráveis e número de desempregados em caráter permanente, não apresentaram melhora. Em suma, o relatório é condizente com o cenário de retomada robusta. Ainda nos EUA, a inflação ao consumidor (CPI) mostrou forte alta em abril, surpreendendo os mercados. O núcleo do CPI, métrica que exclui a inflação de componentes voláteis, mostrou alta de 0,9% na comparação com o mês anterior. O resultado ficou muito acima da mediana de projeções do mercado, de 0,3%, e representou uma aceleração do núcleo da inflação acumulada em 12 meses de 1,6% para 3,0%. Em relação ao índice geral, a variação em 12 meses subiu de 2,6% para 4,2% no período. A abertura revela que a inflação foi fortemente impactada pela alta de preço de carros usados e de passagens aéreas no mês - esses dois componentes explicam praticamente metade da alta do núcleo do CPI em abril. De toda forma, o avanço da vacinação no país, a reabertura da economia e os pacotes de incentivo fiscal sugerem novas pressões inflacionárias à frente, em especial no setor de serviços. Dessa forma, a preocupação com a reversão dos estímulos do Fed antes do esperado seguirá em elevação.

Perspectivas Renda Fixa – A recuperação da atividade nas economias mais desenvolvidas está bastante evidente. Esse movimento está associado ao excesso de recursos que circula pelo mundo e ao otimismo gerado pela vacinação mais acelerada, principalmente nos EUA. Seguindo a mesma tônica, estão as commodities, que permanecem em um patamar elevado de preços, apesar dos alertas da China e de suas tentativas de contê-las. Somando esses aspectos, tem-se um cenário inflacionário mais robusto e, com isso, os investidores demonstram maior incerteza com relação à condução de política monetária. Além disso, cresce a expectativa de que o Banco Central americano reconheça a necessidade de redução de estímulos, no entanto, o presidente americano Biden pretende liberar um pacote para estimular a economia. Na mesma



linha do exterior, o Brasil segue uma forte tendência de recuperação da atividade. Adicionalmente, cresce o risco de uma 3ª onda de contaminação e, apesar do atraso na entrega da matéria prima para confecção das vacinas, permanece um cenário de 60% do público adulto vacinado até o final do 3º trimestre. Além disso, as expectativas de inflação local também seguem pressionadas e, por sua vez, ampliam o espaço para uma normalização mais intensa esse ano. No cenário da BRAM, considera-se uma elevação de juros até o patamar neutro este ano, o qual seria de uma Selic por volta de 6,5%. Por fim, no cenário base, as ameaças fiscais seguem latentes, mas não se tornam uma quebra de teto efetiva, e os números de endividamento estão melhores do que o fechamento de 2020, devido a um PIB nominal maior para este ano. As curvas de juros se mantiveram estáveis neste mês. Contudo, a volatilidade segue em alta e a possibilidade de um enxugamento de liquidez mais intensa contribuiu para isso. O resultado da renda fixa foi positivo com destaque para os ativos atrelados à inflação que, além de manter uma baixa volatilidade, obtiveram um excelente resultado em maio. Seguidos pelas LFTs, representadas pelo IMA-S, que obtiveram um excelente resultado de 130% do CDI no mês, devido a queda das taxas de negociação, mas que no ano seguem com um desempenho de 90% do CDI. Os ativos prefixados apresentaram desempenho positivo, porém abaixo do CDI. O Dólar permaneceu na tendência de queda e recuou 3,17%, colocando a moeda em um patamar próxima a zero de oscilação no ano.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Fonte: Carta ao Gestor_BRAM - Junho/2021

Perspectivas Renda Variável – Maio foi mais um mês positivo para as bolsas em geral, com destaque para as ações com características de Valor, em detrimento das ações com características de Crescimento. O ambiente de retomada das economias e as revisões positivas para o crescimento do PIB têm influenciado significativamente a dinâmica dos mercados acionários. As preocupações em torno da volta da inflação e de altas de juros no futuro, completam o cenário. O S&P 500 teve retorno de 0,55%, o Nasdaq teve retorno de -1,53% e o MSCI Emerging Markets 2,12%, acumulando alta no ano de 11,93%; 6,68% e 6,58%, respectivamente e em moeda original. O Ibovespa teve um mês de forte recuperação com retorno positivo



de 6,16%, acumulando alta de 6,05% no ano. O fluxo do investidor estrangeiro continua positivo, em linha com o mercado de capitais que permanece aquecido. A gestão segue com visão positiva para renda variável no médio e longo prazos, onde pode-se destacar fatores como crescimento cíclico do PIB e juros em patamares baixos considerando a normalização da Selic anunciada pelo BC, trazendo fluxo do investidor local para a bolsa. Risco de novas ondas da pandemia, inflação e risco fiscal permanecem como pontos de atenção. A gestão acredita que o balanço de forças entre a expectativa de novos pacotes de estímulo fiscal nos EUA e o ambiente local justificam a adoção de portfólios balanceados em empresas ligadas a commodities e as expostas ao consumo doméstico, com expectativa de crescimento acima do mercado, potencial de consolidação e bem posicionadas para os desafios pela frente. Sobre a performance dos diferentes setores no mês, o tema de reabertura e recuperação da economia local foi o principal influenciador do comportamento do preço das ações. Desta vez, os setores de Bebidas, Shoppings & Properties e Educação se beneficiaram. Por outro lado, setores que se valorizaram significativamente ou que sofrem influência negativa com a valorização do Real e alta das taxas de juros, foram os que se destacaram negativamente como Papel & Celulose, Construção Civil, Bens de Capital e Telecom & Tecnologia.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	MAIO	2021	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	0,55%	11,93%	38,10%	52,76%	54,34%
MSCI WORLD USD	1,26%	10,62%	38,54%	45,42%	41,67%
SMLL	6,32%	10,00%	57,75%	55,08%	97,90%
IBRX100	5,92%	8,14%	47,63%	34,45%	72,38%
IDIV11	5,64%	4,32%	37,85%	30,26%	78,57%
IBOVESPA	6,16%	6,05%	44,41%	30,08%	64,44%

Fonte: Carta ao Gestor_BRAM - Junho/2021.



Relatório de Investimentos – Maio/2021

007

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1 SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 325.112.833,57	R\$ 326.676.020,68	(0,4211)	0,6214	0,4808	0,6794%	-0,7916%	3,4365%
BB PREVID TP VII	R\$ 6.945.557,64	R\$ 6.997.434,14	0,3900	0,4049	0,7469	1,5493%	1,8280%	6,8549%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 256.914.249,78	R\$ 258.637.932,66	0,3700	0,8398	0,6709	1,8919%	1,5126%	NC
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 3.817.400,24	R\$ 3.827.668,90	0,1900	0,1700	0,2700	0,6313%	0,8629%	1,6042%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 53.379.206,77	R\$ 53.661.741,13	0,0700	1,4800	0,5300	2,0893%	-1,9473%	1,5952%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 484.524.336,27	R\$ 487.767.664,69	0,3115	0,8616	0,6694	1,8531%	1,3061%	7,0952%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 531.169.049,32	R\$ 532.436.892,52	0,3010	0,6645	0,2387	1,2085%	0,7204%	3,4530%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 28.193.521,51	R\$ 28.423.011,20	0,3300	1,2300	0,8100	2,3867%	2,2005%	10,1849%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 109.469.933,64	R\$ 110.183.706,13	0,2800	0,8800	0,6500	1,8200%	1,2291%	6,8816%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 60.597.964,35	R\$ 61.419.004,11	(1,2150)	0,4300	1,3500	0,5491%	-3,5124%	10,3131%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 21.169,27	R\$ 21.226,61	0,1400	0,1100	0,2700	0,5208%	0,7158%	1,7410%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 28.680.250,82	R\$ 29.058.535,94	(0,8158)	0,5969	1,3200	1,0933%	-2,4439%	7,7295%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.888.825.473,18	R\$ 1.899.110.838,71						

Quadro 1.

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 133.566.136,82	R\$ 112.581.440,98	8,6306	2,3237	5,6893	17,4788%	5,3393%	46,3936%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 176.326.547,56	R\$ 190.971.998,03	3,1200	4,3400	8,3100	16,5366%	12,5517%	41,9115%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 61.698.133,81	R\$ 65.161.785,17	4,0800	3,1900	5,6100	13,4253%	6,2821%	44,4842%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 332.437.979,27	R\$ 344.527.038,66	1,7300	0,9943	3,6400	6,4813%	3,1506%	40,7746%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 9.811.239,07	R\$ 10.099.103,74	8,1740	0,0754	2,9300	11,4275%	2,9676%	NC
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 6.745.596,57	R\$ 6.709.274,31	22,2300	(0,4950)	(0,5400)	20,9682%	20,4770%	NC
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 42.912.258,65	R\$ 35.495.409,45	2,1311	0,7668	6,3615	9,4611%	2,1687%	25,7680%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 181.362.620,28	R\$ 190.898.394,04	5,0600	1,6700	5,2600	12,4329%	3,9098%	26,9896%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 179.936.971,66	R\$ 193.738.622,58	2,1200	3,3100	7,6700	13,5920%	12,4597%	53,9491%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 41.031.880,04	R\$ 43.128.348,39	3,8900	2,8300	5,1100	12,2891%	5,4396%	40,2888%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 65.634.685,83	R\$ -	3,5800	4,2500	8,0200	16,6423%	8,3784%	33,8782%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 91.901.452,76	R\$ 131.024.425,92	4,5800	6,4100	4,7500	16,5695%	13,1020%	57,0395%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ -	R\$ 33.507.916,43	-	-	0,3900	0,3900%	0,3900%	NC
SANTANDER CRESCE SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 14.863,70	R\$ 15.766,73	6,4746	(3,0873)	6,0753	9,4564%	1,5631%	35,0672%
SANTANDER SEL CRESCIMENTO (SELEÇÃO 30)	R\$ 46.766.080,07	R\$ 49.607.233,30	1,4842	1,6912	6,0754	9,4703%	1,6002%	35,1520%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 24.325.680,39	R\$ 24.427.190,18	4,0700	5,3602	0,4200	10,1089%	12,7574%	36,0973%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 90.230.730,64	R\$ 94.449.442,15	0,7675	6,9400	4,6800	12,8040%	11,5044%	46,8598%
OCCAM FIC FIA	R\$ 133.018.999,61	R\$ 138.838.757,78	3,9351	3,5100	4,3800	12,2954%	5,1223%	42,5116%
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 32.866.562,83	R\$ 35.041.502,84	2,5179	2,0152	6,6175	11,5047%	4,1101%	31,5739%
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 9.878.845,32	R\$ 9.969.388,59	-	(1,5200)	0,9200	-0,6140%	-0,6140%	NC
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ -	R\$ 10.045.992,02	-	-	0,4599	0,4599%	0,4599%	NC
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 10.113.585,56	R\$ 10.718.537,20	-	2,3100	5,9800	8,4281%	8,4281%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.670.580.850,44	R\$ 1.730.957.568,49						

Quadro 2.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:33
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento Assinado por: LUIS CARLOS COSTA NOVO em 15/06/2021 12:23:00
 Documento Assinado por: LUIS CARLOS COSTA NOVO em 15/06/2021 12:23:00
 Documento Assinado por: ANILTON LINS REBELINDE em 17/06/2021 08:42:025
 Documento assinado eletronicamente em 6/2025/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
 Assinatura: B01P:LE3NARD0A:BE:J:CARVALSARFH:7706/2021:88:15:14023000
 Acesso: http://www.portalidosegurado.am.gov.br:85/validar
 e valide o código: N1W1MJU



Relatório de Investimentos – Maio/2021

008

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 83.465.235,65	R\$ 22.464.353,08	3,8559	0,9813	(2,0071)	2,7701%	14,4364%	NC	
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 142.851.062,63	R\$ 137.832.828,22	2,5800	0,7828	(3,5129)	-0,2488%	10,2203%	32,7753%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 28.983.588,91	R\$ 28.486.055,03	1,9353	1,2400	(1,7200)	1,4243%	1,4243%	NC	
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 80.255.295,41	R\$ 78.143.938,43	3,8344	0,3824	(2,6308)	1,4893%	11,0037%	31,2175%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 139.790.869,53	R\$ 135.024.316,61	3,0300	2,6681	(3,4100)	2,1719%	10,7417%	30,6291%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 35.564.693,58	R\$ 34.417.077,27	1,6361	1,0716	(3,2268)	-0,5896%	-0,5896%	NC	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.300.753,66	R\$ 31.933.750,22	(1,6697)	0,7681	(6,9007)	-7,7521%	-7,7521%	NC	
TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	R\$ 545.211.499,37	R\$ 468.302.318,86							
TOTAL GERAL	R\$ 4.104.617.822,99	R\$ 4.098.370.726,06							

Quadro 3.

