

Relatório de Investimentos Junho de 2018

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 23/07/2018

RELATÓRIO Nº. 019/2018 – COMIV

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 05);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e performance dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos e Recursos Consolidados do FPREV (páginas 06 a 15);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV/ALEAM (páginas 16 a 17);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV Executivo e ALE (páginas 17 A 18);
- 5) Recursos do Ministério Público - FPREV - (páginas 18);
- 6) Recursos do FFIN Executivo – (página 18);
- 7) Recursos da Taxa de Administração - (página 18);
- 7) Recursos dos Outros Poderes: Saldo e Composição – TCE e TJA (página 18 a 19);
- 8) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 20 a 22);
- 9) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 23 a 25).

Relatório de Investimentos Junho de 2018

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

SÍNTESE ECONÔMICA DE JUNHO

O mês de junho mostrou-se mais um mês desafiador no ambiente internacional. Apesar da atividade econômica global estável/satisfatória, as divergências na condução da política monetária pelos principais BC's, além das incertezas políticas e geopolíticas, prejudicaram o desempenho dos ativos e favoreceram o ganho global do dólar. Nesse sentido, o aumento do protecionismo manteve-se como um importante fator de risco - Trump ameaçou adotar tarifas de 10% contra até US\$400 bilhões em produtos chineses caso o país retalie suas ações comerciais. Por outro lado, no campo político houve avanços: após adicionar incerteza durante quase todo o mês, ao final de junho os líderes da União Europeia avançaram em acordo na condução da questão imigratória. Nesse ambiente, a aversão ao risco ficou estável, mas em patamar relativamente elevado.

Nos EUA, a agenda macro segue mostrando crescimento forte. As vendas no varejo avançaram 0,8% em maio, enquanto o núcleo subiu 0,9%, sugerindo avanço da ordem de 4,0% do consumo real na corrente trimestre. Pelo lado do emprego, o *payroll* revelou criação de 223 mil vagas em maio, com revisão positiva dos meses anteriores em 15 mil vagas. Além disso, os salários avançaram de 2,6% para 2,7%, ao passo que taxa de desemprego cedeu de 3,9% para 3,8%, menor patamar desde 2000. No tocante à inflação, o PCE avançou de 2,0% para 2,3% em maio e o seu núcleo de 1,8% para 2,0%, nível que não era atingindo desde 2012.

Na Zona do Euro, a agenda macro seguiu mostrando acomodação. A prévia do PMI da indústria de junho recuou de 55,5 para 55,0, enquanto que o de serviços subiu de 53,8 para 55,0; nesse sentido, a média dos PMIs subiu na margem, interrompendo a queda que vinha desde o primeiro trimestre.

Entre os emergentes, na China, os dados mostraram alguma perda de vigor em maio, todos em variação anual: i) as vendas no varejo cederam de 9,4% para 8,5%; ii) o investimento passou de 7,0% para 6,1%; por fim. Iii) a produção industrial recuou de 7,0% para 6,8%. No âmbito dos BC's, a nossa tese de divergência de política monetária entre os países se consolidou. O BC americano (FED) elevou os juros e, por meio de discurso bastante convicto, afirmou que dará continuidade à normalização monetária. Por sua vez, o BC Europeu (BCE) sustentou a sua postura *dovish* e cautelosa. **No Japão**, o BOJ manteve a sua política frouxa, simbolizada na meta de 0,0% para o retorno do título público de 10 anos.

Relatório de Investimentos Junho de 2018

No ambiente doméstico, a agenda macro continuou mostrando fraca recuperação. O IBC-Br avançou 0,46% em abril, na série com ajuste sazonal. No acumulado do trimestre encerrado em abril, na comparação com o trimestre anterior (novembro/17 a janeiro/18), houve baixa de 0,29%. Pelo lado da inflação, o IPCA-15 de junho acelerou de 0,14% para 1,11%, respondendo principalmente aos efeitos temporários da greve dos caminhoneiros e à depreciação cambial. Por sua vez, as medidas de núcleo continuam em patamar baixo, acumulando em doze meses 3,12%. No mercado de trabalho, o Caged de maio mostrou geração de 33,6 mil postos, porém, com ajuste sazonal, foram apenas 4,5 mil vagas. No campo fiscal, o setor público consolidado mostrou déficit primário de R\$8,2 bilhões em maio, após superávit de R\$2,9 bilhões em abril. Em 12 meses, o déficit é de R\$95,9 bilhões, equivalente a 1,44% do PIB. Entre as confianças, a do consumidor (FGV) de junho cedeu 4,8 pontos passando de 86,9 para 82,1, o menor nível desde agosto de 2017. No âmbito da política monetária, o BCB manteve a Selic em 6,5% e divulgou a Ata da última reunião e o RTI. Ambos reforçaram o entendimento de que a política monetária será pautada pelo foco nas projeções de inflação, no balanço de riscos e na atividade econômica. Fonte: Conjuntura Mensal – Divisão de Macroeconomia – BB DTVM S.A.

Relatório de Investimentos Junho de 2018

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO %					
	30/05/2018	29/06/2018	abr/18	mai/18	jun/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 243.233.916,43	R\$ 276.668.411,04	0,5059	0,4992	0,5066	1,5193%	3,1370%	3,1352%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 225.830.659,03	R\$ 225.645.003,96	0,4999	0,4931	0,5037	1,5042%	3,0658%	NC
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 69.212.215,30	R\$ 69.475.815,13	0,6018	(1,7169)	0,3809	-0,7488%	-0,7488%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ -	R\$ 8.009.606,95	-	-	0,1201	0,1201%	0,1201%	NC
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 71.884.020,04	R\$ 72.873.572,52	0,6659	0,6938	1,3766	2,7597%	5,1800%	9,4700%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 42.524.725,57	R\$ 42.566.878,51	0,9254	(0,8124)	0,0991	0,2047%	3,4900%	10,4300%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 44.256.059,10	R\$ 44.252.634,65	(0,2869)	(3,3182)	0,0077	-3,5881%	2,0200%	8,7800%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.140.307,33	R\$ 5.126.819,03	0,5273	(0,8425)	(0,2624)	-0,5812%	2,5364%	NC
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 216.302.534,74	R\$ 217.275.607,64	0,3299	(1,1777)	0,4499	-0,4056%	0,8501%	NC
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 557.485.480,87	R\$ 559.831.046,39	0,4053	1,5870	0,4207	2,4279%	3,4609%	NC
CAIXA FI JUROS E MOEDAS	R\$ 15.025.069,91	R\$ 15.094.735,43	-	0,1692	0,4637	0,6337%	0,6337%	NC
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 13.966.040,14	R\$ 5.193.970,26	-	(6,8931)	(5,2480)	-11,7793%	-11,7793%	NC
SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	R\$ 71.164.076,27	R\$ 71.527.158,47	0,5084	0,5854	0,5100	1,6124%	3,1977%	NC
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 150.604.603,62	R\$ 151.260.701,93	0,4007	(1,5781)	0,4356	-0,7532%	0,8405%	NC
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 28.006.397,70	R\$ 26.604.343,26	0,4007	(6,6453)	(5,0062)	-10,9635%	-10,9635%	NC
BB PREVID RF IRF MI	R\$ 461.849.466,86	R\$ 464.157.751,09	0,4799	0,1814	0,4997	1,1652%	2,9397%	7,5535%
BB PREVID TP VII	R\$ 31.180.040,25	R\$ 31.360.612,95	0,5733	(0,5051)	0,5791	0,6448%	3,5862%	9,7873%
BB PREVID TP IX	R\$ 8.593.166,73	R\$ 8.689.322,76	0,4144	0,7939	1,1189	2,3440%	4,2509%	8,9035%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 431.610.995,02	R\$ 432.852.611,72	0,6907	(0,8443)	0,2876	-0,1594%	1,0047%	NC
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	R\$ 10.018.068,71	R\$ 10.068.754,02	0,5048	0,5100	0,5100	1,5326%	3,1000%	7,2200%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 203.190.795,64	R\$ 204.381.846,71	0,3257	(0,3400)	0,5900	0,5745%	3,8900%	NC
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVSPA	R\$ 13.769.623,34	R\$ 13.138.223,74	-	(9,2862)	(4,5900)	-13,4499%	-13,4499%	NC
TOTAL	R\$ 2.914.848.262,60	R\$ 2.956.055.428,16						

