

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 18/09/2018

RELATÓRIO Nº. 026/2018 – COMIV

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 04);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e performance dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos e Recursos Consolidados do FPREV (páginas 05 a 14);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV/ALEAM (páginas 14 a 16);
- 4) Recursos do Ministério Público - FPREV - (páginas 16)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (páginas 16 a 17);
- 6) Recursos do FFIN Executivo – (página 17);
- 7) Recursos da Taxa de Administração - (página 18);
- 7) Recursos dos Outros Poderes: Saldos e Composição – TCE e TJA (página 18 a 19);
- 8) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 19 a 21);
- 9) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 22 a 24).

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

O ambiente internacional permaneceu desafiador para as economias emergentes em agosto. O mês foi marcado pela piora das condições financeiras nessas economias mesmo com a ausência de um fato gerador específico. Diante desse ambiente mais incerto, foi ajustada a projeção de câmbio para R\$/US\$ 3,90 ao final deste ano.

O cenário externo seguirá desafiador nos próximos meses, o que, juntamente com os fatores locais, sustentam uma taxa de câmbio mais depreciada do que a esperada anteriormente. As contas externas do país seguem positivas, com fluxo cambial no ano superior a US\$ 20 bilhões e rolagem praticamente integral da dívida externa, além do reduzido déficit em conta corrente, elevado investimento externo e reservas, o que nos coloca em situação mais favorável do que os emergentes mais frágeis. Por isso, se as reformas forem adequadamente endereçadas no próximo ano, esses fundamentos devem prevalecer e levar a uma apreciação em relação ao patamar atual. Em contrapartida, em um cenário em que as reformas não sejam endereçadas, as contas externas não serão capazes de evitar uma deterioração da ancoragem nominal e de expectativas na economia, podendo levar o câmbio a depreciar mais, com implicações para a inflação e a taxa de juros. Portanto, esse período de transição, até que a nova agenda econômica seja conhecida, deve seguir acompanhado de volatilidade.

Essa piora das condições financeiras influencia negativamente o crescimento e traz impactos em direções opostas para a inflação. Em relação à atividade econômica, apesar da projeção de crescimento do PIB de 2018 em 1,1%, a eventual manutenção de condições financeiras apertadas coloca um desafio ao crescimento nos próximos trimestres.

Nesse contexto de uma taxa de câmbio mais depreciada, foi elevada a projeção de IPCA para uma alta de 4,4% em 2018. A elevação da curva de juros, enquanto não acompanhada de piora das expectativas de inflação, implica uma contração adicional ou retomada lenta da atividade e pressiona a inflação para baixo, mas a depreciação cambial, por sua vez, tem efeitos mais imediatos.

As últimas semanas têm sido marcadas pela piora dos preços de ativos dos países emergentes. Essa piora, entretanto, ocorreu sem novos episódios de tensões comerciais e geopolíticas e sem altas adicionais das taxas de juros nos Estados Unidos ou em outros desenvolvidos. Apesar de não existir um evento gerador específico para essa recente piora dos preços dos ativos das economias emergentes, todos os fatores de risco elencados nos últimos meses permanecem presentes. Fonte: Bradesco – Departamento de Pesquisas e Estudos Econômicos.

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO %					
	31/07/2018	31/08/2018	jun/18	jul/18	ago/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 310.206.425,47	R\$ 344.735.849,45	0,5066	0,5299	0,5513	1,5961%	4,2550%	6,7900%
BRDESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 224.813.334,23	R\$ 218.692.492,60	0,5037	0,5276	0,5492	1,5889%	4,1786%	6,6600%
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 70.521.103,97	R\$ 70.282.380,53	0,3809	1,5048	(0,3397)	1,5453%	0,4025%	6,2200%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 8.064.355,34	R\$ 46.451.440,43	0,1201	0,6835	0,4065	1,2142%	1,2142%	6,6999%
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ 73.852.931,78	R\$ -	1,3766	1,3400	0,4639	3,2116%	7,1440%	10,1600%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 43.034.759,35	R\$ 41.923.130,90	0,0991	1,1000	0,1551	1,3572%	4,7800%	7,6400%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 45.235.762,88	R\$ 43.725.684,56	0,0077	2,2200	(0,6309)	1,5830%	3,5526%	4,7300%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.184.714,45	R\$ 5.162.812,79	(0,2624)	1,1293	(0,4224)	0,4379%	3,2563%	NC
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 219.335.956,83	R\$ 219.643.124,57	0,4499	0,9483	0,1400	1,5445%	1,9490%	NC
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 568.015.079,36	R\$ 604.559.680,46	0,4207	1,4619	(0,2703)	1,6134%	4,6897%	NC
CAIXA FI JUROS E MOEDAS	R\$ 15.179.797,72	R\$ 15.243.188,09	0,4637	0,5635	0,4176	1,4517%	1,6233%	NC
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 5.543.029,48	R\$ 5.232.167,63	(5,2480)	6,7205	(5,6082)	-4,5512%	-11,1305%	NC
SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	R\$ 71.908.733,02	R\$ 76.387.652,83	0,5100	0,5335	0,5320	1,5838%	4,3002%	NC
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 153.462.627,25	R\$ 153.040.189,50	0,4356	1,4557	(0,2753)	1,6172%	2,0268%	NC
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 29.055.271,82	R\$ 27.393.608,59	(5,0062)	10,4528	(5,7190)	-1,0773%	-5,7921%	NC
BB PREVID RF IRF MI	R\$ 467.293.625,10	R\$ 469.141.034,01	0,4997	0,6756	0,3953	1,5787%	4,0274%	6,6370%
BB PREVID TP VII	R\$ 31.678.201,17	R\$ 18.058.086,14	0,5791	1,0126	(0,0490)	1,5477%	4,5838%	7,0516%
BB PREVID TP IX	R\$ 8.733.110,58	R\$ 8.785.982,88	1,1189	0,5039	0,6054	2,2437%	5,4106%	7,6031%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 438.192.509,48	R\$ 451.450.035,92	0,2876	1,2336	(0,0768)	1,4468%	2,1721%	NC
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	R\$ 10.121.978,44	R\$ 10.178.529,23	0,5100	0,5286	0,5586	1,6057%	4,2157%	6,9500%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 205.545.798,38	R\$ 206.311.470,47	0,5900	0,5700	0,3725	1,5402%	4,8550%	7,4800%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 14.071.541,54	R\$ 15.499.343,89	(4,5900)	7,1000	(4,2300)	-2,1383%	-11,2259%	NC
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ -	R\$ 2.022.743,42	-	-	(0,7158)	-0,7158%	-0,7158%	NC
SAFRA S&P REAIS	R\$ -	R\$ 5.131.719,81	-	-	1,8739	1,8739%	1,8739%	NC
SAFRA CART PREMIUM MULTIMERCADO	R\$ -	R\$ 5.037.485,99	-	-	0,0032	0,0032%	0,0032%	NC
TOTAL	R\$ 3.019.050.647,64	R\$ 3.064.089.834,69						