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

Nota 2: As movimentações nesse mês tiveram como base as Atas 174 e 175, com efetivação de operações pendentes de Atas anteriores.

2.4 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	mar/21	abr/21	mai/21
BRANCO	R\$ 232.591.793,75	R\$ 241.842.081,61	R\$ 259.961.452,10
BANCO DO BRASIL	R\$ 865.657.490,00	R\$ 886.259.308,87	R\$ 805.501.119,97
CAIXA	R\$ 1.122.807.492,06	R\$ 1.111.984.851,01	R\$ 1.109.361.707,79
ITAÚ	R\$ 363.415.136,76	R\$ 378.526.159,56	R\$ 401.420.539,93
SANTANDER	R\$ 187.375.722,51	R\$ 189.632.006,40	R\$ 187.455.828,25
ICATU	R\$ 375.094.157,82	R\$ 379.624.039,78	R\$ 390.924.115,48
SAFRA	R\$ 187.756.204,28	R\$ 192.796.800,74	R\$ 188.510.042,73
BTG PACTUAL	R\$ 345.747.806,86	R\$ 348.994.814,91	R\$ 361.335.416,71
AZ QUEST	R\$ 84.376.765,95	R\$ 90.230.730,64	R\$ 94.449.442,15
OCCAM BRASIL	R\$ 128.504.904,80	R\$ 133.018.999,61	R\$ 138.838.757,78
SCHRODER	R\$ 40.682.977,71	R\$ 28.983.588,91	R\$ 28.486.055,03
SULAMÉRICA	R\$ 32.217.327,79	R\$ 32.866.562,83	R\$ 35.041.502,84
PLURAL INVEST	R\$ 41.261.455,85	R\$ 69.865.447,24	R\$ 66.350.827,49
BRASIL CAPITAL	R\$ -	R\$ 9.878.845,32	R\$ 9.969.388,59
BNP PARIBAS	R\$ -	R\$ -	R\$ 10.045.992,02
VINCI PARTNERS	R\$ -	R\$ 10.113.585,56	R\$ 10.718.537,20
TOTAL	R\$ 4.007.489.236,14	R\$ 4.104.617.822,99	R\$ 4.098.370.726,06

Quadro 4.



Relatório de Investimentos – Maio/2021

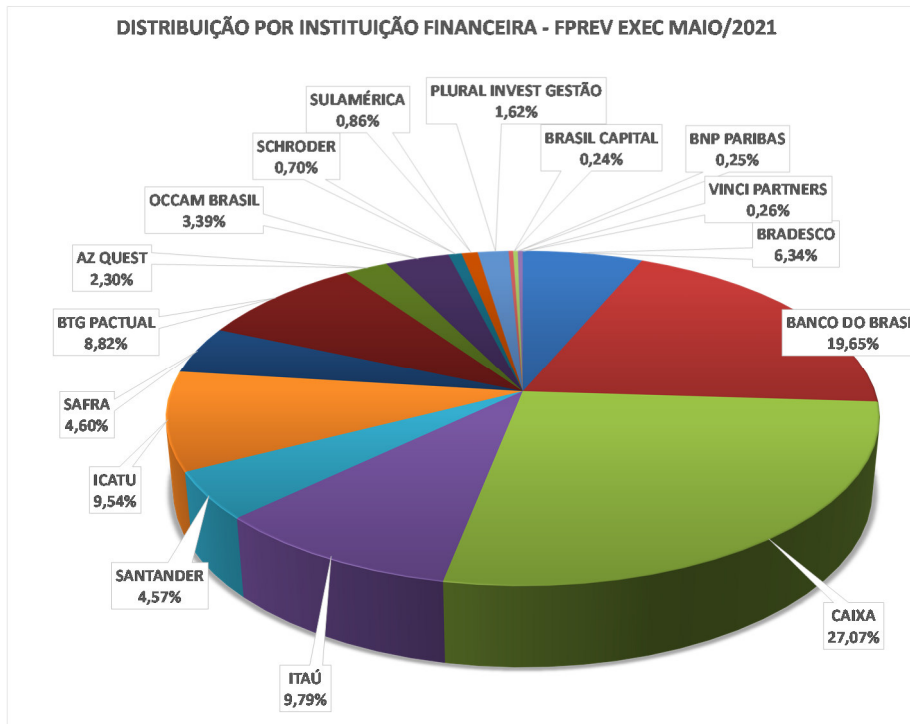


Gráfico 1.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTR E	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 163.527.991,19	R\$ 165.750.255,25	1,4595	0,8362	1,3590	3,698%	5,9545%	15,0579%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 170.545.216,52	R\$ 172.879.040,08	1,4690	0,8457	1,3684	3,727%	6,0041%	15,1874%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 179.504.729,94	R\$ 177.511.761,77	1,4928	0,8693	1,3922	3,800%	6,1284%	15,5117%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 176.968.931,13	R\$ 179.390.687,97	1,4690	0,8457	1,3685	3,727%	6,0042%	15,1876%
TOTAL GERAL	R\$ 690.546.868,78	R\$ 695.531.745,06						

Quadro 5.

Nota: Títulos Públicos atualizados pelo valor de aquisição acrescido da taxa de juros. (Ver quadro 6).

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

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\$ 165.750.255,25	R\$ 172.879.040,08	R\$ 177.511.761,77	R\$ 179.390.687,97
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 ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

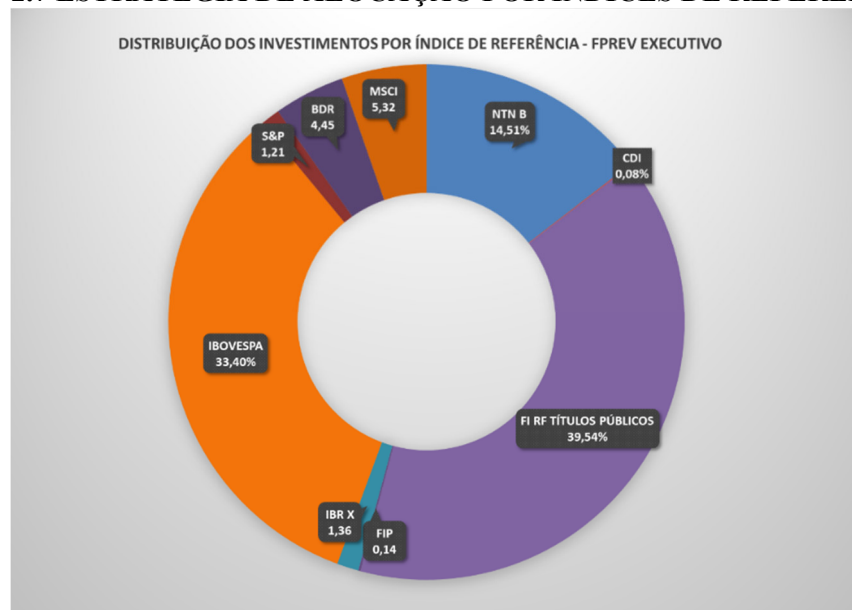


Gráfico 2.

2.8 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	30/04/2021	31/05/2021
CVS - A	R\$ 1.187.639,50	R\$ 1.170.186,18
CVS - B	R\$ 7.684.091,30	R\$ 7.571.113,50
CVS - C	R\$ 154.063,00	R\$ 151.798,92
CVS - D	R\$ 842.662,92	R\$ 830.273,40
TOTAL	R\$ 9.868.456,72	R\$ 9.723.372,00

Quadro 7.

Nota: Os Títulos CVS realizam amortização mensal dos Juros e antecipação de parte do Principal (quadro a seguir), justificando a redução mensal dos valores em carteira.

2.9 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/21	R\$ 30.247,09	R\$ 145.084,72	R\$ 175.331,81
fev/21	R\$ 29.827,12	R\$ 145.084,72	R\$ 174.911,84
mar/21	R\$ 29.407,16	R\$ 145.084,72	R\$ 174.491,88
abr/21	R\$ 28.978,18	R\$ 145.084,72	R\$ 174.062,90
mai/21	R\$ 28.567,21	R\$ 145.084,72	R\$ 173.651,93
TOTAL	R\$ 147.026,76	R\$ 725.423,60	R\$ 872.450,36

Quadro 8.

2.10 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2021 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
mar/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
abr/21	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84
mai/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 87.271,44	R\$ 200.728,80	R\$ 288.000,24

Quadro 9.



2.11 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/04/2021	31/05/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.104.617.822,99	R\$ 4.098.370.726,06	82,2025%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 690.546.868,78	R\$ 695.531.745,06	13,9505%
TÍTULOS CVS	R\$ 9.868.456,72	R\$ 9.723.372,00	0,1950%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 61.835.325,18	1,2403%
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ 60.000.000,00	1,2034%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.867.128,60	R\$ 60.242.693,77	1,2083%
TOTAL	R\$ 4.868.735.602,27	R\$ 4.985.703.862,07	100,00%

Quadro 10.

Nota 1: Valores em trânsito referente ao resgate do fundo BB MM Global Select conforme prazo de liquidação da operação (D+5). Operação concluída em 02/06/2021.

Nota 2: O valor Disponibilidade Financeira refere-se à movimentação para o fundo Itaú MM S&P 500 BRL FIC concluída em 01/06/2021.

2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
mai/20	R\$ 4.808.084.982,84	1,11%	-7,07%	8,26%
jun/20	R\$ 4.837.475.067,57	0,61%	-6,50%	6,07%
jul/20	R\$ 4.902.116.484,95	1,34%	-5,25%	5,41%
ago/20	R\$ 4.797.635.488,57	-2,13%	-7,27%	2,10%
set/20	R\$ 4.651.365.387,53	-3,05%	-10,10%	-3,39%
out/20	R\$ 4.549.328.612,79	-2,19%	-12,07%	-7,68%
nov/20	R\$ 4.700.643.285,36	3,33%	-9,15%	-5,39%
dez/20	R\$ 4.808.000.009,11	2,28%	-7,07%	-7,07%
jan/21	R\$ 4.691.638.612,35	-2,42%	-2,42%	-8,75%
fev/21	R\$ 4.654.824.437,71	-0,78%	-3,19%	-9,45%
mar/21	R\$ 4.764.067.642,49	2,35%	-0,91%	1,67%
abr/21	R\$ 4.868.735.602,27	2,20%	1,26%	2,42%
mai/21	R\$ 4.985.703.862,07	2,40%	3,70%	3,69%

Quadro 11.



2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 05/2020		RS 4.808.084.982,84	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
06/2020	R\$ 32.820.094,52	R\$ 156.602.317,41	R\$ -123.782.222,89
07/2020	R\$ 33.058.400,54	R\$ 124.266.927,34	R\$ -91.208.526,80
08/2020	R\$ 39.455.936,02	R\$ 99.107.615,94	R\$ -59.651.679,92
09/2020	R\$ 39.934.090,22	R\$ 109.739.936,23	R\$ -69.805.846,01
10/2020	R\$ 38.961.921,68	R\$ 112.188.198,10	R\$ -73.226.276,42
11/2020	R\$ 39.697.646,11	R\$ 116.368.518,74	R\$ -76.670.872,63
12/2020	R\$ 117.527.713,10	R\$ 175.934.562,52	R\$ -58.406.849,42
01/2021	R\$ 584.279,15	R\$ 82.104.432,44	R\$ -81.520.153,29
02/2021	R\$ 40.864.605,59	R\$ 44.974.382,51	R\$ -4.109.776,92
03/2021	R\$ 41.485.170,47	R\$ 10.665.619,53	R\$ 30.819.550,94
04/2021	R\$ 41.308.639,76	R\$ 10.074.221,86	R\$ 31.234.417,90
05/2021	R\$ 41.318.216,48	R\$ 14.353.928,89	R\$ 26.964.287,59
Saldo dos Investimentos em 05/2021		RS 4.985.703.862,07	

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	8,0559 %	3,2185 %	0,8300 %
Juros	5,4500 %	2,2357 %	0,4432 %
Meta	13,9449 %	5,5262 %	1,2769 %
Rentabilidade em %	16,4845 %	3,6629 %	1,8486 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 726.982.827,10	R\$ 174.315.526,74	R\$ 90.003.971,71
Resultado em %	+2,2288 %	-1,7657 %	+0,5645 %
Resultado em R\$	R\$ +112.171.631,95	R\$ -88.673.692,43	R\$ +27.836.036,31

Quadro 12.