Quadro 1

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

2.2 EVOLUÇÃO DOS SALDOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	abr/18	mai/18	jun/18
BRADESCO	R\$ 538.409.311,66	R\$ 538.276.790,76	R\$ 571.789.230,13
CAIXA	R\$ 962.338.122,45	R\$ 966.584.237,70	R\$ 970.224.871,38
BANCO DO BRASIL	R\$ 936.067.835,44	R\$ 933.233.668,86	R\$ 937.060.298,52
ITAÚ	R\$ 210.698.782,98	R\$ 226.978.487,69	R\$ 227.588.824,47
SANTANDER	R\$ 253.769.238,96	R\$ 249.775.077,59	R\$ 249.392.203,66
TOTAL	R\$ 2.901.283.291,49	R\$ 2.914.848.262,60	R\$ 2.956.055.428,16

Quadro 2

Relatório de Investimentos Junho de 2018

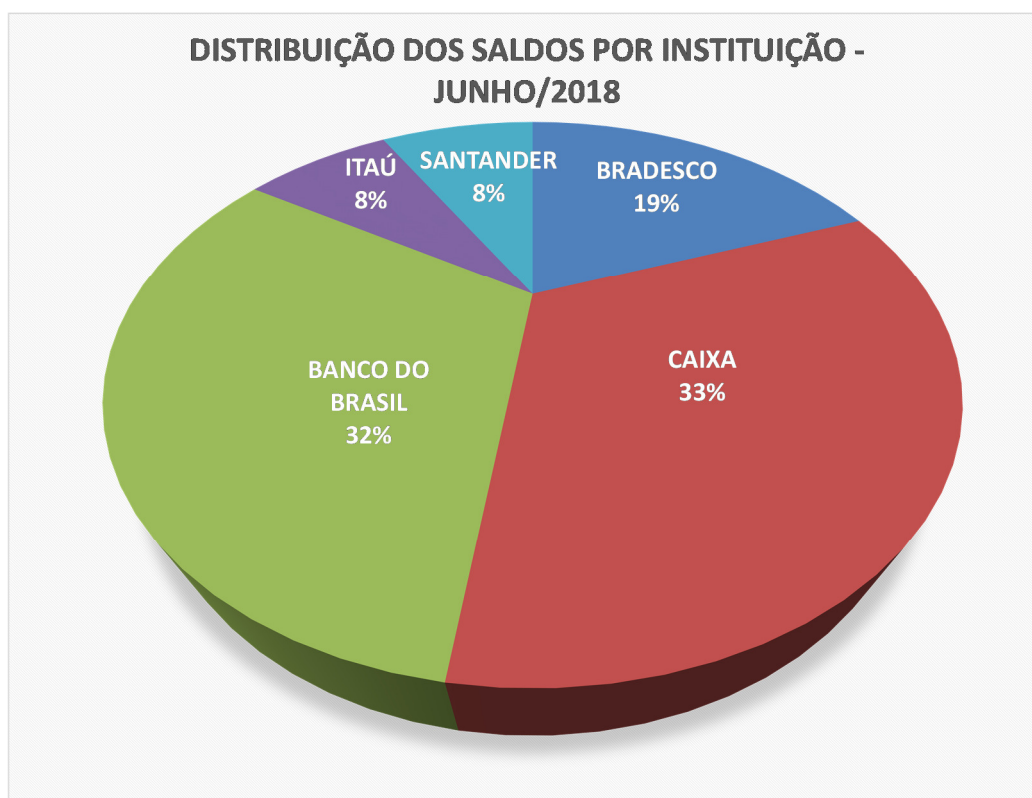


Gráfico 1

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	CDI	R\$ 583.909.327,49	19,75%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIM LP CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	CDI ATIVO	R\$ 509.625.762,30	17,24%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF BB PREVID RF IRF M1	IRF M 1	R\$ 472.167.358,04	15,97%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 780.567.563,45	26,41%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 432.852.611,72	14,64%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF BB PREVID TP VII BB PREVID TP IX	IPCA + 6%	R\$ 126.869.448,87	4,29%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	IBOVESPA ATIVO	R\$ 50.063.356,29	1,69%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 2.956.055.428,16	100%