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	jun/18	jul/18	ago/18
BRDESCO	R\$ 605.540.863,67	R\$ 605.540.863,67	R\$ 633.710.722,58
CAIXA	R\$ 970.224.871,38	R\$ 983.446.387,19	R\$ 981.941.229,43
BANCO DO BRASIL	R\$ 937.060.298,52	R\$ 945.897.446,33	R\$ 947.435.138,95
ITAÚ	R\$ 227.588.824,47	R\$ 229.739.318,36	R\$ 234.012.087,01
SANTANDER	R\$ 249.392.203,66	R\$ 254.426.632,09	R\$ 256.821.450,92
SAFRA	R\$ -	R\$ -	R\$ 10.169.205,80
TOTAL	R\$ 2.989.807.061,70	R\$ 3.019.050.647,64	R\$ 3.064.089.834,69

Quadro 2

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

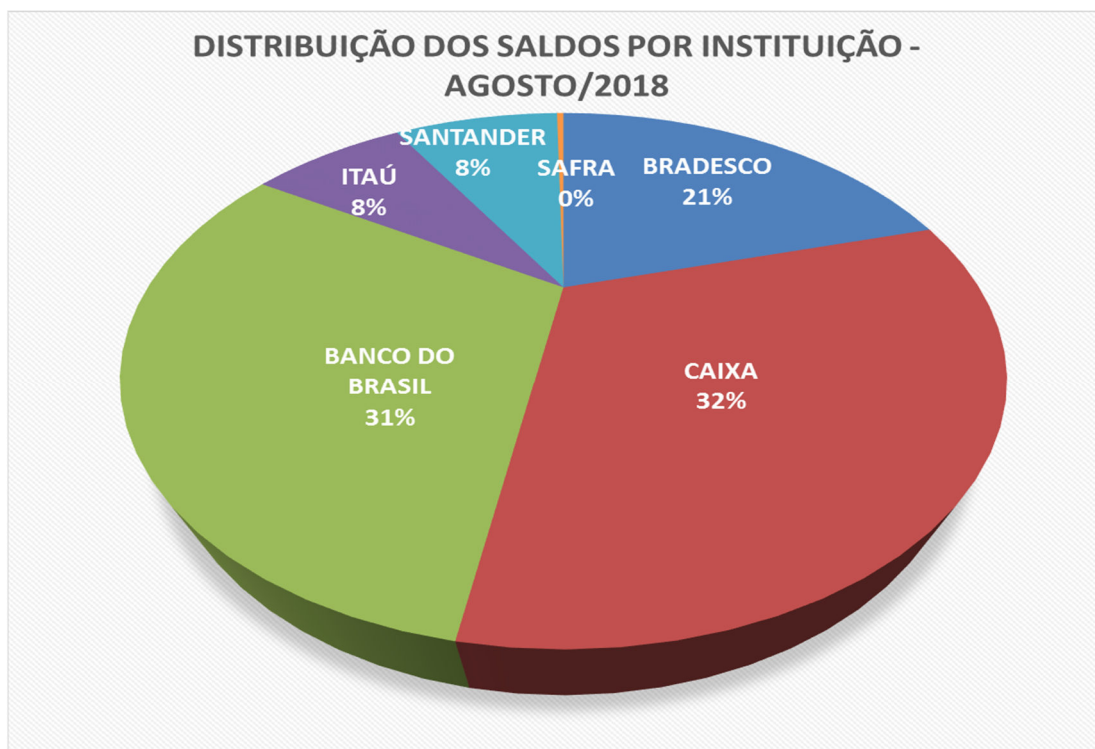


Gráfico 1

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\$ 649.994.524,11	21,21%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIM LP SAFRA CART PREMIUM MM	CDI ATIVO	R\$ 446.235.269,12	14,56%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF BB PREVID RF IRF MI	IRF M 1	R\$ 515.592.474,44	16,83%
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\$ 827.882.250,49	27,02%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 451.450.035,92	14,73%
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\$ 112.492.884,48	3,67%
SAFRA S&P REAIS	S&P 500	R\$ 5.131.719,81	0,17%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	IBOVESPA	R\$ 55.310.676,32	1,81%