Nota 1: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se ao pagamento de inativos e pensionistas do Executivo FPREV, registrados sob Regime de Caixa.



Relatório de Investimentos – Maio/2021

013

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.211.989,83	R\$ 5.224.430,27	0,3010	0,6645	0,2387	1,2085%	0,9644%	3,7037%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 87.531,67	R\$ 87.768,74	0,1400	0,1100	0,2700	0,5208%	0,6693%	1,6983%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 1.968.874,40	R\$ 1.984.900,66	0,3300	1,2300	0,8100	2,3867%	2,1870%	10,1703%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 351.455,30	R\$ 353.813,27	0,3700	0,8398	0,6709	1,8919%	1,8919%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 7.619.851,20	R\$ 7.650.912,94						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 533.652,26	R\$ 561.710,89	5,0600	1,6700	5,2600	12,4329%	13,8356%	39,1200%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.601.504,99	R\$ 1.659.743,49	1,7256	0,9943	3,6400	6,4767%	3,1462%	NC
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 493.998,71	R\$ 525.424,55	2,1311	0,7668	6,3615	9,4611%	2,1687%	25,7680%
OCCAM FIC FIA	R\$ 2.158.418,94	R\$ 2.252.852,64	3,9351	3,5100	4,3800	12,2954%	5,1223%	42,5116%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ -	R\$ 145.294,96	-	-	0,3900	0,3900%	0,3900%	0,3900%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.787.574,90	R\$ 5.145.026,53						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.454.785,86	R\$ 1.405.180,94	3,0300	2,6681	(3,4100)	2,1719%	10,7417%	30,6274%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.454.785,86	R\$ 1.405.180,94						

TOTAL GERAL	R\$ 13.862.211,96	R\$ 14.201.120,41						
--------------------	--------------------------	--------------------------	--	--	--	--	--	--

Quadro 13.

Nota: Com base na Ata 174/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Itaú Private MM S&P500 BRL FIC FI (26.269.692/0001-61).

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.331.587,07	R\$ 2.364.047,59	1,4928	0,8693	1,3922	3,8003%	6,1284%	15,5117%
TOTAL GERAL	R\$ 2.331.587,07	R\$ 2.364.047,59						

Quadro 14.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	30/04/2021	31/05/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 7.619.851,20	R\$ 7.650.912,94
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.787.574,90	R\$ 5.145.026,53
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.454.785,86	R\$ 1.405.180,94
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.331.587,07	R\$ 2.364.047,59
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 16.193.799,03	R\$ 16.565.168,00

Quadro 15.

Documento assinado eletronicamente em 17/06/2021 13:23:47
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 15:15:27
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:30
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:30
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 17/06/2021 08:15:44
 Documento Assinado por: ANDRÉ LUIS REZENDE em 17/06/2021 08:04:02
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:30
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:30
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 17/06/2021 08:15:44
 Documento Assinado por: ANDRÉ LUIS REZENDE em 17/06/2021 08:04:02
 Acesso: http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar
 e valide o código: N1W1MJU



3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

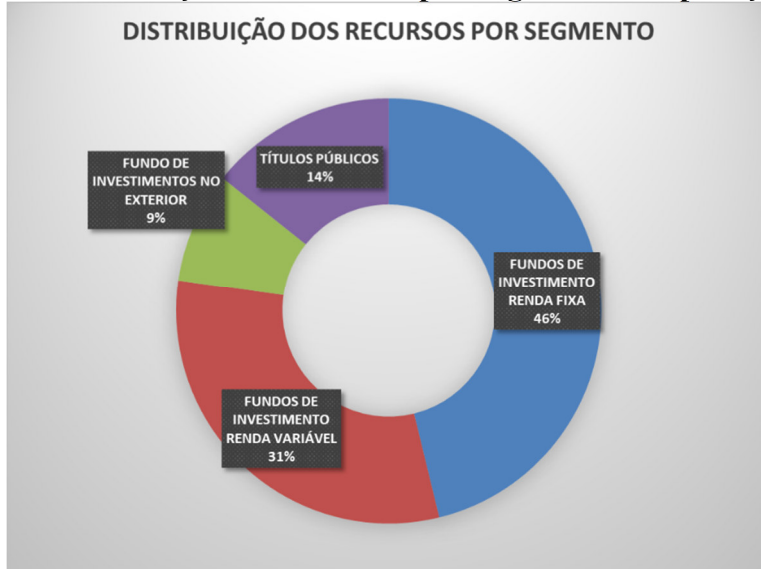


Gráfico 3.

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 05/2020		R\$ 13.198.269,14	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
06/2020	R\$ 118.639,37	R\$ 0,00	R\$ 118.639,37
07/2020	R\$ 118.639,37	R\$ 0,00	R\$ 118.639,37
08/2020	R\$ 154.104,87	R\$ 0,00	R\$ 154.104,87
09/2020	R\$ 170.237,76	R\$ 0,00	R\$ 170.237,76
10/2020	R\$ 143.453,76	R\$ 0,00	R\$ 143.453,76
11/2020	R\$ 143.747,84	R\$ 0,00	R\$ 143.747,84
12/2020	R\$ 133.342,71	R\$ 0,00	R\$ 133.342,71
01/2021	R\$ 286.790,86	R\$ 0,00	R\$ 286.790,86
02/2021	R\$ 143.097,24	R\$ 0,00	R\$ 143.097,24
03/2021	R\$ 143.973,76	R\$ 0,00	R\$ 143.973,76
04/2021	R\$ 144.001,52	R\$ 0,00	R\$ 144.001,52
05/2021	R\$ 144.070,46	R\$ 0,00	R\$ 144.070,46
Saldo dos Investimentos em 05/2021		R\$ 16.565.168,00	

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	8,0559 %	3,2185 %	0,8300 %
Juros	5,4500 %	2,2357 %	0,4432 %
Meta	13,9449 %	5,5262 %	1,2769 %
Rentabilidade em %	10,8794 %	3,4455 %	1,4036 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.522.799,34	R\$ 536.332,57	R\$ 227.298,51
Resultado em %	-2,6904 %	-1,9718 %	+0,1251 %
Resultado em R\$	R\$ -428.485,04	R\$ -323.815,68	R\$ +20.523,05

Quadro 16.

Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 16/06/2021 12:28:00
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40



Relatório de Investimentos – Maio/2021

015

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.724.608,30	R\$ 7.743.046,10	0,3010	0,6645	0,2387	1,2085%	0,7204%	NC
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.157.613,96	R\$ 40.275.374,94	(0,5400)	0,5300	0,4200	0,4071%	-1,1315%	2,6350%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 78.010.997,47	R\$ 78.386.085,05	(0,4211)	0,6214	0,4808	0,6794%	-0,7916%	4,0452%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.169.421,95	R\$ 3.190.686,16	0,3700	0,8398	0,6719	1,8930%	1,8930%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 129.062.641,68	R\$ 129.595.192,25						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 25.837.283,77	R\$ 27.287.754,60	4,0800	3,1900	5,6100	13,4253%	6,2854%	NC
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 1.662.128,98	-	-	0,9200	0,9200%	0,9200%	NC
BB AÇÕES VALOR	R\$ 21.979.445,79	R\$ 23.229.934,63	8,6306	2,3237	5,6893	17,4788%	17,4788%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 47.816.729,56	R\$ 52.179.818,21						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.642,15	R\$ 11.067,38
TOTAL RECURSOS	R\$ 176.881.013,39	R\$ 181.786.077,84

Quadro 17.

Nota: Com base na Ata 174/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo Brasil Capital RP Institucional FIC FIA (40.129.41/0001-65).

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 05/2020	R\$ 151.689.776,00
------------------------------------	--------------------

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
06/2020	R\$ 1.273.507,14	R\$ 10.584,16	R\$ 1.262.922,98
07/2020	R\$ 1.272.066,06	R\$ 11.829,88	R\$ 1.260.236,18
08/2020	R\$ 1.482.857,02	R\$ 9.164,74	R\$ 1.473.692,28
09/2020	R\$ 1.514.681,38	R\$ 7.663,69	R\$ 1.507.017,69
10/2020	R\$ 1.490.094,20	R\$ 9.164,74	R\$ 1.480.929,46
11/2020	R\$ 1.503.550,04	R\$ 9.164,74	R\$ 1.494.385,30
12/2020	R\$ 1.579.792,66	R\$ 12.799,56	R\$ 1.566.993,10
01/2021	R\$ 3.008.450,20	R\$ 8.065,16	R\$ 3.000.385,04
02/2021	R\$ 1.585.217,06	R\$ 9.707,31	R\$ 1.575.509,75
03/2021	R\$ 1.564.682,30	R\$ 8.065,16	R\$ 1.556.617,14
04/2021	R\$ 1.594.346,58	R\$ 9.707,31	R\$ 1.584.639,27
05/2021	R\$ 1.573.220,64	R\$ 41.257,15	R\$ 1.531.963,49

Saldo dos Investimentos em 05/2021	R\$ 181.786.077,84
------------------------------------	--------------------

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
---------------------	----------	--------------------	------

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	8,0559 %	3,2185 %	0,8300 %
Juros	5,4500 %	2,2357 %	0,4432 %
Meta	13,9449 %	5,5262 %	1,2769 %
Rentabilidade em %	6,7528 %	1,8988 %	1,9070 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 10.801.010,16	R\$ 3.294.752,05	R\$ 3.373.100,96
Resultado em %	-6,3120 %	-3,4374 %	+0,6222 %
Resultado em R\$	R\$ -11.488.904,30	R\$ -6.292.535,08	R\$ +1.114.541,80

Quadro 18.

Documento assinado eletronicamente em 17/06/2021 13:23:47
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:00
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 17/06/2021 12:23:00
 Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento Assinado por: ANIELLE LUIS REZENDE em 17/06/2021 08:42:02
 Documento assinado eletronicamente em 02/05/2021
 Documento Assinado por: AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ em 02/05/2021 12:23:00
 Acesso: http://www.portalidosegurado.am.gov.br:85/validar e valide o código: N1W1MJU



Relatório de Investimentos – Maio/2021

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

5.1 Saldos, Disponibilidade e Performace dos Fundos de Investimentos –DPE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar21	abr21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 7.883.804,61	R\$ 7.902.622,40	0,3010	0,6645	0,2387	1,2085%	0,7204%	NC
BRADESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.521.512,62	R\$ 8.557.646,03	(0,5400)	0,5300	0,4200	0,4071%	-1,1315%	3,2664%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.594.128,77	R\$ 9.547.234,96	0,0900	0,9400	0,6000	1,6370%	0,8128%	5,8237%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.017.650,25	R\$ 2.031.187,02	0,3700	0,8398	0,6709	1,8919%	1,8919%	1,8919%
TOTAL	R\$ 28.017.096,25	R\$ 28.038.690,41						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar21	abr21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 1.117.629,06	-	-	0,9200	0,9200%	0,9200%	NC
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 15.912,68	R\$ 16.924,96	2,1311	0,7668	6,3615	9,4611%	9,4611%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 15.912,68	R\$ 1.134.554,02						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 18.285,14	R\$ 13.893,37
TOTAL RECURSOS	R\$ 28.051.294,07	R\$ 29.187.137,80

Quadro 19.

Nota: Com base na Ata 174/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo Brasil Capital RP Institucional FIC FIA (40.129.41/0001-65).

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1.1 Investimentos

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
06/2020	R\$ 808.818,93	R\$ 0,00	R\$ 808.818,93
07/2020	R\$ 809.559,37	R\$ 0,00	R\$ 809.559,37
08/2020	R\$ 951.659,78	R\$ 0,00	R\$ 951.659,78
09/2020	R\$ 950.378,64	R\$ 0,00	R\$ 950.378,64
10/2020	R\$ 952.657,42	R\$ 0,00	R\$ 952.657,42
11/2020	R\$ 969.890,42	R\$ 19.728,47	R\$ 950.161,95
12/2020	R\$ 2.981.491,21	R\$ 92.070,31	R\$ 2.889.420,90
01/2021	R\$ 6.283,41	R\$ 77.294,71	R\$ -71.011,30
02/2021	R\$ 1.003.038,47	R\$ 51.465,27	R\$ 951.573,20
03/2021	R\$ 992.747,96	R\$ 51.465,27	R\$ 941.282,69
04/2021	R\$ 999.548,81	R\$ 39.463,54	R\$ 960.085,27
05/2021	R\$ 1.057.911,85	R\$ 96.855,31	R\$ 961.056,54
Saldo dos Investimentos em 05/2020			R\$ 16.120.441,92
Saldo dos Investimentos em 05/2021			R\$ 29.187.137,80

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	8,0559 %	3,2185 %	0,8300 %
Juros	5,4500 %	2,2357 %	0,4432 %
Meta	13,9449 %	5,5262 %	1,2769 %
Rentabilidade em %	4,6979 %	0,4398 %	0,6231 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.011.052,49	R\$ 116.137,71	R\$ 174.787,19
Resultado em %	-8,1154 %	-4,8201 %	-0,6455 %
Resultado em R\$	R\$ -1.977.703,21	R\$ -1.342.487,81	R\$ -183.394,31

Quadro 20.