Quadro 3

Relatório de Investimentos Junho de 2018

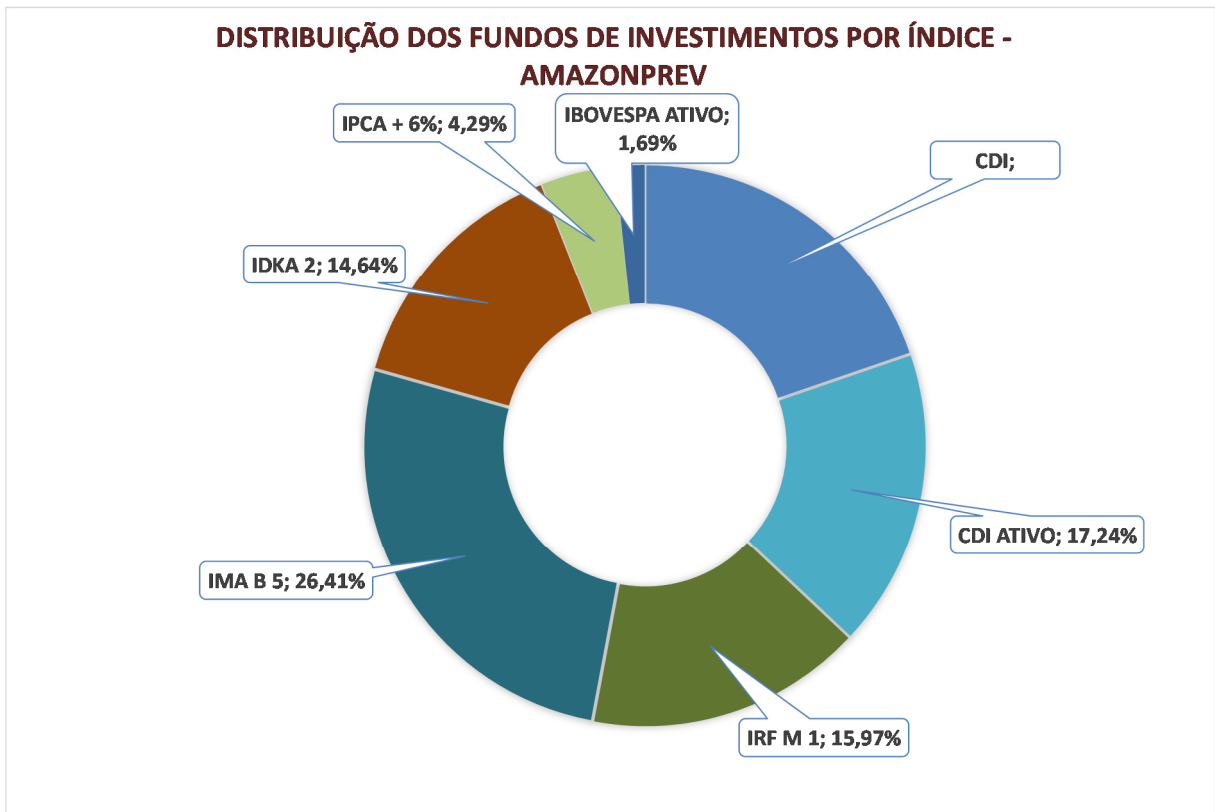


Gráfico 2

2.4 COMPARATIVO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA

ÍNDICE	jun/18	ACUMULADO 2018	12 MESES
CDI	0,5200%	3,1800%	7,3700%
IMA-B 5	0,4497%	2,8081%	9,9278%
IMA-B	-0,3201%	1,1573%	8,3604%
IMA B 5+	-1,0785%	-0,7111%	6,2613%
IRF M 1	0,5450%	3,0777%	7,8619%
IDKA 2	0,1689%	2,9790%	10,1832%
IBOVESPA	-5,2000%	-4,7600%	15,6800%

Quadro 4

Relatório de Investimentos Junho de 2018

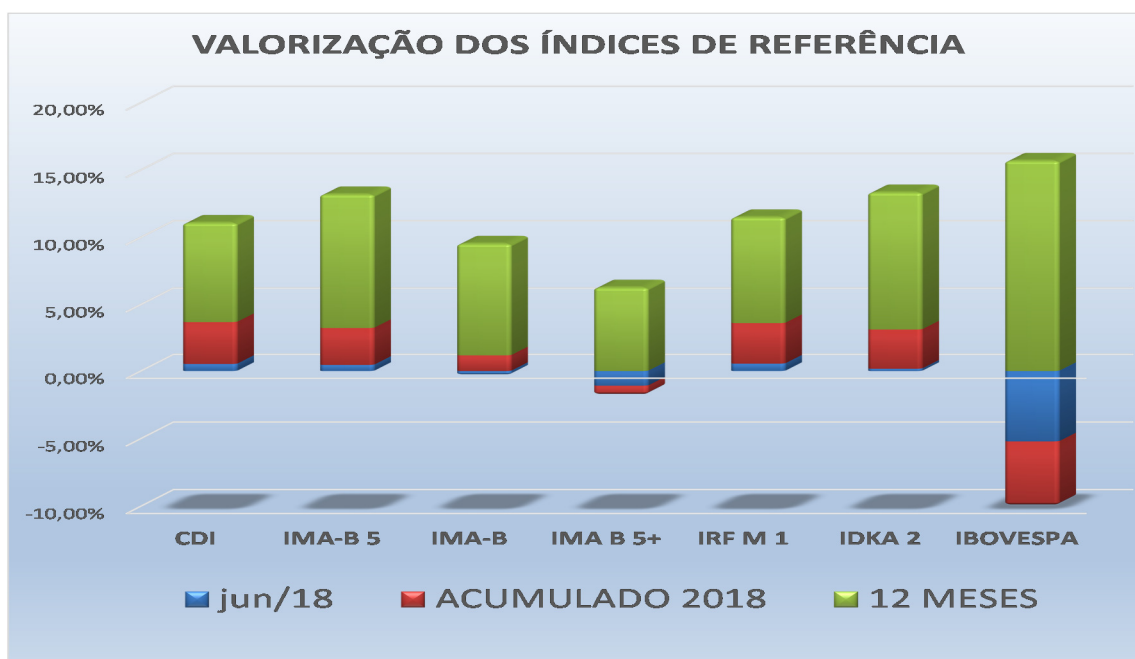


Gráfico 3.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/05/2018	29/06/2018	abr/18	mai/18	jun/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 137.063.845,57	R\$ 137.561.893,78	(0,0161)	(3,1198)	0,3634	-2,7834%	4,1005%	12,7686%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 141.564.302,40	R\$ 140.211.264,53	(0,3154)	(3,9013)	(0,9558)	-5,1199%	0,0161%	5,6384%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 143.724.420,52	R\$ 142.350.736,76	(0,3154)	(3,9013)	(0,9558)	-5,1199%	0,0161%	5,6384%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 145.152.764,46	R\$ 143.452.608,94	(0,6715)	(4,9485)	(1,1713)	-6,6927%	-0,9403%	4,4134%
TOTAL GERAL	R\$ 567.505.332,95	R\$ 563.576.504,01						

Quadro 5

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS – TPF

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRADERCO	BRADERCO	BRADERCO	BRADERCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
PREÇO UNITÁRIO ATUAL	R\$ 3.191,691271	R\$ 3.226,956606	R\$ 3.226,956606	R\$ 3.234,557135
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\$ 137.561.893,78	R\$ 140.211.264,53	R\$ 142.350.736,76	R\$ 143.452.608,94
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%
INSTITUIÇÃO CUSTODIANTE	SELIC	SELIC	SELIC	SELIC

Quadro 6

Relatório de Investimentos Junho de 2018

2.7 SALDOS CVS - FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	30/05/2018	29/06/2018
CVS - A	R\$ 1.798.505,70	R\$ 1.781.052,38
CVS - B	R\$ 11.638.314,30	R\$ 11.525.336,50
CVS - C	R\$ 233.305,80	R\$ 231.041,72
CVS - D	R\$ 1.276.296,12	R\$ 1.263.906,60
TOTAL	R\$ 14.946.421,92	R\$ 14.801.337,20

Quadro 7

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/18	R\$ 45.365,76	R\$ 144.957,83	R\$ 190.323,59
fev/18	R\$ 44.946,11	R\$ 145.084,72	R\$ 190.030,83
mar/18	R\$ 44.526,14	R\$ 145.084,72	R\$ 189.610,86
abr/18	R\$ 44.106,16	R\$ 145.084,72	R\$ 189.190,88
mai/18	R\$ 43.686,19	R\$ 145.084,72	R\$ 188.770,91
jun/18	R\$ 43.266,22	R\$ 145.084,72	R\$ 188.350,94
TOTAL	R\$ 265.896,58	R\$ 870.381,43	R\$ 1.136.278,01

Quadro 8

2.9 CONTROLE DE RECEBIMENTO DE ALUGUEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2018			TOTAL
MÊS	UEA	SEAS	
jan/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/18	R\$ -	R\$ 394.023,20	R\$ 394.023,20
mar/18	R\$ 53.422,83	R\$ 267.638,40	R\$ 321.061,23
abr/18	R\$ 106.845,66	R\$ -	R\$ 106.845,66
mai/18	R\$ -	R\$ 40.145,76	R\$ 40.145,76
jun/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 160.268,49	R\$ 701.807,36	R\$ 862.075,85

Quadro 9

Nota: Recebidos no mês de maio/18 da SEAS, pagtº ref. a 9 (nove) dias do mês de mar/18.