Quadro 3

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

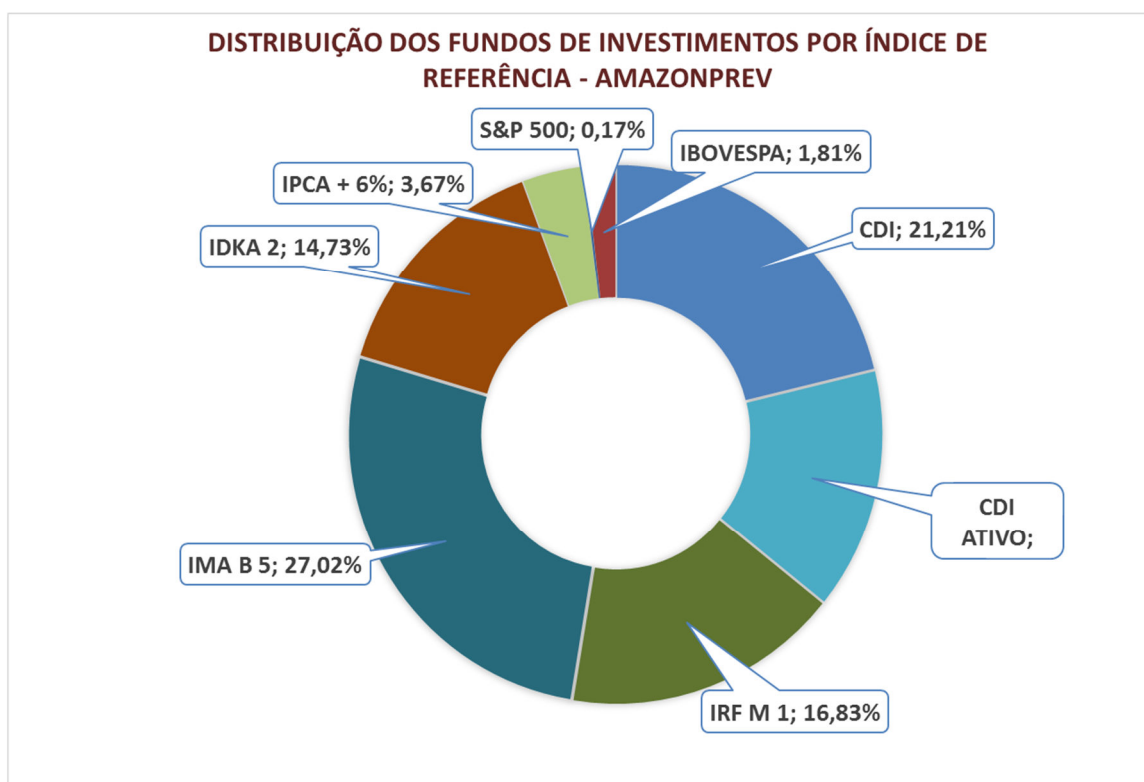


Gráfico 2

2.4 COMPARATIVO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA =

ÍNDICE	ago/18	ACUMULADO 2018	12 MESES
CDI	0,5700%	4,3200%	6,8400%
IMA-B 5	-0,2556%	4,0593%	6,6582%
IMA-B	-0,4477%	3,0360%	4,5653%
IMA B 5+	-0,5205%	1,8796%	2,6235%
IRF M 1	0,4397%	4,2145%	6,8986%
IDKA 2	0,0952%	4,7190%	8,0356%
S&P 500	3,6700%	11,1500%	22,6800%
IBOVESPA	-3,0800%	0,6500%	8,5700%