6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

6.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos – TJAM/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 164.922.963,23	R\$ 165.316.616,54	0,3010	0,6645	0,2387	1,2085%	0,7204%	NC
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.147.395,42	R\$ 51.393.319,11	(0,4211)	0,6214	0,4808	0,6794%	1,5276%	NC
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 165.069.690,65	R\$ 166.177.172,23	0,3700	0,8398	0,6709	1,8919%	2,3377%	NC
BRANCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 42.225.861,55	R\$ 42.173.597,32	0,0900	0,9400	0,6000	1,6370%	0,8128%	7,2070%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 423.365.910,85	R\$ 425.060.705,20						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 10.024.801,05	R\$ 10.662.531,03	2,1311	0,7668	6,3615	9,4611%	9,5892%	NC
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 3.627.927,53	-	-	0,9200	0,9200%	0,9200%	NC
BRANCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 4.935.739,72	R\$ 5.212.825,60	4,0800	3,1900	5,6100	13,4253%	6,2852%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 14.960.540,77	R\$ 19.503.284,16						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 24.242.256,28	R\$ 27.369.067,06	3,8559	0,9813	(2,0071)	2,7701%	2,7701%	NC
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 24.242.256,28	R\$ 27.369.067,06						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.604.104,50	R\$ 29.083,42						
TOTAL	R\$ 466.172.812,40	R\$ 471.962.139,84						

Quadro 21.

Nota: Com base na Ata 174/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo Brasil Capital RP Institucional FIC FIA (40.129.41/0001-65).

6.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

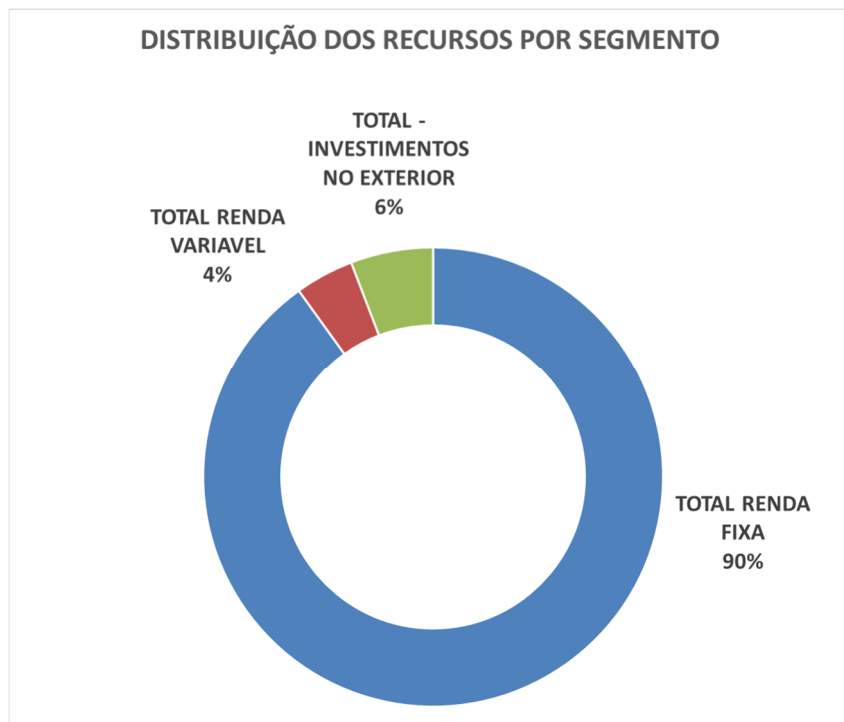


Gráfico 4.



6.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 05/2020		R\$ 37.685.324,46	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
06/2020	R\$ 2.652.044,89	R\$ 345.842,60	R\$ 2.306.202,29
07/2020	R\$ 3.093.956,95	R\$ 155.165,84	R\$ 2.938.791,11
08/2020	R\$ 3.115.630,27	R\$ 491.741,78	R\$ 2.623.888,49
09/2020	R\$ 381.166.785,90	R\$ 305.986,37	R\$ 380.860.799,53
10/2020	R\$ 3.325.215,77	R\$ 305.986,37	R\$ 3.019.229,40
11/2020	R\$ 3.555.836,55	R\$ 303.719,14	R\$ 3.252.117,41
12/2020	R\$ 6.779.546,58	R\$ 408.928,65	R\$ 6.370.617,93
01/2021	R\$ 3.459.800,94	R\$ 280.567,30	R\$ 3.179.233,64
02/2021	R\$ 3.471.253,44	R\$ 314.749,25	R\$ 3.156.504,19
03/2021	R\$ 3.427.904,40	R\$ 367.719,45	R\$ 3.060.184,95
04/2021	R\$ 3.574.036,92	R\$ 317.977,95	R\$ 3.256.058,97
05/2021	R\$ 3.591.371,99	R\$ 308.689,08	R\$ 3.282.682,91
Saldo dos Investimentos em 05/2021		R\$ 471.962.139,84	

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	8,0559 %	3,2185 %	0,8300 %
Juros	5,4500 %	2,2357 %	0,4432 %
Meta	13,9449 %	5,5262 %	1,2769 %
Rentabilidade em %	5,5764 %	0,9821 %	0,5377 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 16.970.504,56	R\$ 4.496.142,98	R\$ 2.506.644,53
Resultado em %	-7,3444 %	-4,3062 %	-0,7299 %
Resultado em R\$	R\$ -24.980.432,93	R\$ -20.801.546,04	R\$ -3.445.825,20

Quadro 22.

Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00. Documento Assinado por: ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento assinado por: LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 17/06/2021 12:28:00
 Documento assinado por: BELEN INEIDE OLIVEIRA em 17/06/2021 10:43:05
 Documento assinado por: NIVIAM JU em 17/06/2021 10:43:05
 Acesso: http://www.portaldossegurado.am.gov.br:85/validar e valide o código: NIVIAMJU



7. RECURSOS DO TCE – FPREV

7.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos – TCE/AM - FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 42.266.790,03	R\$ 42.367.676,28	0,3010	0,6645	0,2387	1,2085%	0,7204%	NC
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 30.873.500,00	R\$ 31.080.635,74	0,3700	0,8398	0,6709	1,8919%	1,5126%	NC
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.236.976,54	R\$ 21.339.086,83	(0,4211)	0,6214	0,4808	0,6794%	-0,7916%	NC
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.593.658,11	R\$ 7.639.537,21	0,0900	0,9400	0,6000	1,6370%	0,8128%	6,4748%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 101.970.924,68	R\$ 102.426.936,06						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 10.024.801,05	R\$ 10.662.531,03	2,1311	0,7668	6,3615	9,4611%	2,1687%	NC
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 980.128,91	-	-	0,9200	0,9200%	0,9200%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 524.924,17	R\$ 554.392,72	4,0800	3,1900	5,6100	13,4253%	13,4253%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 10.549.725,22	R\$ 12.197.052,66						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/04/2021	31/05/2021	mar/21	abr/21	mai/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 534.171,61	R\$ 523.450,12	3,8559	0,9813	(2,0071)	2,7701%	2,7701%	NC
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 534.171,61	R\$ 523.450,12						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 5.972,63	R\$ 7.463,96						
TOTAL	R\$ 113.060.794,14	R\$ 115.154.902,80						

Quadro 23.

Nota: Com base na Ata 174/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo Brasil Capital RP Institucional FIC FIA (40.129.41/0001-65).

7.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO

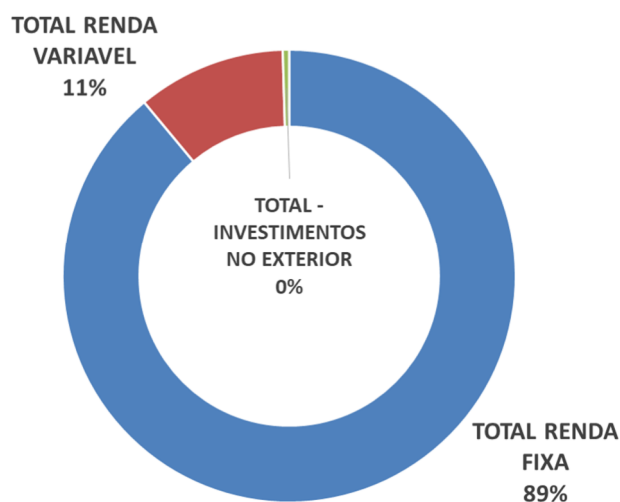


Gráfico 5.



Relatório de Investimentos – Maio/2021

020

7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 05/2020		R\$ 6.220.078,77	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
06/2020	R\$ 447.429,30	R\$ 0,00	R\$ 447.429,30
07/2020	R\$ 522.267,78	R\$ 0,00	R\$ 522.267,78
08/2020	R\$ 522.585,60	R\$ 0,00	R\$ 522.585,60
09/2020	R\$ 99.120.333,45	R\$ 0,00	R\$ 99.120.333,45
10/2020	R\$ 521.775,18	R\$ 0,00	R\$ 521.775,18
11/2020	R\$ 1.032.124,86	R\$ 0,00	R\$ 1.032.124,86
12/2020	R\$ 521.263,88	R\$ 0,00	R\$ 521.263,88
01/2021	R\$ 7.943,52	R\$ 0,00	R\$ 7.943,52
02/2021	R\$ 1.040.178,80	R\$ 0,00	R\$ 1.040.178,80
03/2021	R\$ 523.658,87	R\$ 0,00	R\$ 523.658,87
04/2021	R\$ 4.964,70	R\$ 0,00	R\$ 4.964,70
05/2021	R\$ 1.036.389,86	R\$ 67.687,34	R\$ 968.702,52
Saldo dos Investimentos em 05/2021		R\$ 115.154.902,80	

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %		Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês	
IPCA	8,0559 %	3,2185 %	0,8300 %	
Juros	5,4500 %	2,2357 %	0,4432 %	
Meta	13,9449 %	5,5262 %	1,2769 %	
Rentabilidade em %	4,9776 %	0,6457 %	0,9954 %	
Rentabilidade em R\$	R\$ 3.701.595,57	R\$ 727.791,55	R\$ 1.125.406,14	
Resultado em %	-7,8699 %	-4,6250 %	-0,2779 %	
Resultado em R\$	R\$ -6.535.890,94	R\$ -5.500.938,95	R\$ -318.245,09	

Quadro 24.

Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por BELEN LINDI em 17/06/2021 08:42:025
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por NIVIMJU em 17/06/2021 08:42:025



8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 05/2020		R\$ 5.032.998.873,13	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
06/2020	R\$ 38.120.534,15	R\$ 156.958.744,17	R\$ -118.838.210,02
07/2020	R\$ 38.874.890,07	R\$ 124.433.923,06	R\$ -85.559.032,99
08/2020	R\$ 45.682.773,56	R\$ 99.608.522,46	R\$ -53.925.748,90
09/2020	R\$ 522.856.507,35	R\$ 110.053.586,29	R\$ 412.802.921,06
10/2020	R\$ 45.395.118,01	R\$ 112.503.349,21	R\$ -67.108.231,20
11/2020	R\$ 46.902.795,82	R\$ 116.701.131,09	R\$ -69.798.335,27
12/2020	R\$ 129.523.150,14	R\$ 176.448.361,04	R\$ -46.925.210,90
01/2021	R\$ 7.353.548,08	R\$ 82.470.359,61	R\$ -75.116.811,53
02/2021	R\$ 48.107.390,60	R\$ 45.350.304,34	R\$ 2.757.086,26
03/2021	R\$ 48.138.137,76	R\$ 11.092.869,41	R\$ 37.045.268,35
04/2021	R\$ 47.625.538,29	R\$ 10.441.370,66	R\$ 37.184.167,63
05/2021	R\$ 48.721.181,28	R\$ 14.868.417,77	R\$ 33.852.763,51
Saldo dos Investimentos em 05/2021		R\$ 5.800.359.288,35	

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	8,0559 %	3,2185 %	0,8300 %
Juros	5,4500 %	2,2357 %	0,4432 %
Meta	13,9449 %	5,5262 %	1,2769 %
Rentabilidade em %	15,2861 %	3,3091 %	1,7183 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 760.989.789,22	R\$ 183.486.683,60	R\$ 97.411.209,04
Resultado em %	+1,1770 %	-2,1010 %	+0,4358 %
Resultado em R\$	R\$ +66.760.215,54	R\$ -122.935.015,99	R\$ +25.023.636,55

Quadro 25.