Relatório de Investimentos Junho de 2018

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

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

R\$
Valor Global: 560.939,60

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

Quadro 10

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

Processo Administrativo nº. 2017/00006856 - UEA

Valor Global: R\$ 641.073,96

Termo de Contrato nº 06/2017 - UEA

Valor Mensal R\$ 53.422,83

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

Quadro 11

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

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

CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - SEAS - 2016/2017

Processo Administrativo nº. 018.01777.14-SEAS

Valor Global R\$ 2.141.102,40

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

Valor Mensal R\$ 178.425,20

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

Quadro 12

Nota: Fonte: GERAf. Atualizado após conciliação junto aos extratos bancários e Sistema AF

Relatório de Investimentos Junho de 2018

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

2º Aditivo ao Termo de Contrato nº.002/2015-SEAS Valor Global R\$ 1.605.830,40
Valor Mensal R\$ 133.819,20

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	CRÉDITO	SALDO
mar/17	07/07/17	0031093	R\$ 53.527,68	R\$ 1.552.302,72
abr/17	02/06/17	0023739	R\$ 133.819,20	R\$ 1.418.483,52
mai/17	05/07/17	0030146	R\$ 133.819,20	R\$ 1.284.664,32
mar/17	10/08/17	0036300	R\$ 92.186,56	R\$ 1.192.477,76
jun/17	01/09/17	0040592	R\$ 133.819,20	R\$ 1.058.658,56
jul/17	01/09/17	0040593	R\$ 133.819,20	R\$ 924.839,36
ago/17	14/12/17	0053846	R\$ 133.819,20	R\$ 791.020,16
set/17	18/12/17	0054764	R\$ 133.819,20	R\$ 657.200,96
out/17	23/02/18	0008369	R\$ 126.384,80	R\$ 530.816,16
nov/17	23/02/18	0008366	R\$ 133.819,20	R\$ 396.996,96
dez/17	23/02/18	0008366	R\$ 133.819,20	R\$ 263.177,76
jan/18	27/03/18	0017829	R\$ 133.819,20	R\$ 129.358,56
fev/18	27/03/18	0017381	R\$ 133.819,20	R\$ (4.460,64)
mar/18	10/05/18	0031155	R\$ 40.145,76	R\$ (44.606,40)

Quadro 13

Nota: Recebimento no dia 10/05/18 de valor ref. a 9 (nove) dias do mês de março/18.

CONTROLE - TERMO DE CONFISSÃO DE DÍVIDA - SEAS

Valor Global: R\$ 4.566.330,41

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

Quadro 14

IMÓVEIS DO COMPLEXO IPIXUNA E DUQUE DE CAXIAS. Encaminhado memorando nº 180/2016 à DIRAF dando conhecimento sobre as licitações dos imóveis declaradas desertas. Encaminhado memorando nº 345/2016 com histórico da locação dos imóveis. Deliberação da Diretoria, do dia 31/08/2016, que a GEJUR analise a possibilidade de contratação de corretor de imóveis, através de procedimento licitatório, para locação dos imóveis. Em resposta através de parecer no processo 2014.A.04879, a GEJUR opina pela possibilidade

Relatório de Investimentos Junho de 2018

de contratação de corretor de imóveis, com a ressalva que o percentual referente pagamento dos honorários seja pago diretamente pelo locatário. Em elaboração de Projeto Básico para encaminhar para Licitação. Em abril, o corretor de imóvel, mandou as propostas com os ajustes, em elaboração processo licitatório. Em razão da irregularidade fiscal da empresa Corretora de imóveis, será realizada nova pesquisa de mercado para proposta de serviços. Aguardando proposta de empresa Corretora de Imóveis. Em elaboração pela COMAP de projeto básico. Recebido documentação e certidões de regularidade fiscal da empresa corretora de imóveis para compor o processo. Solicitado ajustes de proposta e regularização de certidões fiscais. Projeto básico em ajustes pela GERAFF e COMAP em razão da necessidade de outras propostas. Aguardando novas propostas para prestação dos serviços. Não recebido propostas para prestação dos serviços neste mês. Dificuldades para recebimento de propostas. Reiterado pedido de propostas, caso negativo, apresentar justificativas. **Em razão da dificuldade em obter mais propostas para prestação dos serviços, será consultado a GEJUR para manifestação sobre a possibilidade dar prosseguimento ao processo sem as três propostas de preços. Em resposta a GEJUR sinaliza pela possibilidade de usar uma proposta, tendo que apresentar justificativa. Fonte: GERAFF/COMAP.**

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

Relatório de Investimentos Junho de 2018

IMÓVEIS EM LITÍGIO

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

Quadro 15

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

2.14 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	30/05/2018	29/06/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 2.914.848.262,60	R\$ 2.956.055.428,16
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 567.505.332,95	R\$ 563.576.504,01
TÍTULOS CVS	R\$ 14.946.421,92	R\$ 14.801.337,20
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 2.733,47
TOTAL	R\$ 3.561.828.017,47	R\$ 3.598.964.002,84

Quadro 16

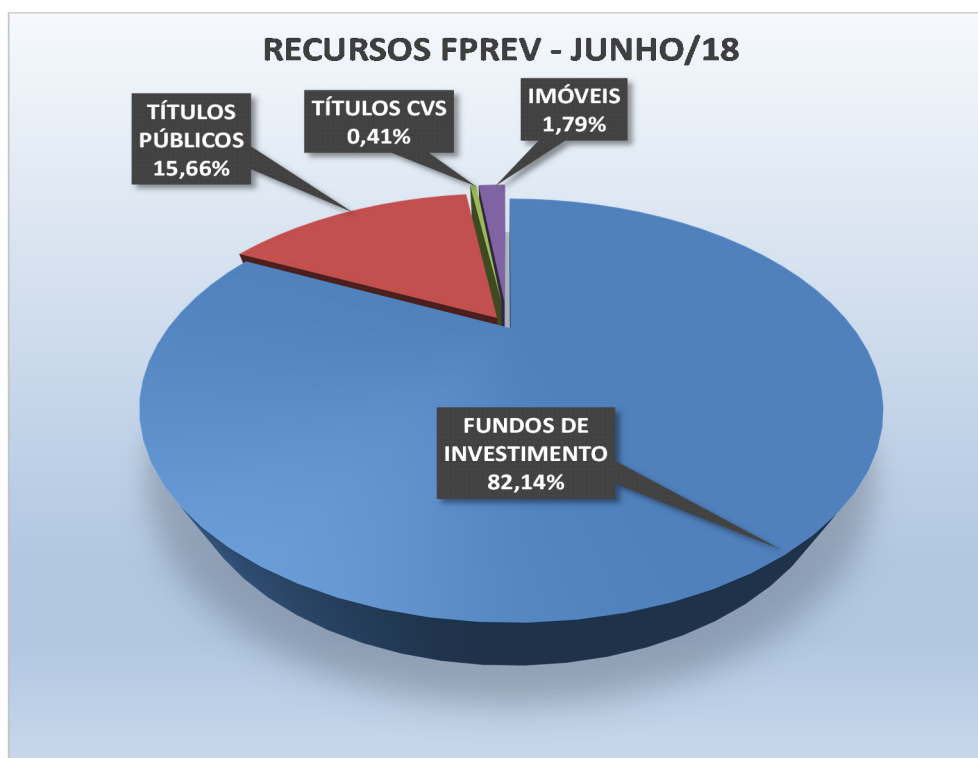


Gráfico 4

Relatório de Investimentos Junho de 2018

2.15 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
mai/17	R\$ 2.952.298.019,40	0,76%	9,30%	27,23%
jun/17	R\$ 2.993.728.697,93	1,40%	10,84%	25,95%
jul/17	R\$ 3.091.042.425,42	3,25%	14,44%	26,78%
ago/17	R\$ 3.150.753.915,37	1,93%	16,65%	26,54%
set/17	R\$ 3.215.911.304,31	2,07%	19,06%	26,45%
out/17	R\$ 3.252.585.663,77	1,14%	18,05%	25,80%
nov/17	R\$ 3.290.522.494,61	1,17%	19,43%	25,94%
dez/17	R\$ 3.349.596.826,89	1,80%	24,01%	24,01%
jan/18	R\$ 3.432.495.345,53	2,47%	2,47%	24,58%
fev/18	R\$ 3.476.496.589,48	1,28%	3,79%	22,11%
mar/18	R\$ 3.535.665.708,63	1,70%	5,55%	21,86%
abr/18	R\$ 3.575.920.197,63	1,14%	6,76%	22,04%
mai/18	R\$ 3.561.828.017,47	-0,39%	6,34%	20,65%
jun/18	R\$ 3.598.964.002,84	1,04%	7,44%	20,22%