Quadro 4

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

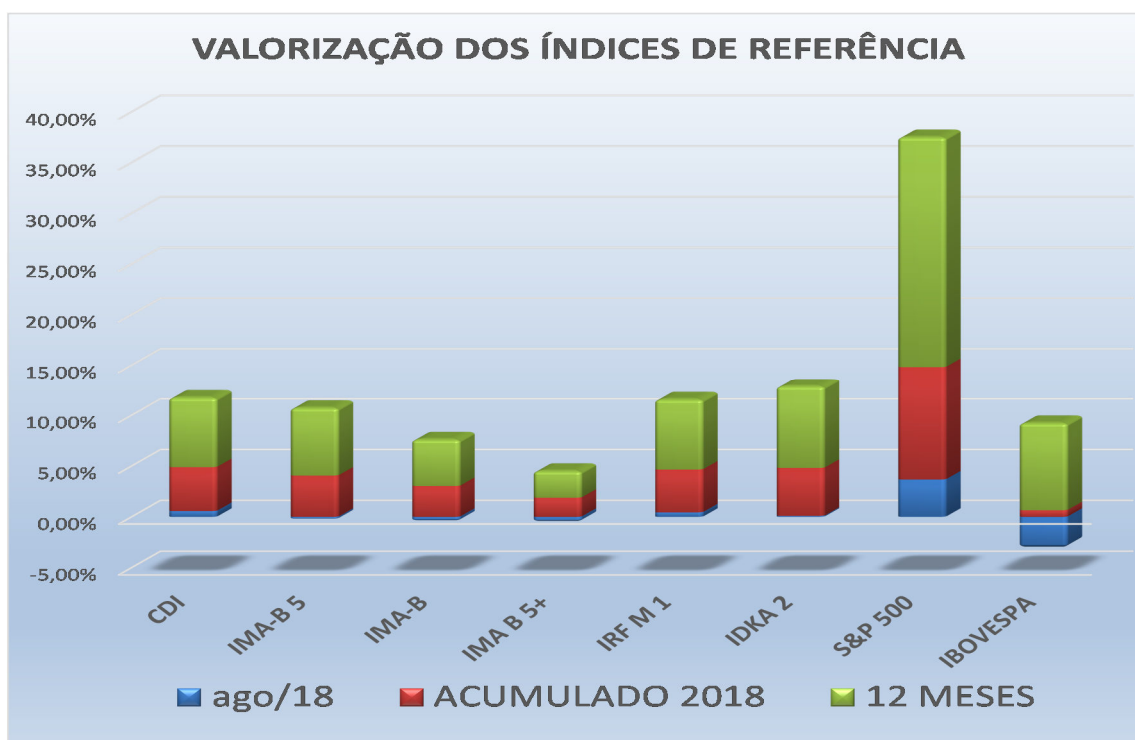


Gráfico 3.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2018	31/08/2018	jun/18	jul/18	ago/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 144.084.626,67	R\$ 144.710.132,58	0,3634	4,7417	0,434124%	5,1268%	9,0414%	13,3095%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 149.412.242,01	R\$ 146.048.566,71	(0,9558)	6,5622	0,443536%	5,5484%	6,5841%	10,1315%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 151.943.121,33	R\$ 148.510.051,66	(0,9558)	6,7386	0,467077%	5,7233%	6,7608%	10,3140%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 154.610.089,96	R\$ 151.186.093,13	(1,1713)	7,7778	0,443551%	6,5202%	6,7691%	10,0803%
TOTAL GERAL	R\$ 600.050.079,97	R\$ 590.454.844,09						

Quadro 5.

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

Nota 2: No mês agosto/2018 o Amazonprev recebeu o valor de R\$ 12.223.953,60 referente ao pagamento de Cupom Semestral de NTN B, ficando justificada a redução de valores dos TPF comparados ao mês anterior. Os valores recebidos foram aplicados no mercado financeiro conforme Deliberação CODIR de 14/08/2018, dentre eles aplicação nos fundos Safra Carteira Premium FI Multimercado, Safra S&P Reais PB FIC Multimercado, visando diversificar a Carteira e ampliar ganhos no Longo Prazo com produtos de gestão mais ativa.

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS – TPF

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
PREÇO UNITÁRIO ATUAL	R\$ 3.259,383037	R\$ 3.311,363828	R\$ 3.311,363828	R\$ 3.339,652417
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\$ 144.710.132,58	R\$ 146.048.566,71	R\$ 148.510.051,66	R\$ 151.186.093,13
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 6

2.7 SALDOS CVS - FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/07/2018	31/08/2018
CVS - A	R\$ 1.763.599,06	R\$ 1.746.145,74
CVS - B	R\$ 11.412.358,70	R\$ 11.299.380,90
CVS - C	R\$ 228.777,64	R\$ 226.513,56
CVS - D	R\$ 1.251.517,08	R\$ 1.239.127,56
TOTAL	R\$ 14.656.252,48	R\$ 14.511.167,76

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
jul/18	R\$ 42.846,25	R\$ 145.084,72	R\$ 187.930,97
ago/18	R\$ 42.426,28	R\$ 145.084,72	R\$ 187.511,00
TOTAL	R\$ 351.169,11	R\$ 1.160.550,87	R\$ 1.511.719,98

Quadro 8

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

2.9 CONTROLE DE RECEBIMENTO DE ALUGUEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2018			TOTAL
MÊS	UEA	SEAS	
jan/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/18	R\$ -	R\$ 394.023,20	R\$ 394.023,20
mar/18	R\$ 53.422,83	R\$ 267.638,40	R\$ 321.061,23
abr/18	R\$ 106.845,66	R\$ -	R\$ 106.845,66
mai/18	R\$ -	R\$ 40.145,76	R\$ 40.145,76
jun/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
jul/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
ago/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
set/18	R\$ -	R\$ 401.457,60	R\$ 401.457,60
TOTAL	R\$ 160.268,49	R\$ 1.103.264,96	R\$ 1.263.533,45

Quadro 9

Nota: Recebido no dia 12.09.18 o pagtº de 3 (três) parcelas da SEAS ref. aos meses de abril, maio e junho/18.