Nota 1: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se ao pagamento de inativos e pensionistas.

Nota 2: Foram revisados os valores de **Receitas** e **Despesas**, com base nos Controles da GERA/COFIN, para o exercício de 2021

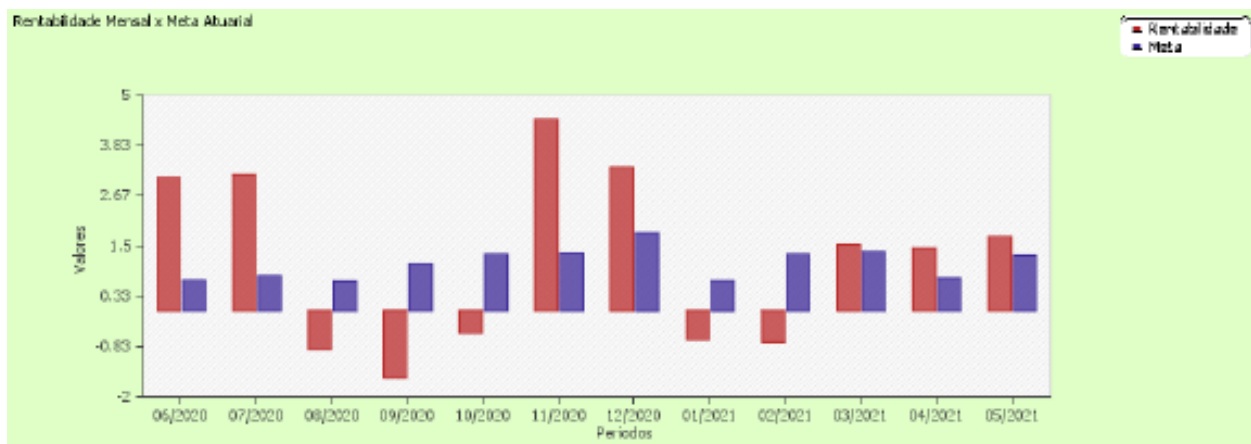


Gráfico 6.



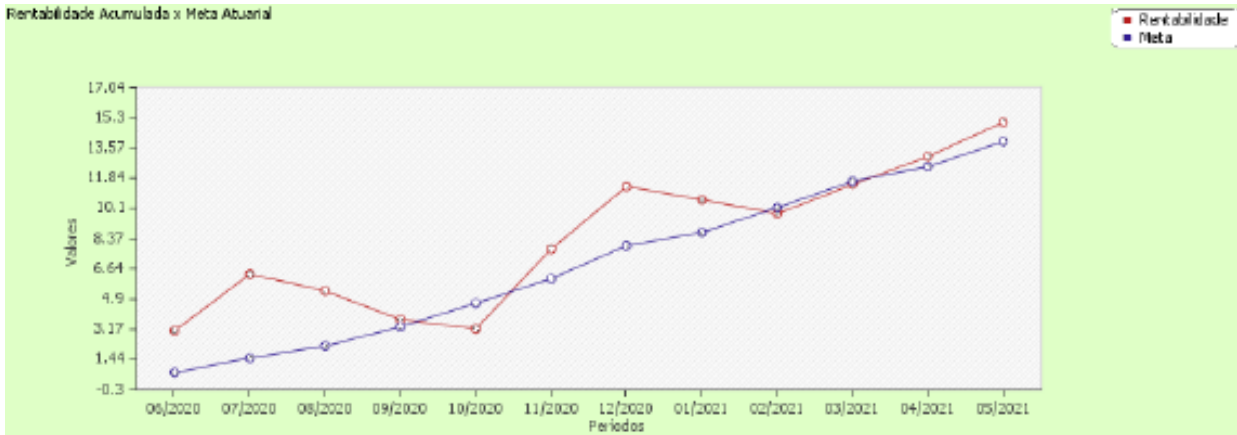


Gráfico 7.

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.040.480,01	R\$ 1.274.283,74
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 5.340.192,64	R\$ 5.582.262,78
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 16.242.100,86	R\$ 13.343.483,51
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 308.936,37	R\$ 305.738,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 10.627,28	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 22.942.337,18	R\$ 20.505.769,67

Quadro 26.

Nota: Os valores recebidos de Contribuição no FFIN são utilizados no pagamento das folhas de aposentados e pensionistas dessa massa previdenciária.

9.2 Fundo Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ -	R\$ -
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ 2.162,62	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 0,68	R\$ 168,69
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 9.948,20	R\$ 9.834,30
TOTAL	R\$ 12.111,50	R\$ 10.002,99

Quadro 27.

Nota: Com base nos termos da LC 206/2020 que, dentre outros, cria o Fundo Temporário - FTEMP a partir dos recursos de contribuição dos servidores militares do FPREV, com finalidade de pagamento dos inativos e pensionistas do FFIN e do FPPM.



Relatório de Investimentos – Maio/2021

023

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 25,36	R\$ 25,36
TOTAL	R\$ 25,36	R\$ 25,36

Quadro 28.

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 409.014,46	R\$ 412.359,09
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 93.123,14	R\$ 51.569,84
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 502.137,60	R\$ 463.928,93

Quadro 29.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.132.235,53	R\$ 680.549,26
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 432.893,82	R\$ 229.282,19
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 1.565.129,35	R\$ 909.831,45

Quadro 30.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.070.337,86	R\$ 4.542.357,65
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 1.073.984,96	R\$ 557.967,58
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 5.062.814,81	R\$ 1.624.673,55
TOTAL	R\$ 7.207.137,63	R\$ 6.724.998,78

Quadro 31.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 81.628,55	R\$ 1.213.781,25
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 994.306,06	R\$ 866.841,75
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 12.336,66
TOTAL	R\$ 1.075.934,61	R\$ 2.092.959,66

Quadro 32.

Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 17/06/2021 08:15:44
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por BELEN LUIS ANDRE em 17/06/2021 08:42:02
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por NIVIM JUI em 17/06/2021 08:42:02
 Acesso: http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar e valide o código: N1W1MJU



10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 705.803,46	R\$ 911.942,45
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 49.310.422,64	R\$ 49.428.121,30
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 50.016.227,10	R\$ 50.340.064,75

Quadro 33.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 470.143,79	R\$ 507.455,93
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 470.143,79	R\$ 507.455,93

Quadro 34.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 282.149,67	R\$ 33.801,14
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 282.149,67	R\$ 33.801,14

Quadro 35.

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.526.272,75	R\$ 27.248,77
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 1.526.272,75	R\$ 27.249,77

Quadro 36.

10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/04/2021	31/05/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 575.002,36	R\$ 81.232,92
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 575.002,36	R\$ 81.232,92

Quadro 37.

TOTAL GERAL	R\$ 52.869.795,67	R\$ 50.989.804,51
--------------------	--------------------------	--------------------------



Relatório de Investimentos – Maio/2021

025

11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TN	R\$ 697.895.792,65	12,30%	10,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 697.895.792,65				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 6.997.434,14	35,62%	22,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 461.471.427,08				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 487.767.664,69				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.661.741,13				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 810.419.405,41				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 110.183.706,13				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 61.419.004,11				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 29.058.535,94				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 2.020.978.918,63				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 13.512.681,10	10,67%	13,00%	40,00%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 5.582.262,78				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.360.369,49				
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.833.020,97				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 477.794.511,67				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.995,35				
TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 605.191.841,36				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 30.407.911,86	0,54%	3,00%	5,00%	art 7º, inciso VII, "b"
TOTAL art 7º, inciso VII, "b"	R\$ 30.407.911,86				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.354.474.464,50	59,13%			

Quadro 38.

Documento assinado eletronicamente em 17/06/2021 13:23:47
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:00
 Documento Assinado por: COSTA NOVO em 15:44:22
 Documento Assinado por: LUIS CARLOS DE S. CARVALHO em 17/06/2021 08:15:44
 Documento Assinado por: ANDRÉ LUIS FERREIRA em 17/06/2021 08:42:02



Relatório de Investimentos – Maio/2021

026

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 98.216.758,09	1,73%	3,00%	30,00%	art 8º, inciso I, "a"
TOTAL art 8º, inciso I, "a"	R\$ 98.216.758,09				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESA FIC FIA	R\$ 43.128.348,39	28,86%	30,00%	30,00%	art. 8º, inciso II, "a"
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 190.971.998,03				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 135.811.375,61				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 57.362.821,02				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ -				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 193.738.622,58				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 131.024.425,92				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 191.460.104,93				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 346.186.782,15				
SANTANDER IBOVESA ATIVO AÇÕES	R\$ -				
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 49.607.233,30				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.766,73				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 94.449.442,15				
OCCAM FIC FIA	R\$ 141.091.610,42				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 35.041.502,84				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 17.357.203,07				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 10.099.103,74				
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 10.045.992,02				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 10.718.537,19				
TOTAL art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.658.110.870,09				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 24.427.190,18	1,02%	3,00%	3,00%	art. 8º, inciso III
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 33.653.211,39				
TOTAL art. 8º, inciso III	R\$ 58.080.401,57				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 6.709.274,31	0,12%	2,00%	5,00%	art. 8º, inciso IV, "a"
TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 6.709.274,31				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.821.117.304,06	31,73%			

Quadro 39.

11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 50.356.870,26	4,99%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 137.832.828,22				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 28.486.055,03				
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.417.077,27				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 31.933.750,22				
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 283.026.581,00				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 78.143.938,43	3,78%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 136.429.497,55				
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 214.573.435,98				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 497.600.016,98	8,77%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.673.191.785,54	100%			

Quadro 40.

Documento assinado eletronicamente em 17/06/2021 13:23:47
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:00
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 17/06/2021 12:28:00
 Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento Assinado por: ANIELLE LUIS REZENDE em 17/06/2021 08:43:02
 Documento Assinado eletronicamente em 02/05/2021
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
 Acesso: http://www.portalidosegurado.am.gov.br:85/validar
 e valide o código: N1W1M1U



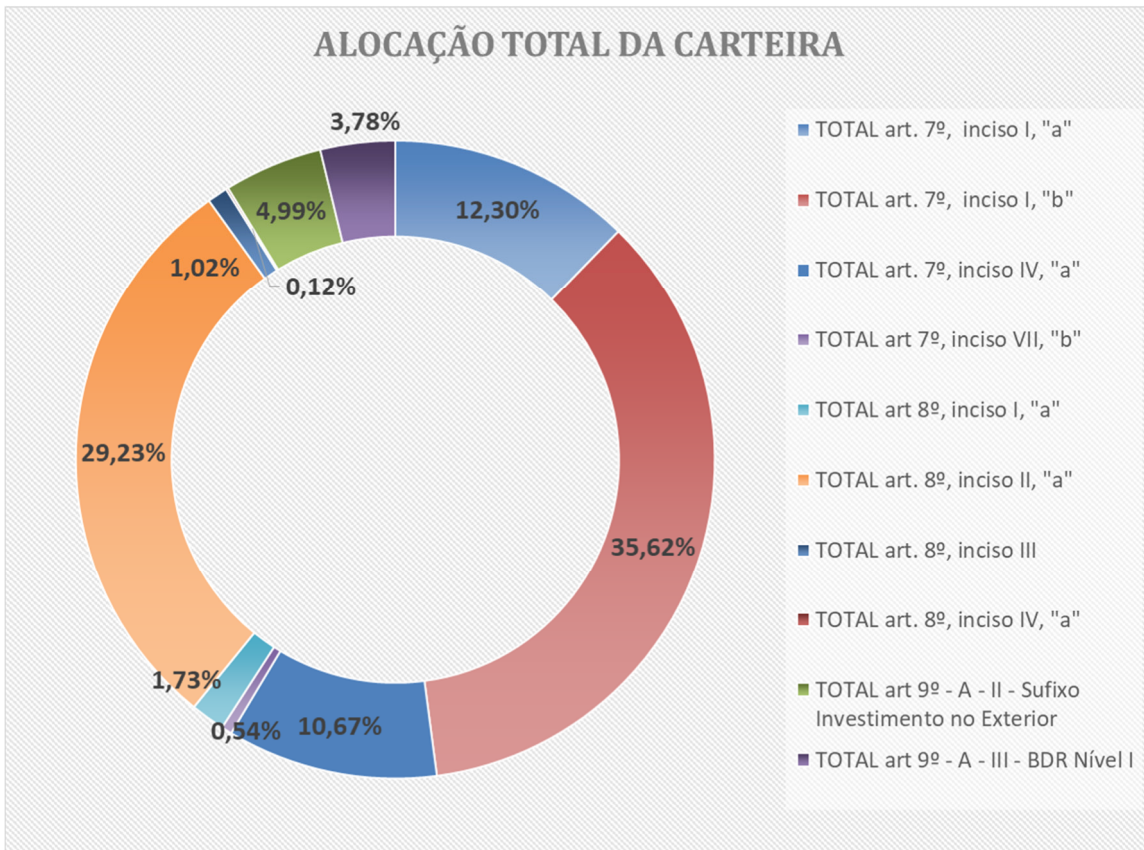


Gráfico 8.

Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 Documento assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40



Relatório de Investimentos – Maio/2021

028

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN n° 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 6.997.434,14	0,12%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 461.471.427,08	7,93%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 477.794.511,67	8,21%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 135.811.375,61	2,33%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 78.143.938,43	1,34%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 50.356.870,26	0,86%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 487.767.664,69	8,38%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.661.741,13	0,92%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 13.512.681,10	0,23%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 5.582.262,78	0,10%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.360.369,49	1,02%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.833.020,97	0,84%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 98.216.758,09	1,69%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 190.971.998,03	3,28%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.995,35	0,00%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 810.419.405,41	13,92%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 43.128.348,39	0,74%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 193.738.622,58	3,33%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 131.024.425,92	2,25%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 57.362.821,02	0,99%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ -	0,00%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 191.460.104,93	3,29%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 30.407.911,86	0,52%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 110.183.706,13	1,89%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 61.419.004,11	1,05%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 346.186.782,15	5,95%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 6.709.274,31	0,12%	
SANTANDER CRESCE SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.766,73	0,00%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 49.607.233,30	0,85%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 137.832.828,22	2,37%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 10.718.537,19	0,18%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 24.427.190,18	0,42%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 29.058.535,94	0,50%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 136.429.497,55	2,34%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 94.449.442,15	1,62%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 141.091.610,42	2,42%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 35.041.502,84	0,60%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 10.099.103,74	0,17%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.417.077,27	0,59%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 31.933.750,22	0,55%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 17.357.203,07	0,30%	
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 33.653.211,39	0,58%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 10.045.992,02	0,17%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 28.486.055,03	0,49%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 4.975.295.992,89		

Quadro 41.

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.

Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:30 por ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento assinado por: ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:30 Documento assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado por: LUIS CARLOS COSTA NOVO em 16/06/2021 12:23:30 Documento assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento assinado por: ANIBAL CARLOS REIS em 17/06/2021 08:42:02 e valide o código: N1W1MJU



Relatório de Investimentos – Maio/2021

029

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010	
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 6.997.434,14	19.523.305/0001-06	R\$ 243.755.972,49	2,87%	15%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 461.471.427,08	13.322.205/0001-35	R\$ 10.138.018.656,56	4,55%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 477.794.511,67	25.078.994/0001-90	R\$ 9.352.083.339,27	5,11%		
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 135.811.375,61	29.258.294/0001-38	R\$ 1.239.265.853,51	10,96%		
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 78.143.938,43	21.470.644/0001-13	R\$ 1.405.843.228,00	5,56%		
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 50.356.870,26	17.413.636/0001-68	R\$ 2.061.193.085,68	2,44%		
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 13.512.681,10	08.246.263/0001-97	R\$ 422.575.546,62	3,20%		
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 5.582.262,78	03.399.411/0001-90	R\$ 3.189.338.399,07	0,18%		
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.360.369,49	20.216.216.0001/04	R\$ 1.166.601.720,84	5,09%		
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.833.020,97	28.515.874/0001-09	R\$ 1.440.715.539,33	3,39%		
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 98.216.758,09	14.099.976/0001-78	R\$ 741.142.983,40	13,25%		
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 190.971.998,03	06.988.623/0001-09	R\$ 2.367.208.838,54	8,07%		
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 487.767.664,69	11.060.913/0001-10	R\$ 14.343.181.790,80	3,40%		
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.661.741,13	22.791.074/0001-26	R\$ 218.992.447,21	24,50%		
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 810.419.405,41	23.215.097/0001-55	R\$ 15.989.068.973,83	5,07%		
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 57.362.821,02	10.577.512/0001-79	R\$ 596.784.973,24	9,61%		
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.995,35	21.838.150/0001-49	R\$ 3.524.278.161,54	0,00%		
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 43.128.348,39	08.817.414/0001-10	R\$ 1.064.104.213,35	4,05%		
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ -	23.731.629/0001-07	R\$ 766.853.600,64	0,00%		
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 193.738.622,58	24.571.992/0001-75	R\$ 3.647.662.719,96	5,31%		
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 131.024.425,92	01.063.897/0001-65	R\$ 1.265.139.792,64	10,36%		
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 49.607.233,30	29.549.642/0001-26	R\$ 1.490.592.815,27	3,33%		
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.766,73	02.436.763/0001-05	R\$ 389.089.997,43	0,00%		
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ -	01.699.688/0001-02	R\$ 566.151.716,74	0,00%		
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 137.832.828,22	17.804.792/0001-50	R\$ 2.095.539.749,93	6,58%		
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 191.460.104,93	08.279.304/0001-41	R\$ 1.544.528.590,29	12,40%		
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 110.183.706,13	10.922.432/0001-03	R\$ 1.186.246.924,38	9,29%		
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 61.419.004,11	10.756.541/0001-06	R\$ 956.924.201,33	6,42%		
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 29.058.535,94	30.659.168/0001-74	R\$ 1.493.951.335,83	1,95%		
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 346.186.782,15	11.977.794/0001-64	R\$ 3.105.254.686,62	11,15%		
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 136.429.497,55	19.436.818/0001-80	R\$ 3.113.492.656,10	4,38%		
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 94.449.442,15	34.791.108/0001-61	R\$ 2.338.103.356,23	4,04%		
OCCAM FIC FIA	R\$ 141.091.610,42	11.628.883/0001-03	R\$ 1.227.137.752,21	11,50%		
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 35.041.502,84	11.458.144/0001-02	R\$ 832.180.544,56	4,21%		
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 10.718.537,19	15.603.945/0001-75	R\$ 605.400.421,31	1,77%		
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.417.077,27	37.331.285/0001-53	R\$ 21.116.682.509,00	0,16%		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 31.933.750,22	37.331.299/0001-77	R\$ 36.006.078.386,25	0,09%		
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 10.099.103,74	09.290.813/0001-38	R\$ 120.082.988,59	8,41%		
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 10.045.992,02	12.239.939/0001-92	R\$ 324.965.249,15	3,09%		
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 17.357.203,07	40.129.641/0001-65	R\$ 675.447.685,20	2,57%		
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 28.486.055,03	37.308.394/0001-50	R\$ 10.570.429.877,80	0,27%		
TOTAL	R\$ 4.880.098.405,15					

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 24.427.190,18	21.595.829/0001-54	R\$ 1.262.605.380,99	1,93%	5%
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 33.653.211,39	26.269.692/0001-61	R\$ 1.990.710.655,11	1,69%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 6.709.274,31	35.640.811/0001-31	R\$ 480.978.215,53	1,39%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 30.407.911,86	19.719.727/0001-51	R\$ 1.006.509.137,45	3,02%	
TOTAL	R\$ 95.197.587,74				

TOTAL	R\$ 4.975.295.992,89
--------------	-----------------------------

Quadro 42.



Relatório de Investimentos – Maio/2021

030

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. Nesse caso, registra-se o fundo Bradesco IBRX Alpha (14.099.976/0001-78);

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

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA ABRIL/2021) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (ABRIL/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
CAIXA	R\$ 419.468,06	R\$ 1.409.211.632,25	0,3360%	5%
BB DTVM S.A	R\$ 1.238.224,68	R\$ 1.210.575.557,19	0,0978%	
BRDESCO	R\$ 536.544,18	R\$ 416.477.090,46	0,0776%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 32.109,08	R\$ 393.470.727,03	1,2254%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 756.844,71	R\$ 401.653.603,63	0,0531%	
BANCO BTG	R\$ 206.369,96	R\$ 362.995.160,20	0,1759%	
BANCO SAFRA	R\$ 105.867,82	R\$ 189.915.223,67	0,1794%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 289.883,41	R\$ 187.455.828,25	0,0647%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 16.289,77	R\$ 141.091.610,42	0,8661%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 15.413,33	R\$ 94.449.442,15	0,6128%	
PLURAL INVEST GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 31.162,37	R\$ 66.350.827,49	0,2129%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 28.001,98	R\$ 35.041.502,84	0,1251%	
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA	R\$ 25.524,19	R\$ 28.486.055,03	0,1116%	
VINCI PARTNERS	R\$ 41.735,27	R\$ 10.718.537,19	0,0257%	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	R\$ 55.199,52	R\$ 10.045.992,02	0,0182%	
BRASIL CAPITAL	R\$ 8.954,62	R\$ 17.357.203,07	0,1938%	

Quadro 43.

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 bimestralmente, para o Gestores de Recursos de Terceiros.

Documento assinado eletronicamente em 17/06/2021 13:23:47
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 15:15:27
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:00
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento Assinado por: LUIS CARLOS DE S. CARVALHO em 17/06/2021 12:23:00
 Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento Assinado por: BELEN LUIS DE... em 17/06/2021 08:43:02



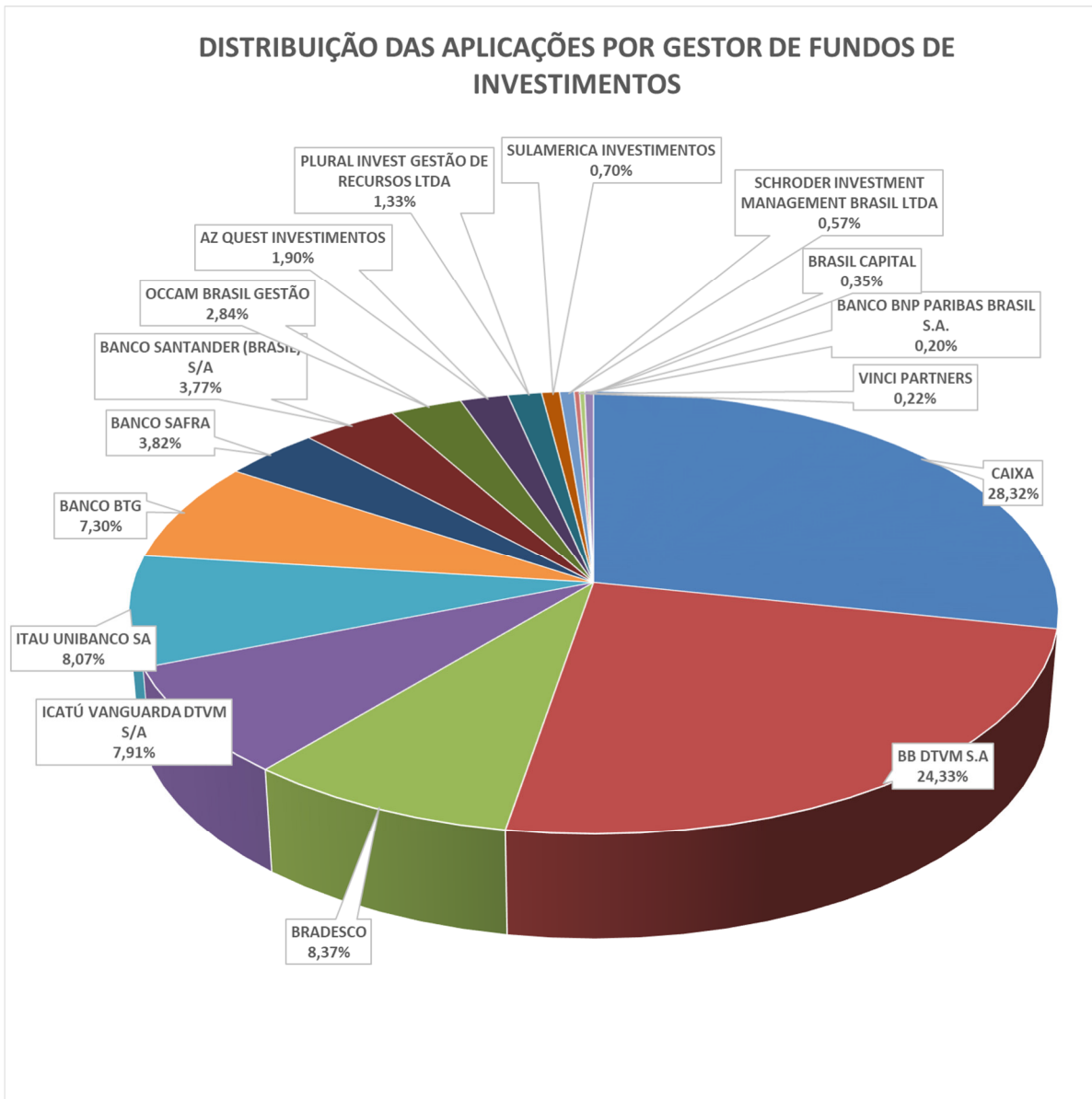


Gráfico 9.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.975.295.992,90
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 697.895.792,65
TÍTULOS - CVS	R\$ 9.723.372,00
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ 60.000.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 77.306.126,97
TOTAL	R\$ 5.882.056.609,70

Quadro 44.

Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Acesso: http://www.portalidosegurado.am.gov.br:85/validar e valide o código: N1W1MJU



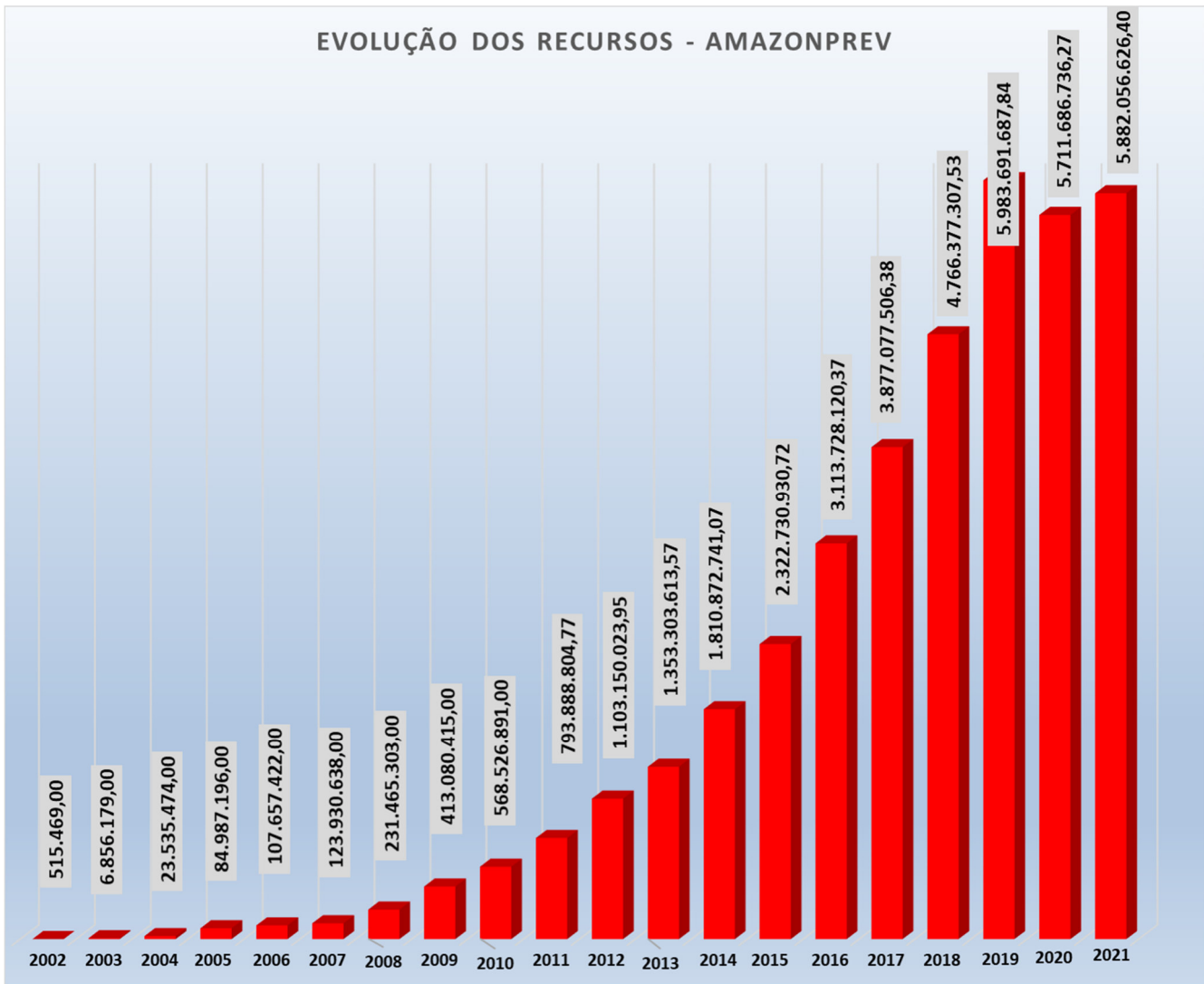


Gráfico 10.



13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: Ratear entre os fundos SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF (30.659.168/0001-74) e ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF (10.756.541/0001-06)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2021
FPREV ALE:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO (21.595.829/0001-54)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2021
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO (21.595.829/0001-54)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2021
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO (21.595.829/0001-54)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2021
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO (21.595.829/0001-54)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2021
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO (21.595.829/0001-54)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2021
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE)	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2021
RECURSOS COMPREV	Direcionar para o fundo Bradesco DI Premium RF.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2021
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos repassados pelo Poder Executivo, devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica. Aos valores repassados pelos demais órgãos serão mantidas as aplicações atuais. Havendo necessidade, a GERAF/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/07/2021

Quadro 45.

Nota: O Plano de Ação Mensal refere-se às ações programadas para o próximo período conforme registro em Ata de Reunião do Comitê.

Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40

Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado eletronicamente em 16/06/2021 12:23:00 por ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40





AMAZONPREV
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2021

RELATÓRIO DE RISCOS FPREV - AMAZONPREV

Documento assinado eletronicamente em 6/2025/2021
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: N1W1MJU

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:00
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 13:23:47
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40



Relatório de Investimentos – Maio/2021

035

						12M	mai/21	2021
SALDOS E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - FPREV AMAZONPREV	TOTAL APLICADO	CNPJ	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocação Ativa FcFI	R\$ 477.794.511,67	25.078.994/0001-90	2,94%	0,30%	-2,14	3,44%	0,48%	-0,79%
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 6.997.434,14	19.523.305/0001-06	1,62%	0,17%	-0,71	6,86%	0,75%	1,83%
Bradesco Fc FI RF Alocação Dinâmica	R\$ 48.833.020,97	28.515.874/0001-09	3,15%	0,33%	-2,49	2,64%	0,42%	-1,13%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ 59.360.369,49	20.216.216/0001-04	2,61%	0,27%	-1,52	6,49%	0,60%	0,82%
Bradesco FI RF Maxi Poder Público	R\$ 3.827.668,90	08.246.263/0001-97	0,32%	0,03%	-0,55	1,61%	0,27%	0,87%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 53.661.741,13	22.791.074/0001-26	4,97%	0,51%	-4,08	1,59%	0,53%	-1,95%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 487.767.664,69	11.060.913/0001-10	2,43%	0,25%	-1,22	7,10%	0,67%	1,31%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 760.991.284,11	23.215.097/0001-55	2,36%	0,24%	-1,49	3,45%	0,24%	0,72%
Icatu Vang FI RF Inflação Cred Priv LP	R\$ 30.407.911,86	19.719.727/0001-51	3,00%	0,31%	-1,36	10,19%	0,81%	2,21%
Icatu Vanguardia Inflação Curta FI RF LP	R\$ 110.183.706,13	10.922.432/0001-03	2,49%	0,26%	-1,23	6,90%	0,65%	1,23%
Icatu Vang Inflação Longa FI RF LP	R\$ 61.419.004,11	10.756.541/0001-06	9,13%	0,94%	-7,51	10,32%	1,35%	-3,51%
Itau Insit Alocação Dinâmica RF FICFI	R\$ 108.995,35	21.838.150/0001-49	0,53%	0,05%	-0,57	1,75%	0,27%	0,72%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 29.058.535,94	30.659.168/0001-74	6,93%	0,72%	-5,22	7,73%	1,32%	-2,44%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 461.741.427,08	13.322.205/0001-35	2,23%	0,23%	-1,10	7,77%	0,67%	1,51%
TOTAL	R\$ 2.592.153.275,57							

						12M	mai/21	2021
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	TOTAL APLICADO	CNPJ	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Valor Fc FIA	R\$ 135.811.375,61	29.258.294/0001-38	21,78%	2,25%	-15,12	46,39%	5,69%	5,34%
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 50.356.870,26	17.413.636/0001-68	22,66%	2,35%	-8,48	43,96%	-2,01%	14,44%
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nivel I	R\$ 78.143.938,43	21.470.644/0001-13	22,21%	2,29%	-12,65	31,22%	-2,63%	11,00%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 190.971.998,03	06.988.623/0001-09	20,84%	2,15%	-10,66	41,90%	8,31%	12,54%
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	R\$ 98.216.758,09	14.099.976/0001-78	21,05%	2,17%	-10,90	44,48%	5,61%	6,28%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 346.186.782,15	11.977.794/0001-64	21,07%	2,18%	-7,35	33,85%	3,64%	3,14%
BTG Pactual Economia Real FIP	R\$ 6.709.274,31	11.708.029/0001-49						
Caixa FIA Consumo	R\$ 57.362.821,02	10.577.512/0001-79	22,46%	2,32%	-10,65	25,77%	6,36%	2,17%
Icatu Vanguardia Dividendos FIA	R\$ 191.460.104,93	08.279.304/0001-41	19,47%	2,01%	-13,55	27,00%	5,26%	3,92%
Itau Acoes Dunamis Fc	R\$ 193.738.622,58	24.571.992/0001-75	20,26%	2,09%	-8,11	50,35%	7,67%	12,46%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 43.128.348,39	08.817.414/0001-10	20,60%	2,12%	-10,50	40,30%	5,11%	5,45%
Itau Small Cap Master FIA	R\$ 131.024.425,92	30.419.172/0001-65	22,23%	2,30%	-9,56	60,39%	4,68%	14,09%
Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	R\$ 15.766,73	02.436.763/0001-05	21,57%	2,22%	-9,67	35,10%	6,08%	1,56%
Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	R\$ 49.607.233,30	29.549.642/0001-26	21,56%	2,22%	-9,67	35,15%	6,08%	1,60%
Santander Global Equities Dólar Master Mult Ie FI	R\$ 137.832.828,22	17.804.792/0001-50	19,95%	2,06%	-8,91	37,52%	-3,51%	10,50%
Safra S P Reais Pb FI Mult	R\$ 24.427.190,18	21.595.829/0001-54	16,45%	1,69%	-9,70	36,10%	0,42%	12,76%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	R\$ 136.429.497,55	19.436.818/0001-80	21,88%	2,26%	-11,99	30,62%	-3,41%	10,74%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 94.449.442,15	34.791.108/0001-61	21,88%	2,26%	-12,63	46,81%	4,68%	11,49%
Occam Fc de FIA	R\$ 141.091.610,42	11.628.883/0001-03	21,77%	2,25%	-11,03	42,51%	4,38%	5,12%
Sul America Equities FIA	R\$ 35.041.502,84	11.458.144/0001-02	21,37%	2,20%	-14,89	31,57%	6,62%	4,11%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	R\$ 28.486.055,03	37.308.394/0001-50			-8,49		-1,72%	13,54%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 10.099.103,74	09.290.813/0001-38	20,21%	2,09%	-12,07	26,08%	2,93%	2,98%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 31.933.750,22	37.331.365/0001-09			-10,83		-6,90%	-2,31%
Vinci Selection Equities FIA	R\$ 10.718.537,20	15.603.945/0001-75	18,86%	1,95%	-10,60	37,41%	5,98%	5,74%
Brasil Capital Master 30 II FIA	R\$ 17.357.203,07	38.596.967/0001-50	21,32%	2,20%	-9,05	44,66%	1,18%	2,41%
BNP Paribas Master Acoes FI	R\$ 10.045.992,02	16.848.063/0001-32						
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	R\$ 33.653.211,39	26.269.692/0001-61	16,80%	1,73%	-9,74	37,34%	0,39%	13,10%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 34.417.077,27	37.331.342/0001-02			-8,60		-3,23%	2,48%
TOTAL	R\$ 2.318.717.321,05							

TOTAL GERAL	R\$ 4.910.870.596,62							
--------------------	-----------------------------	--	--	--	--	--	--	--

Quadro 1.