Quadro 17

2.16 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO

PERÍODO	TAXA
junho/17	-0,23%
maio/18	0,40%
junho/18	1,26%
Acumulado no ano de 2018	2,60%
Acumulado nos últimos 12 meses	4,39%
Meta Atuarial no mês	1,7529%

Quadro 18

2.17 RENTABILIDADE FPREV EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	JUNHO/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2005 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,1664%	2,0900%	8,2092%	392,6371%
META ATUARIAL	1,7529%	5,6400%	10,6540%	361,6943%
RESULTADO ATUARIAL	-1,5592%	-3,3605%	-2,2094%	6,7020%

Quadro 19

Nota: Rentabilidade validada pelo atuário.

Relatório de Investimentos Junho de 2018

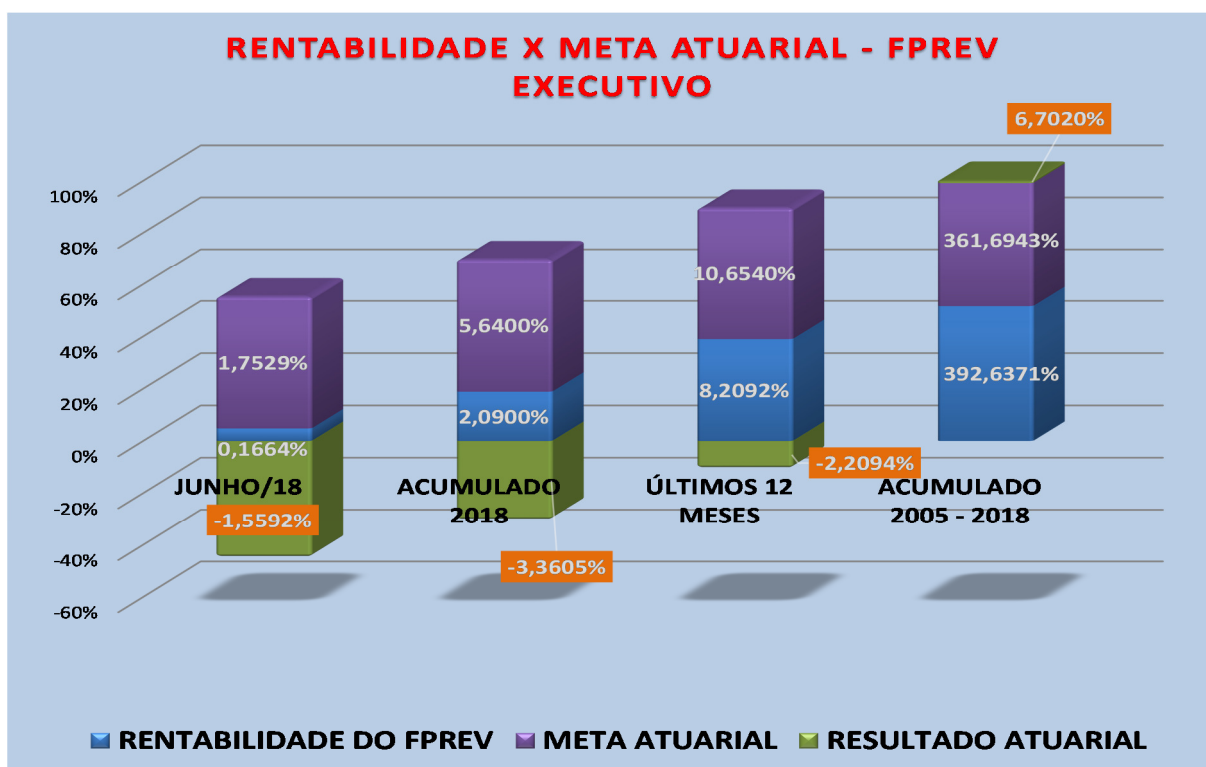


Gráfico 5.

Nota: A volatilidade no mês de junho/18 ainda permaneceu forte, algumas medidas foram tomadas com o objetivo minimizar perdas nos investimentos da Amazonprev, tipo encurtar o prazo da carteira, aplicando em fundos de curto prazo. A agenda macro continuou mostrando fraca recuperação. O IBC-Br avançou 0,46% em abril, na série com ajuste sazonal. No acumulado do trimestre encerrado em abril, na comparação com o trimestre anterior (novembro/17 a janeiro/18), houve baixa de 0,29%. Pelo lado da inflação, o IPCA-15 de junho acelerou de 0,14% para 1,11%, respondendo principalmente aos efeitos temporários da greve dos caminhoneiros e à depreciação cambial. Por sua vez, as medidas de núcleo continuam em patamar baixo, acumulando em doze meses 3,12%. No mercado de trabalho, o Caged de maio mostrou geração de 33,6 mil postos, porém, com ajuste sazonal, foram apenas 4,5 mil vagas. No campo fiscal, o setor público consolidado mostrou déficit primário de R\$8,2 bilhões em maio, após superávit de R\$2,9 bilhões em abril. Em 12 meses, o déficit é de R\$95,9 bilhões, equivalente a 1,44% do PIB. Entre as confianças, a do consumidor (FGV) de junho cedeu 4,8 pontos passando de 86,9 para 82,1, o menor nível desde agosto de 2017. No âmbito da política monetária, o BCB manteve a Selic em 6,5% e divulgou a Ata da última reunião e o RTI. Ambos reforçaram o entendimento de que a política monetária será pautada pelo foco nas projeções de inflação, no balanço de riscos e na atividade econômica.

Relatório de Investimentos Junho de 2018

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/05/2018	29/06/2018	abr/18	mai/18	jun/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRAPRES INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 3.073.267,86	R\$ -	0,4357	(1,7169)	0,2504	-1,0414%	-1,0414%	NC
BRAPRES FI REF. FEDERAL EXTRA	R\$ -	R\$ 3.177.859,41	-	-		0,0000%	0,0000%	NC
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 3.145.428,71	R\$ 3.159.578,94	0,3299	(1,1693)	0,4499	-0,3972%	-0,3972%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 6.218.696,57	R\$ 6.337.438,35						

Quadro 20

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/05/2018	29/06/2018	abr/18	mai/18	jun/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 1.932.051,35	R\$ 1.913.585,27	(0,3154)	(3,9013)	(0,9558)	-5,1199%	-5,1199%	5,6384%
TOTAL GERAL	R\$ 1.932.051,35	R\$ 1.913.585,27						

Quadro 21

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	abr/18	mai/18	jun/18
SALDO ANTERIOR	8.048.711,42	8.223.861,55	8.150.747,92
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	94.575,32	94.911,19	96.865,88
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	80.574,81	(168.024,82)	3.409,82
SALDO FINAL	8.223.861,55	8.150.747,92	8.251.023,62

Quadro 22

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	30/05/2018	29/06/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 6.218.696,57	R\$ 6.337.438,35
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 1.932.051,35	R\$ 1.913.585,27
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 8.150.747,92	R\$ 8.251.023,62