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

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

Valor Global R\$ 560.939,60

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

Quadro 10

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

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

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - SEAS - 2016/2017

Processo Administrativo nº. 018.01777.14-SEAS

Valor Global R\$ 2.141.102,40

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

Valor Mensal R\$ 178.425,20

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

Quadro 12

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

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

Valor Global R\$ 1.605.830,40

3º Aditivo ao Termo de Contrato nº.002/2015-SEAS

Valor Mensal R\$ 133.819,20

COMPETÊNCIA	DATA PAGTO	DCTO	CRÉDITO	SALDO
abr/18	12/09/18	0071036	R\$ 133.819,20	R\$ 1.472.011,20
mai/18	12/09/18	0071037	R\$ 133.819,20	R\$ 1.338.192,00
jun/18	12/09/18	0071038	R\$ 133.819,20	R\$ 1.204.372,80

Quadro 13

Nota: Recebido no dia 12.09.18 o pagto de 3 (três) parcelas da SEAS ref. aos meses de abril, maio e junho/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
jan/15	01/04/15	0014147	R\$ 154.905,21	R\$ 154.905,21		R\$ 4.411.425,20
fev/15	01/04/15	0014148	R\$ 153.301,63	R\$ 153.301,63		R\$ 4.258.123,57
mar/15	17/04/15	0017173	R\$ 151.698,05	R\$ 151.698,05		R\$ 4.106.425,52
abr/15	28/05/15	0023911	R\$ 150.094,46	R\$ 150.094,46		R\$ 3.956.331,06
mai/15	16/06/15	0026742	R\$ 148.490,88	R\$ 148.490,88		R\$ 3.807.840,18
jun/15	10/07/15	0030543	R\$ 146.887,30	R\$ 146.887,30		R\$ 3.660.952,88
jul/15	10/08/15	0035833	R\$ 145.283,71	R\$ 145.283,71		R\$ 3.515.669,17
ago/15	10/09/15	0041482	R\$ 143.680,13	R\$ 143.680,13		R\$ 3.371.989,04
set/15	24/11/15	0054929	R\$ 142.076,55	R\$ 142.076,55		R\$ 3.229.912,49
out/15	24/11/15	0054930	R\$ 140.472,27	R\$ 140.472,27		R\$ 3.089.440,22
nov/15	21/01/16	0000909	R\$ 138.869,38	R\$ 138.869,38		R\$ 2.950.570,84
dez/15	21/01/16	0000911	R\$ 137.265,80	R\$ 137.265,80		R\$ 2.813.305,04
jan/16	30/05/16	0024970	R\$ 135.662,22	R\$ 135.662,22		R\$ 2.677.642,82
fev/16	30/05/16	0024971	R\$ 134.058,63	R\$ 134.058,63		R\$ 2.543.584,19
mar/16	30/05/16	0024976	R\$ 132.455,05	R\$ 132.455,05		R\$ 2.411.129,14
abr/16	30/05/16	0024973	R\$ 130.851,47	R\$ 130.851,47		R\$ 2.280.277,67
mai/16	30/05/16	0024973	R\$ 129.247,89	R\$ 129.247,89		R\$ 2.151.029,78
jun/16	29/09/16	0041630	R\$ 127.644,30	R\$ 127.644,30		R\$ 2.023.385,48

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

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

memorando nº 345/2016 com histórico da locação dos imóveis. Deliberação da Diretoria, do dia 31/08/2016, que a GEJUR analise a possibilidade de contratação de corretor de imóveis, através de procedimento licitatório, para locação dos imóveis. Em resposta através de parecer no processo 2014.A.04879, a GEJUR opina pela possibilidade de contratação de corretor de imóveis, com a ressalva que o percentual referente pagamento dos honorários seja pago diretamente pelo locatário. Em elaboração de Projeto Básico para encaminhar para Licitação. Em abril, o corretor de imóvel, mandou as propostas com os ajustes, em elaboração processo licitatório. Em razão da irregularidade fiscal da empresa Corretora de imóveis, será realizada nova pesquisa de mercado para proposta de serviços. Aguardando proposta de empresa Corretora de Imóveis. Em elaboração pela COMAP de projeto básico. Recebido documentação e certidões de regularidade fiscal da empresa corretora de imóveis para compor o processo. Solicitado ajustes de proposta e regularização de certidões fiscais. Projeto básico em ajustes pela GERAf e COMAP em razão da necessidade de outras propostas. Aguardando novas propostas para prestação dos serviços. 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: GERAf/COMAP.**

IMÓVEL NO MUNICÍPIO DE TEFÉ: Foi elaborado o processo administrativo nº 2014.A.04022 que deverá ser encaminhado à Comissão Geral de Licitação para os procedimentos licitatórios e posteriormente a alienação do imóvel, localizado em Tefé. O processo estava na Gerência Jurídica para reanálise do processo de abertura de procedimento licitatório. O processo foi encaminhado pela GEJUR em outubro/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: GERAf/COMAP.**

Relatório de Investimentos Agosto 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	
	31/07/2018	31/08/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.019.050.647,64	R\$ 3.064.089.834,69
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 600.050.079,97	R\$ 590.454.844,09
TÍTULOS CVS	R\$ 14.656.252,48	R\$ 14.511.167,76
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.216,35	R\$ 5.748,19
TOTAL	R\$ 3.698.286.196,44	R\$ 3.733.589.594,73