Fonte: Econômica, base Extratos de Posição Mensal dos Investimentos – FPREV Amazonprev.

Nota 1: VOLATILIDADE: Volatilidade é o nome que se dá ao Desvio Padrão dos retornos de um ativo. Dessa forma, a Volatilidade mede o quanto os retornos diários se afastam do retorno médio do período analisado. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio.

Nota 2: VALUE at RISK (95%): Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição normal. Dado o

Documento assinado eletronicamente em 17/06/2021 13:23:47
 Documento assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento assinado por: ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:00
 Documento assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento assinado por: LUIS CARLOS FERREIRA COSTA NOVO em 16/06/2021 12:22:00
 Documento assinado por: LEONARDO A. DE S. CARVALACARNEIRO em 16/06/2021 12:22:00
 Documento assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento assinado por: ANIBAL DE LIMA REBELINHO em 17/06/2021 08:44:02
 Documento assinado por: NITIMUJI em 17/06/2021 08:44:02



Desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo médio da carteira será de 4,63%.

Nota 3: DRAWDOWN: Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período. Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, conseqüentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

Nota 4: ÍNDICE SHARPE: Quantifica a relação entre a Volatilidade da Carteira e seu retorno excedente a um ativo livre de risco, nesse caso, o CDI. Assim, esse indicador aponta o percentual de rentabilidade que a Carteira teve acima do CDI devido à sua maior exposição ao risco. Logo, quanto maior o Sharpe, melhor o desempenho da Carteira, enquanto valores negativos significam que o CDI superou a rentabilidade da Carteira no período. Sua função é mensurar a relação risco x retorno de uma aplicação, de modo que seu valor representa quanto você ganha em termos percentuais para cada 1,00% de risco assumido acima do CDI. Valores acima de 0,5 costumam ser adequados.

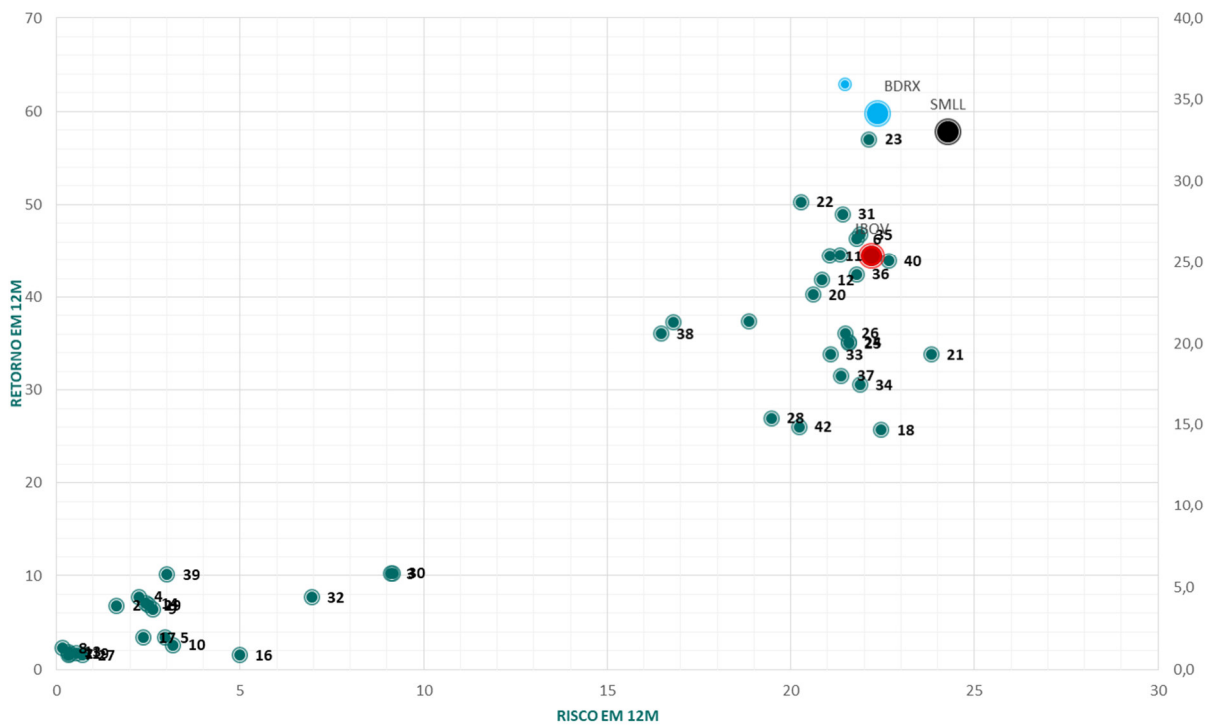


Gráfico 1: Análise Risco x Retorno (12 M)



Relatório de Investimentos – Maio/2021

Nº	Fundos	Código	Retorno	Volatilidade
1	BB Prev RF Irf M1 Tit Publ Fc	239003<BraNa>	1,73	0,34
2	BB Prev RF Tit Publ VII FI	390739<BraNa>	6,86	1,62
3	BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	272620<BraNa>	10,29	9,09
4	BB Prev RF Idka 2 FI	272612<BraNa>	7,77	2,23
5	BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfi	423041<BraNa>	3,44	2,94
6	BB Acoes Valor Fc FIA	458236<BraNa>	46,39	21,78
7	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	179991<BraNa>	1,61	0,32
8	Bradesco FI RF Ref DI Premium	071171<BraNa>	2,33	0,16
9	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	374131<BraNa>	6,49	2,61
10	Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	456306<BraNa>	2,64	3,15
11	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	326712<BraNa>	44,48	21,05
12	Bradesco FIA Mid Small Caps	131679<BraNa>	41,90	20,84
13	FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF	248975<BraNa>	1,89	0,32
14	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	251496<BraNa>	7,10	2,43
15	Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF	401854<BraNa>		
16	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	401862<BraNa>	1,59	4,97
17	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	427683<BraNa>	3,45	2,36
18	Caixa FIA Consumo	302198<BraNa>	25,77	22,46
19	Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	399892<BraNa>	1,75	0,53
20	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	208507<BraNa>	40,30	20,60
21	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	424838<BraNa>	33,87	23,82
22	Itau Acoes Dunamis Fc	423701<BraNa>	50,35	20,26
23	Small Cap Valuation Fc Acoes	025127<BraNa>	57,04	22,12
24	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	464066<BraNa>	35,15	21,56
25	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	053872<BraNa>	35,10	21,57
26	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	055840<BraNa>	36,14	21,48
27	Santander RF Ativo Fc FI	440264<BraNa>	1,56	0,69
28	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	173126<BraNa>	27,00	19,47
29	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	231932<BraNa>	6,90	2,49
30	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	244953<BraNa>	10,32	9,13
31	Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	127558<BraNa>	49,01	21,40
32	Safra Ima Institucional Fc FI RF	478180<BraNa>	7,73	6,93
33	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	252311<BraNa>	33,85	21,07
34	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	359130<BraNa>	30,62	21,88
35	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	520772<BraNa>	46,81	21,88
36	Occam Fc de FIA	378100<BraNa>	42,51	21,77
37	Sul America Equities FIA	255173<BraNa>	31,57	21,37
38	Safra S P Reais Pb FI Mult	401447<BraNa>	36,10	16,45
39	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	367354<BraNa>	10,19	3,00
40	BB Mult Global Select Equity Ie FI	349208<BraNa>	43,96	22,66
41	BTG Pactual Economia Real FIP	249688<BraNa>		
42	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	206032<BraNa>	26,08	20,21
43	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	548049<BraNa>		
44	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	559024<BraNa>		
45	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	557862<BraNa>		
46	Vinci Selection Equities FIA	320196<BraNa>	37,41	18,86
47	Brasil Capital Master 30 II FIA	564680<BraNa>	44,66	21,32
48	BNP Paribas Master Acoes FI	318256<BraNa>		
49	Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	433756<BraNa>	37,34	16,80

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.



2. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

DATA BASE EM 31.05.21

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,62	1,71%	59,7%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,77	1,57%	16,5%
CDB	1,42	0,71%	0,0%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	1,08	1,76%	1,0%
BOND	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,80	-	17,9%
Over	0,00	-	4,9%
Carteira Crédito	3,41	1,68%	77,2%
Crédito - Contribuição Fundo	1,42	1,29%	77,2%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	2,86	1,29%	100,0%

Quadro 03

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financeiro	% PL
AAA	212.367.863	21,1%
AA+	147.459.196	14,6%
AA	159.917.714	15,9%
AA-	129.264.959	12,8%
A+	66.686.746	6,6%
DPGE	0	0,0%
A	0	0,0%
A-	18.635.483	1,8%
BBB+	0	0,0%
BBB	0	0,0%
BBB-	0	0,0%
BB+	0	0,0%
BB	0	0,0%
BB-	0	0,0%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	10.126.427	1,0%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Rating	33.605.489	3,3%
Tesouro / Over	229.758.537	22,8%
Total	1.007.822.414	100,0%

* Rating Externo é o menor rating atribuído entre o S&P, Moody's e Fitch.

Quadro 04.

TABELA - SETOR		
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	199.563.711	19,8%
Bancos	166.722.845	16,5%
Saneamento	96.306.889	9,6%
Conc. Rodoviárias	81.251.894	8,1%
Serviço	72.093.690	7,2%
Varejo	54.875.026	5,4%
Shopping Center	35.436.836	3,5%
Logística	22.928.225	2,3%
Infraestrutura	13.317.208	1,3%
Indústria e Comércio	12.774.233	1,3%
Mineração e Siderurgia	10.998.576	1,1%
Óleo e Gás	7.637.990	0,8%
Papel e Celulose	4.156.753	0,4%
Tesouro / Over	229.758.537	22,8%
Total	1.007.822.414	100,0%

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLACÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 31/05/2021)

Documento assinado eletronicamente em 17/06/2021 13:23:47
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 13:23:47
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 16/06/2021 12:28:00
 Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B. NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:00
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CARVALHO em 16/06/2021 12:28:00
 Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 15 de junho de 2021, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de maio/2021, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

O Relatório da Carteira da Amazonprev reflete os resultados sobre as decisões de investimentos e alocações deliberadas no período, com base em análise de Cenário Econômico e Estratégia de Alocação proposta pelo Comitê de Investimentos devidamente alinhada aos termos da Política de Investimentos aprovada para o exercício atual.

Todas as operações efetuadas, são acompanhadas pelo Controles Internos, e aprovadas pela Diretoria, com base nas Atas de Reunião do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 17 de maio de 2021.

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Bruno Barroso
Membro

Leonardo Cavalcanti
Membro

Andreza de Souza Silva
Membro

Claudinei Soares
Membro

André Luiz Bentes
Membro

Marcos Souza
Membro



APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - COFIS

Com base nos termos do Parecer do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev, acima emitido, bem com análise das informações constantes do Relatório de Investimentos e Riscos das aplicações dos Recursos do RPPS do Estado do Amazonas, o Conselho Fiscal delibera pela sua:

APROVAÇÃO

REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho Fiscal:

Documento assinado eletronicamente em 17/06/2021 13:23:47
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 15:15:27
Documento assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:00
Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
Documento assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTE em 17/06/2021 08:15:44
Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
Documento assinado por: REINALDES DE SOUZA em 17/06/2021 08:42:025
Acesse: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: N1W1W1JU



APROVAÇÃO DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO - CONAD

Com base nos termos do Parecer do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev, acima emitido, bem com análise das informações constantes do Relatório de Investimentos e Riscos das aplicações dos Recursos do RPPS do Estado do Amazonas, o Conselho Fiscal delibera pela sua:

() APROVAÇÃO

() REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho de Administração:

Documento assinado eletronicamente em 17/06/2021 13:23:47
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 17/06/2021 15:15:27
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 16/06/2021 12:23:00
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 17/06/2021 15:15:27
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTE em 17/06/2021 08:15:44
Documento Assinado por: ANDREZA DE SOUZA SILVA em 18/06/2021 08:12:40
Documento Assinado por: REINALDES DE SOUZA em 17/06/2021 08:42:025
Acesse: <http://www.portaldosegurado.am.gov.br:85/validar>
e valide o código: NJIwMjU