Quadro 23

Relatório de Investimentos Junho de 2018

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV		Evolução		
			Mensal	Anual	12 Meses
mai/17	R\$	6.465.577,61	1,65%	14,23%	41,46%
jun/17	R\$	6.602.039,70	2,11%	16,64%	39,50%
jul/17	R\$	6.814.460,07	3,22%	20,39%	39,10%
ago/17	R\$	6.976.419,44	2,38%	23,25%	37,97%
set/17	R\$	7.138.676,97	2,33%	26,12%	37,40%
out/17	R\$	7.245.680,53	1,50%	33,51%	35,88%
nov/17	R\$	7.349.135,69	1,43%	35,41%	35,41%
dez/17	R\$	7.574.592,78	3,07%	33,82%	33,82%
jan/18	R\$	7.784.283,78	2,77%	32,44%	27,36%
fev/18	R\$	7.911.489,25	1,63%	29,44%	26,32%
mar/18	R\$	8.048.711,42	1,73%	6,26%	26,54%
abr/18	R\$	8.223.861,55	2,18%	8,57%	27,19%
mai/18	R\$	8.150.747,92	-0,89%	7,61%	23,46%
jun/18	R\$	8.251.023,62	1,23%	8,93%	21,08%

Quadro 24

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

DESCRIÇÃO	JUNHO/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2012 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,0418%	1,5300%	6,5405%	112,716752%
META ATUARIAL	1,7529%	5,6400%	10,6540%	112,629497%
RESULTADO ATUARIAL	-1,6816%	-3,8906%	-3,7174%	0,041036%

Quadro 25

Nota: Obs: Rentabilidade validada pelo atuário.

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

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)				
	30/05/2018	29/06/2018	mai/18	jun/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FI RE DI PREMIUM	R\$ 95.881.972,30	R\$ 96.367.301,93	0,3780	0,5062	0,8861%	0,8861%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00					
TOTAL	R\$ 95.881.973,30	R\$ 96.367.302,93					

Quadro 26.

Nota: Recebido em maio/2018 recursos de contribuição previdenciária dos servidores do Ministério Público do estado do Amazonas – MPE/AM (PGJ), como parte do cronograma da Adesão dos Poderes à Amazonprev.

Relatório de Investimentos Junho de 2018

5. CONSOLIDADO – FPREV (EXECUTIVO, ALE E MPE)

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

ANO	ALE FPREV	EXEC. FPREV	MPE FPREV	TOTAL FPREV
2004	R\$ -	R\$ 15.862.618,50	R\$ -	R\$ 15.862.618,50
2005	R\$ -	R\$ 57.510.136,49	R\$ -	R\$ 57.510.136,49
2006	R\$ -	R\$ 83.649.681,60	R\$ -	R\$ 83.649.681,60
2007	R\$ -	R\$ 75.698.485,78	R\$ -	R\$ 75.698.485,78
2008	R\$ -	R\$ 179.805.240,72	R\$ -	R\$ 179.805.240,72
2009	R\$ -	R\$ 341.872.841,56	R\$ -	R\$ 341.872.841,56
2010	R\$ -	R\$ 489.868.867,80	R\$ -	R\$ 489.868.867,80
2011	R\$ -	R\$ 657.928.672,97	R\$ -	R\$ 657.928.672,97
2012	R\$ 436.901,72	R\$ 936.612.579,50	R\$ -	R\$ 937.049.481,22
2013	R\$ 1.239.708,12	R\$ 1.166.915.511,62	R\$ -	R\$ 1.168.155.219,74
2014	R\$ 2.509.280,78	R\$ 1.571.464.403,45	R\$ -	R\$ 1.573.973.684,23
2015	R\$ 3.643.310,21	R\$ 2.012.490.466,39	R\$ -	R\$ 2.016.133.776,60
2016	R\$ 5.660.283,00	R\$ 2.700.997.719,11	R\$ -	R\$ 2.706.658.002,11
2017	R\$ 7.574.592,78	R\$ 3.349.596.826,89	R\$ -	R\$ 3.357.171.419,67
2018	R\$ 8.251.023,62	R\$ 3.598.964.002,84	R\$ 96.367.302,93	R\$ 3.703.582.329,39

Quadro 27

Nota: O quadro Consolidado de Evolução dos Recursos do FPREV ainda está pendente de atualização pelo atuário devido ao repasse dos valores de contribuição do MPE/AM recebidos em maio/2018. Deve ser estar regularizado no Relatório de junho/2018.

6. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

6.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Investimentos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/05/2018	29/06/2018	abr/18	mai/18	jun/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 537.913,25	R\$ 372.507,84	0,4933	0,4921	0,5000	1,4927%	2,0078%	7,3700%
BRADESCO FI RF IRF MI - COMPREV	R\$ 8.065.142,91	R\$ 8.100.473,45	0,4909	0,1700	0,5062	1,1713%	2,9420%	7,5700%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 8.603.057,16	R\$ 8.472.982,29						

Quadro 28

6.2 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit - FFIN ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/05/2018	29/06/2018
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 19.657,15
TOTAL	R\$ -	R\$ 19.657,15

6.3 Composição do Recursos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	abr/18	mai/18	jun/18
SALDO ANTERIOR	R\$ 0,00	R\$ 18.587,73	R\$ 0,00
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 818.890,52	R\$ 811.992,72	R\$ 850.407,00
COERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.290.098,70	R\$ 1.270.878,22	R\$ 1.275.553,61
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 0,00	R\$ 0,00
SAIDAS FINANCEIRAS	(2.090.401,49)	(2.101.458,67)	(2.106.303,46)
SALDO FINAL	18.587,73	-	19.657,15

Quadro 29

Relatório de Investimentos Junho de 2018

6.4 Disponibilidade Financeira – FFIN EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/05/2018	29/06/2018
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 115.299,18	R\$ 128.563,01
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 9,70	R\$ -
REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ -

Quadro 30

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

7. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

7.1 SALDOS E PERFORMANCE DOS RECURSOS – TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/05/2018	30/06/2018	abr/18	mai/18	jun/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.698.343,47	R\$ 1.333.237,18	0,4933	0,4921	0,4948	1,4875%	3,1800%	7,3700%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 32.681.022,16	R\$ 33.845.041,47	0,4879	0,1918	0,4964	1,1804%	2,4964%	7,5959%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 34.379.366,63	R\$ 35.178.279,65						

Quadro 31

8. RECURSOS DOS OUTROS PODERES – TJA E TCE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/05/2018	30/06/2018	abr/18	mai/18	jun/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI REF. DI FEDERAL EXTRA	R\$ 92.451.599,05	R\$ 95.770.750,62	0,5005	0,4935	0,5031	1,5045%	2,1011%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 130.112.837,30	R\$ 130.758.695,52	0,4879	0,1918	0,4964	1,1804%	2,9541%	7,5959%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 125.236.050,27	R\$ 125.861.969,36	0,4799	0,1814	0,4997	1,1652%	2,9397%	7,5535%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 347.800.486,62	R\$ 352.391.415,50						

Quadro 32

8.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	abr/18	mai/18	jun/18
SALDO ANTERIOR	339.533.867,19	344.052.600,07	347.800.486,62
REPASSES FINANCEIROS	3.018.731,72	2.981.897,75	3.000.201,70
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.658.771,93	924.759,57	1.737.003,90
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(158.770,77)	(158.770,77)	(146.276,72)
SALDO FINAL	R\$ 344.052.600,07	R\$ 347.800.486,62	R\$ 352.391.415,50