Quadro 16

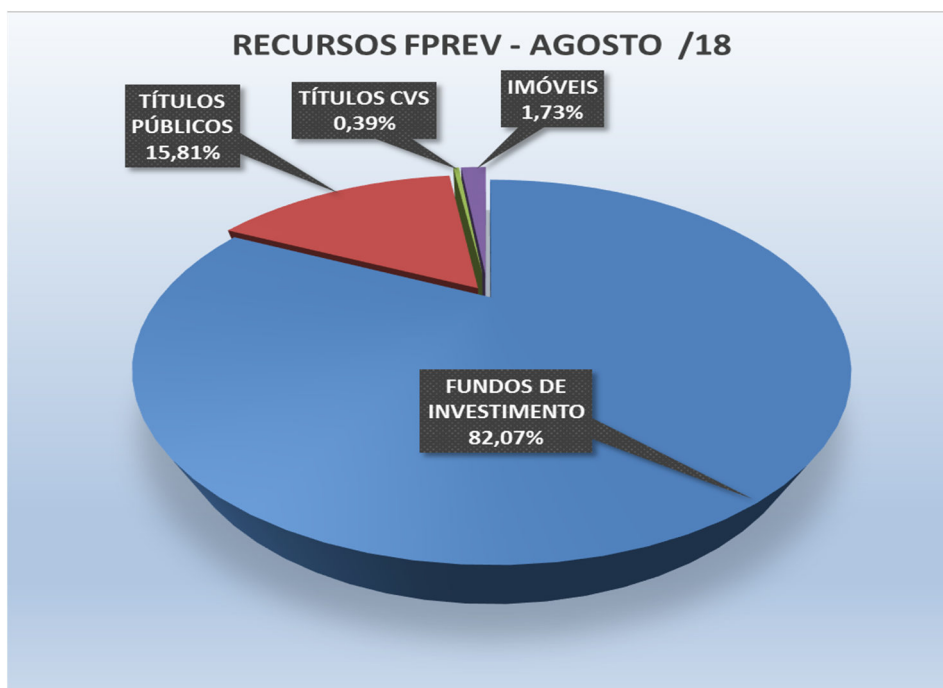


Gráfico 4

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

2.15 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

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

Quadro 17

2.16 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO

PERÍODO	TAXA
agosto/17	0,19%
julho/18	0,33%
agosto/18	-0,09%
Acumulado no ano de 2018	2,85%
Acumulado nos últimos 12 meses	4,19%
Meta Atuarial no mês	0,3963%

Quadro 18

2.17 RENTABILIDADE FPREV EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	AGOSTO/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2005 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,1113%	4,2039%	6,8235%	402,8378%
META ATUARIAL	0,3963%	6,9233%	10,4442%	367,3029%
RESULTADO ATUARIAL	-0,2839%	-2,5433%	-3,2783%	7,6043%

Quadro 19

Nota: Rentabilidade validada pelo atuário.

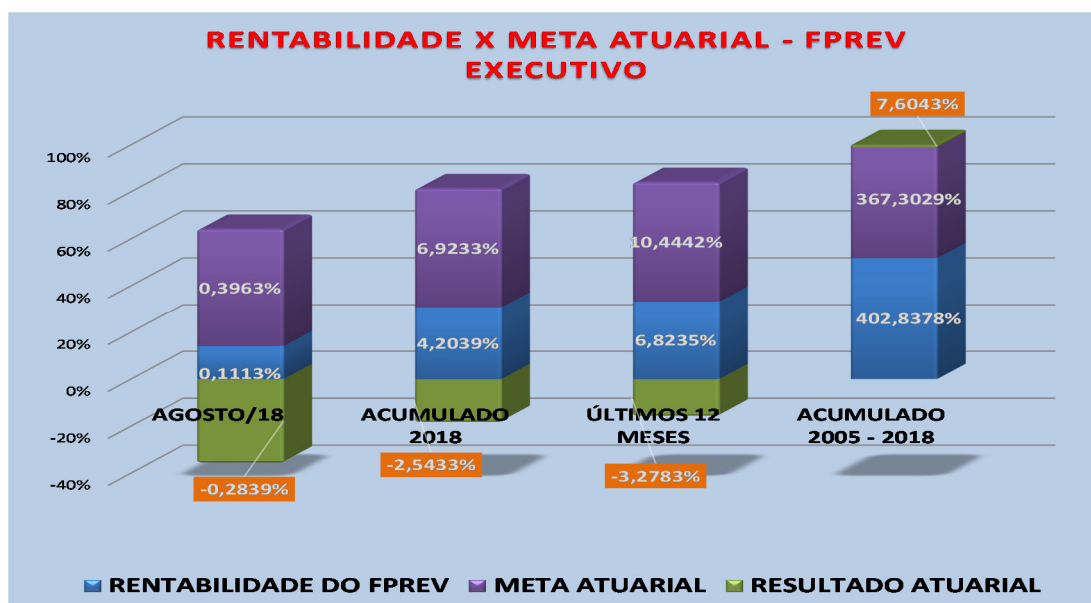


Gráfico 5.