Quadro 33

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

Relatório de Investimentos Junho de 2018

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/05/2018	30/06/2018	abr/18	mai/18	jun/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADERCO FI REF. DI FEDERAL EXTRA	R\$ 40.806.761,77	R\$ 41.706.724,19	0,5005	0,4935	0,5031	1,5045%	2,1011%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 52.829.582,00	R\$ 53.091.819,15	0,4879	0,1918	0,4964	1,1804%	2,9541%	7,5959%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 51.321.058,15	R\$ 51.577.556,42	0,4799	0,1814	0,4997	1,1652%	2,9397%	7,5535%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 2.513,66	R\$ -						
TOTAL	R\$ 144.959.915,58	R\$ 146.376.099,76						

Quadro 34

8.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	abr/18	mai/18	jun/18
SALDO ANTERIOR	142.458.516,81	143.812.499,20	144.959.915,58
REPASSES FINANCEIROS	838.061,09	831.499,72	820.814,72
VARIAÇÃO FINANCEIRA	674.651,03	450.214,70	723.991,83
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(158.729,73)	(134.298,04)	(128.622,37)
SALDO FINAL	R\$ 143.812.499,20	R\$ 144.959.915,58	R\$ 146.376.099,76

Quadro 35

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

9. ENQUADRAMENTO

9.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2018	LIMITE DA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
TÍTULOS DO TN	R\$ 565.490.089,28	13,52%	12,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 641.597.276,87				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 31.360.612,95				
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.689.322,76				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 432.852.611,72				
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 151.260.701,93	51,13%	40,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 225.705.163,09				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 559.831.046,39				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 42.566.878,51				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 44.252.634,65				
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.705.745,02				
BRADERCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 366.300.338,18				
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 373.035.712,97				
BRADERCO FI RF IRFM 1	R\$ 8.100.473,45				
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 69.475.815,13	33,43%	8%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 204.381.846,71				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 220.435.186,58				
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 72.873.572,52				
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 71.527.158,47				
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 10.068.754,02				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESA FIC FIA	R\$ 13.138.223,74	0,31%	5%	30%	art. 8º, inciso I, "a"
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 5.193.970,26				
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 26.604.343,26	0,88%	5%	20%	art. 8º, inciso II, "a"
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESA II	R\$ 5.126.819,03				
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.094.735,43	0,36%	3%	10%	art. 8º, inciso III
TÍTULOS CVS	R\$ 14.801.337,20	0,35%	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	-	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC
TOTAL	R\$ 4.181.470.370,12	100,00%			

Quadro 36

Relatório de Investimentos Junho de 2018

9.2 Enquadramento II – Limites Gerais – art. 13º - Res. CMN 3922/10 atualizada pela Res. Nº 4.604/17.

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	TOTAL DOS RECURSOS DO RPPS	% CARTEIRA	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.705.745,02	R\$ 4.181.470.370,12	0,04%	20%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 366.300.338,18		8,76%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 373.035.712,97		8,92%	
BRADESCO FI RF IRFM 1	R\$ 8.100.473,45		0,19%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 69.475.815,13		1,66%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 204.381.846,71		4,89%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 220.435.186,58		5,27%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 72.873.572,52		1,74%	
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 71.527.158,47		1,71%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 10.068.754,02		0,24%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 13.138.223,74		0,31%	

Quadro 37

Nota 1: Art. 13. As aplicações em cotas de um mesmo fundo de investimento a que se referem o art. 7º, incisos III, IV e art. 8º, I, não podem exceder a 20% (vinte por cento) das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social.

9.3 Enquadramento III – Limites Gerais – art. 13º - Res. CMN 3922/10 atualizada pela Res. Nº 4.604/17.

FUNDOS DE INVESTIMENTO	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 641.597.276,87	11.328.882/0001-35	11.461.270.746,53	5,60%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 31.360.612,95	19.523.305/0001-06	1.136.332.229,99	2,76%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX - 15/08/2018	R\$ 8.689.322,76	20.734.937/0001-06	361.105.310,94	2,41%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 432.852.611,72	13.322.205/0001-35	6.108.970.608,51	7,09%	
SANTANDER FIC INST. REF DI	R\$ 71.527.158,47	02.224.354/0001-45	5.005.435.641,69	1,43%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 151.260.701,93	13.455.117/0001-01	1.137.325.220,38	13,30%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 26.604.343,26	02.436.763/0001-05	618.984.997,25	4,30%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 204.381.846,71	25.306.703/0001-73	1.674.150.820,35	12,21%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 10.068.754,02	00.832.435/0001-00	1.062.300.138,00	0,95%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 13.138.223,74	08.817.414/0001-10	674.378.078,39	1,95%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 225.705.163,09	10.740.670/0001-06	16.953.571.238,51	1,33%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 559.831.046,39	11.060.913/0001-10	7.668.949.035,88	7,30%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 220.435.186,58	23.215.097/0001-55	1.823.013.314,56	12,09%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 72.873.572,52	18.598.256/0001-08	1.354.827.398,95	5,38%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 42.566.878,51	22.791.028/0001-27	249.228.734,54	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 44.252.634,65	22.791.074/0001-26	180.594.182,46	24,50%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.126.819,03	14.386.860/0001-10	255.676.908,55	2,01%	
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.094.735,43	14.120.520/0001-42	589.245.565,35	2,56%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 5.193.970,26	10.577.512/0001-79	35.563.018,34	14,60%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 366.300.338,18	03.256.793/0001-00	6.928.643.682,09	5,29%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 69.475.815,13	20.216.216/0001/04	536.163.794,28	12,96%	
BRADESCO FI RF IRFM 1	R\$ 8.100.473,45	11.492.176/0001-24	665.947.487,35	1,22%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.705.745,02	08.246.263/0001-97	342.778.557,26	0,50%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 373.035.712,97	03.399.411/0001-90	9.019.941.616,74	4,14%	

Quadro 38

Relatório de Investimentos Junho de 2018

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

Nota 2: Art. 14 § 3º. Em caso de os limites de que tratam o caput e o § 1º deste artigo serem ultrapassados em decorrência de resgate de cotas do fundo por outros cotistas, o regime próprio de previdência social deverá adequar-se em até 120 dias;

Nota 3: Art. 21. § 1º As aplicações que apresentem prazos para vencimento, resgate, carência ou para conversão de cotas de fundos de investimento previstas em seu regulamento então vigente poderão ser mantidas em carteira até a respectiva data, caso superior ao prazo previsto no caput. Assim, considera-se que os fundos Caixa FI Brasil 2020 V TP RF e Caixa FI Brasil 2024 VI TP RF encontram-se enquadrados, pois o resgate dessas aplicações ocorrerá no vencimento dos TPF que compõe a carteira dos fundos, ou seja, 16/08/2020 e 16/08/2024, respectivamente.

Nota 4: No mês anterior, registramos o desenquadramento do fundo Caixa FI Consumo, com o limite do PL do fundo superior aos 15% determinados pela legislação vigente, fato que foi corrigido no mês de junho/18, conforme demonstrado no quadro 38.

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA MAIO/18) EM R\$ BI	TOTAL RECURSOS - AMAZONPREV	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Res. nº . 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB DTVM S.A	R\$ 897.782,18	R\$ 1.114.499.824,30	0,1241%	5%
BRADESCO	R\$ 596.250,48	R\$ 818.618.084,75	0,1373%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 628.030,49	R\$ 227.588.824,47	0,0362%	
CAIXA	R\$ 295.217,69	R\$ 1.191.080.006,46	0,4035%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	R\$ 261.820,25	R\$ 249.392.203,66	0,0953%	

Quadro 39

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

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

Relatório de Investimentos Junho de 2018

10. TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO	
DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 2.956.055.428,16
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 563.576.504,01
CVS	R\$ 14.801.337,20
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 2.733,47
TOTAL	R\$ 3.598.964.002,84
ASSEMBLEIA LEGISLATIVA - ALE FPREV E ALE FFIN	
DESCRIÇÃO	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 6.337.438,35
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 1.913.585,27
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ -
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 19.657,15
TOTAL	R\$ 8.270.680,77
MPE FPREV	
DESCRIÇÃO	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 96.367.301,93
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 96.367.302,93
TAXA DE ADM. FFIN EXECUTIVO, COMPREV, SAL. NÃO RECL. E DISP. FINANCEIRA	
DESCRIÇÃO	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	R\$ 35.178.278,65
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 372.507,84
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 8.100.473,45
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM.	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - FFIN	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ -
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 128.563,01
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -
TOTAL	R\$ 43.779.824,95
OUTROS PODERES	
ORGÃOS	SALDO
TJ/AM	R\$ 352.391.415,50
TCE/AM	R\$ 146.376.099,76
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA/TCE	R\$ -
TOTAL	R\$ 498.767.515,26
TOTAL GERAL	4.246.149.326,75

Quadro 40

Relatório de Investimentos Junho de 2018

10.1 CONSOLIDADO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

CONSOLIDADO DOS RECURSOS - JUNHO/2018

DESCRIÇÃO	FPREV PODER EXECUTIVO	FPREV - ALE	TOTAL - FPREV
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 2.956.055.428,16	R\$ 6.337.438,35	R\$ 2.962.392.866,51
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 563.576.504,01	R\$ 1.913.585,27	R\$ 565.490.089,28
CVS	R\$ 14.801.337,20	R\$ -	R\$ 14.801.337,20
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ -	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 2.733,47	R\$ -	R\$ 2.733,47
TOTAL	R\$ 3.598.964.002,84	R\$ 8.251.023,62	R\$ 3.607.215.026,46

DESCRIÇÃO	FFIN - PODER EXECUTIVO	FFIN - ALE	TOTAL FFIN
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 372.507,84	R\$ -	R\$ 372.507,84
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 19.657,15	R\$ 19.658,15
TOTAL	R\$ 372.508,84	R\$ 19.657,15	R\$ 392.165,99

DESCRIÇÃO	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	SALARIOS NÃO RECLAMADOS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 35.178.278,65	R\$ -	R\$ 35.178.278,65
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 128.563,01	R\$ 128.564,01
TOTAL	R\$ 35.178.279,65	R\$ 128.563,01	R\$ 35.306.842,66

DESCRIÇÃO	COMPREV	DISP. COBERTURA DEFICIT E REPASSE PATRONAIS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 8.100.473,45	R\$ -	R\$ 8.100.473,45
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 8.100.473,45	R\$ -	R\$ 8.100.473,45

DESCRIÇÃO	RECURSOS TJ/AM	RECURSOS TCE/AM	TOTAL RECURSOS TCE E TJ
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 352.391.415,50	R\$ 146.376.099,76	R\$ 498.767.515,26
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 352.391.415,50	R\$ 146.376.099,76	R\$ 498.767.515,26

DESCRIÇÃO	RECURSOS MPE FPREV		TOTAL RECURSOS MPE FPREV
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 96.367.301,93	R\$ -	R\$ 96.367.301,93
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 96.367.302,93	R\$ -	R\$ 96.367.302,93

TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV			R\$ 4.246.149.326,75
--	--	--	-----------------------------

Quadro 41

Relatório de Investimentos Junho de 2018

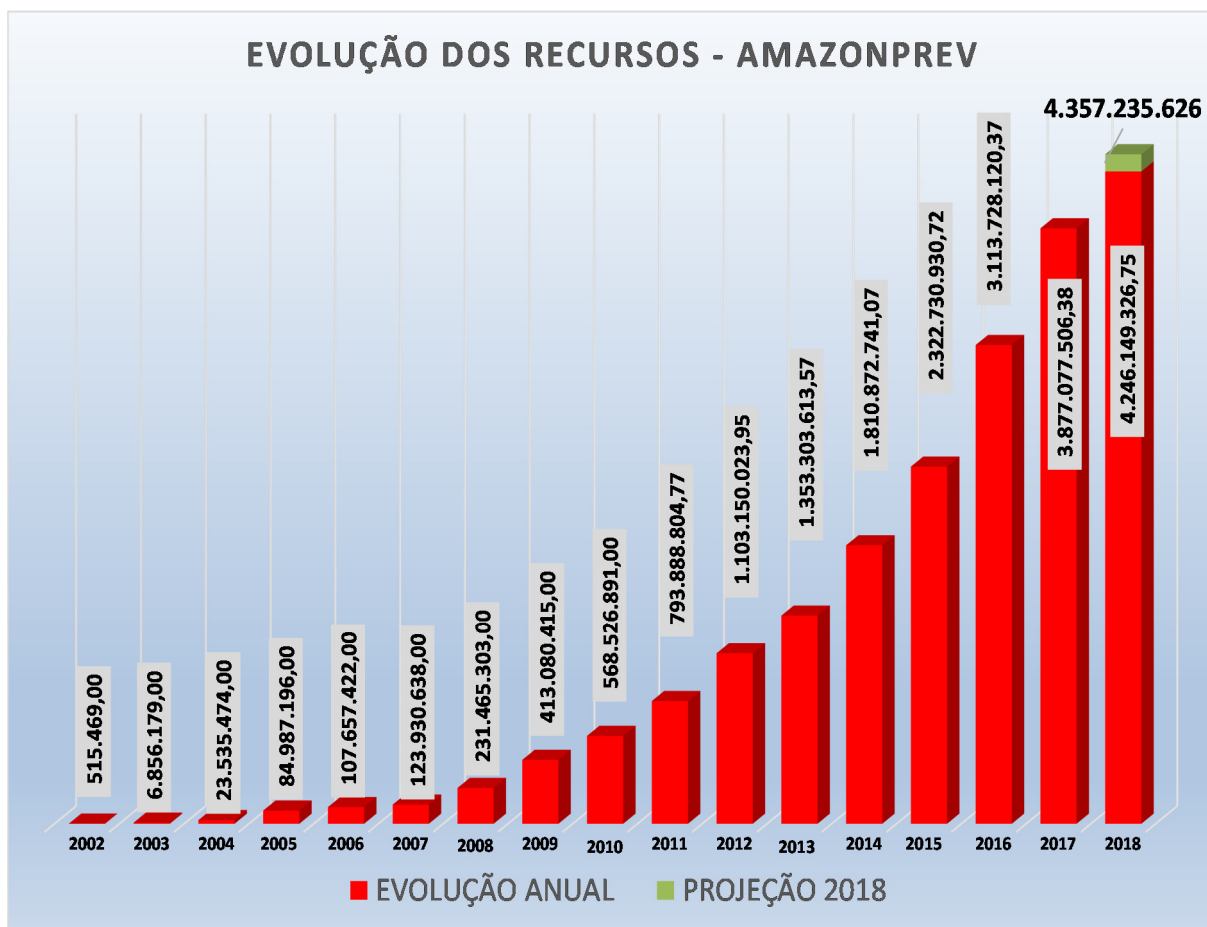


Gráfico 6.

Sem mais a informar, segue para Superior Consideração.

Respeitosamente,

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Leonardo Cavalcanti
Membro

Renício Ferreira
Membro