Relatório de Investimentos Agosto 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 (%)					
	31/07/2018	31/08/2018	jun/18	jul/18	ago/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRABESCO FI REF. FEDERAL EXTRA	R\$ 3.293.345,23	R\$ 3.311.533,41	-	0,5300	0,5525	1,0854%	1,0854%	NC
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 3.189.540,13	R\$ 3.349.446,76	0,4499	0,9433	0,1400	1,5394%	0,6832%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 6.482.885,36	R\$ 6.660.980,17						

Quadro 20

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2018	31/08/2018	jun/18	jul/18	ago/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.039.159,03	R\$ 1.993.252,02	(0,9558)	6,5622	0,443536%	5,5484%	6,5841%	10,1315%
TOTAL GERAL	R\$ 2.039.159,03	R\$ 1.993.252,02						

Quadro 21

Nota: No mês agosto/2018 o Amazonprev recebeu o valor de R\$ 54.951,40 referente ao pagamento de Cupom Semestral de NTN B, ficando justificada a redução de valores dos TPF comparados ao mês anterior.

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	jun/18	jul/18	ago/18
SALDO ANTERIOR	8.150.747,92	8.251.023,62	8.522.044,39
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	96.865,88	98.647,18	100.428,57
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	3.409,82	172.373,59	31.759,23
SALDO FINAL	8.251.023,62	8.522.044,39	8.654.232,19

Quadro 22

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	31/07/2018	31/08/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 6.482.885,36	R\$ 6.660.980,17
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.039.159,03	R\$ 1.993.252,02
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 8.522.044,39	R\$ 8.654.232,19

Quadro 23

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

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

Quadro 24

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

DESCRIÇÃO	AGOSTO/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2012 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,3727%	4,0930%	6,3019%	118,086525%
META ATUARIAL	0,3963%	6,9233%	10,4442%	115,212490%
RESULTADO ATUARIAL	-0,0236%	-2,6470%	-3,7506%	1,335440%

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 (%)					
	31/07/2018	31/08/2018	jun/18	jul/18	ago/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI REF DI PREMIUM	R\$ 96.877.921,33	R\$ 97.414.926,59	0,5062	0,5299	0,5543	1,5987%	1,9828%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 96.877.922,33	R\$ 97.414.927,59						

Quadro 26.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

DESCRIÇÃO	AGOSTO/18	ACUMULADO 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,5543%	1,8987%
META ATUARIAL	0,3963%	3,5716%
RESULTADO ATUARIAL	0,1574%	-1,6152%

Quadro 27.

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

5. CONSOLIDADO – FPREV

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

ANO	ALE FPREV	EXEC. FPREV	MPE FPREV	TOTAL FPREV
2004	R\$ -	R\$ 15.862.618,50	R\$ -	R\$ 15.862.618,50
2005	R\$ -	R\$ 57.510.136,49	R\$ -	R\$ 57.510.136,49
2006	R\$ -	R\$ 83.649.681,60	R\$ -	R\$ 83.649.681,60
2007	R\$ -	R\$ 75.698.485,78	R\$ -	R\$ 75.698.485,78
2008	R\$ -	R\$ 179.805.240,72	R\$ -	R\$ 179.805.240,72
2009	R\$ -	R\$ 341.872.841,56	R\$ -	R\$ 341.872.841,56
2010	R\$ -	R\$ 489.868.867,80	R\$ -	R\$ 489.868.867,80
2011	R\$ -	R\$ 657.928.672,97	R\$ -	R\$ 657.928.672,97
2012	R\$ 436.901,72	R\$ 936.612.579,50	R\$ -	R\$ 937.049.481,22
2013	R\$ 1.239.708,12	R\$ 1.166.915.511,62	R\$ -	R\$ 1.168.155.219,74
2014	R\$ 2.509.280,78	R\$ 1.571.464.403,45	R\$ -	R\$ 1.573.973.684,23
2015	R\$ 3.643.310,21	R\$ 2.012.490.466,39	R\$ -	R\$ 2.016.133.776,60
2016	R\$ 5.660.283,00	R\$ 2.700.997.719,11	R\$ -	R\$ 2.706.658.002,11
2017	R\$ 7.574.592,78	R\$ 3.349.596.826,89	R\$ -	R\$ 3.357.171.419,67
2018	R\$ 8.654.232,19	R\$ 3.733.589.594,73	R\$ 97.414.927,59	R\$ 3.839.658.754,50

Quadro 28

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

Mês	Receitas	Despesas	Saldo	Patrimônio
jan/18	41.653.212,18	1.259.551,29	40.393.660,89	3.440.184.176,32
fev/18	28.289.917,62	1.162.275,60	27.127.642,02	3.484.408.078,74
mar/18	30.689.645,26	1.331.523,40	29.358.121,86	3.543.714.420,05
abr/18	29.217.580,21	1.356.698,77	27.860.881,44	3.584.144.059,18
mai/18	119.241.731,96	1.363.754,02	117.877.977,94	3.665.960.737,15
jun/18	32.029.606,75	822.507,98	31.207.098,77	3.703.582.328,39
jul/18	31.932.761,61	2.080.315,11	29.852.446,50	3.803.175.542,76
ago/18	32.641.595,98	1.353.348,22	31.288.247,76	3.839.658.754,50
set/18	0,00	0,00	0,00	0,00
out/18	0,00	0,00	0,00	0,00
nov/18	0,00	0,00	0,00	0,00
dez/18	0,00	0,00	0,00	0,00
Meta				6,92%
Rentabilidade				4,22%
Resultado				-2,53%

Quadro 29. Validado pelo atuário.

6. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

6.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Investimentos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2018	31/08/2018	jun/18	jul/18	ago/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 618.934,10	R\$ 2.612.109,67	0,5000	0,5205	0,5403	1,5689%	4,1410%	6,5856%
BRASESCO FI RF IRF M1 - COMPREV	R\$ 8.147.849,57	R\$ 8.173.428,91	0,5062	0,6600	0,3785	1,5525%	4,0136%	6,6212%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 500,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 8.767.283,67	R\$ 10.785.539,58						

Quadro 30

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

6.2 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit - FFIN ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/07/2018	31/08/2018
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 6.668,32
TOTAL	R\$ 1,00	R\$ 6.668,32

Quadro 31.

6.3 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	jun/18	jul/18	ago/18
SALDO ANTERIOR	R\$ 0,00	R\$ 19.657,15	R\$ 1,00
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 850.407,00	R\$ 853.619,67	R\$ 882.095,41
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.275.553,61	R\$ 1.754.531,03	R\$ 1.277.759,11
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
SAIDAS FINANCEIRAS	(2.106.303,46)	(2.627.806,85)	(2.153.187,20)
SALDO FINAL	19.657,15	1,00	6.668,32

Quadro 32

6.4 Disponibilidade Financeira – FFIN EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/07/2018	31/08/2018
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 118.549,01	R\$ 109.214,90
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ -	R\$ -
REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ -

Quadro 33

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

7. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

7.1 SALDOS E PERFORMANCE DOS RECURSOS – TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2018	31/08/2018	jun/18	jul/18	ago/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.517.817,62	R\$ 1.200.098,72	0,4948	0,5205	0,5403	1,5636%	4,1202%	7,3949%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF	R\$ 34.076.383,85	R\$ 35.215.422,84	0,4964	0,6835	0,4065	1,5946%	4,0749%	6,6999%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 35.594.202,47	R\$ 36.415.522,56						

Quadro 34

8. RECURSOS DOS OUTROS PODERES – TJA E TCE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/07/2018	31/08/2018	jun/18	jul/18	ago/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO FI REF. DI FEDERAL EXTRA	R\$ 99.051.250,46	R\$ 99.450.895,39	0,5031	0,5276	0,5525	1,5916%	3,2070%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF - TJA	R\$ 131.652.475,79	R\$ 133.692.753,60	0,4964	0,6835	0,4065	1,5946%	4,0749%	6,6955%
BB PREV. RF IRF M1 - TJA	R\$ 126.712.299,40	R\$ 128.718.384,91	0,4997	0,6756	0,3953	1,5787%	4,0404%	6,6323%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 357.416.025,65	R\$ 361.862.033,90						

Quadro 35

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

8.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	jun/18	jul/18	ago/18
SALDO ANTERIOR	347.800.486,62	352.391.415,50	357.416.025,65
REPASSES FINANCEIROS	3.000.201,70	3.000.312,32	3.009.050,50
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.737.003,90	2.250.472,37	1.584.308,47
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(146.276,72)	(226.174,54)	(147.350,72)
SALDO FINAL	R\$ 352.391.415,50	R\$ 357.416.025,65	R\$ 361.862.033,90

Quadro 36

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

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/07/2018	31/08/2018	jun/18	jul/18	ago/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO FI REF. DI FEDERAL EXTRA	R\$ 42.536.686,71	R\$ 42.771.604,34	0,5031	0,5276	0,5525	1,5916%	3,2070%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 53.454.719,79	R\$ 54.004.802,57	0,4964	0,6835	0,4065	1,5946%	4,0749%	6,6955%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 51.926.017,09	R\$ 52.464.114,43	0,4997	0,6756	0,3953	1,5787%	4,0404%	6,6323%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 141,06						
TOTAL	R\$ 147.917.423,59	R\$ 149.240.662,40						

Quadro 37

8.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	jun/18	jul/18	ago/18
SALDO ANTERIOR	144.959.915,58	146.378.613,42	147.917.423,59
REPASSES FINANCEIROS	820.814,72	811.326,36	815.319,44
VARIAÇÃO FINANCEIRA	726.505,49	920.493,98	657.808,11
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(128.622,37)	(193.010,17)	(149.888,74)
SALDO FINAL	R\$ 146.378.613,42	R\$ 147.917.423,59	R\$ 149.240.662,40

Quadro 38

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 Agosto de 2018

9. ENQUADRAMENTO

9.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2018	LIMITADA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
TÍTULOS DO TN	R\$ 592.448.096,10	13,67%	40,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 650.323.533,35	51,91%	40,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 18.058.086,14				
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.785.982,88				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 451.450.035,92				
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 153.040.189,50				
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 8.173.428,91				
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 269.364.419,44				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 604.559.680,46				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 41.923.130,90				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 43.725.684,56				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 3.812.208,39	32,22%	15%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 364.226.525,74				
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 442.150.776,04				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 70.282.380,53				
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 206.311.470,47				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 222.992.571,33				
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ -				
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 76.387.652,83				
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 10.178.529,23				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 15.499.343,89	0,36%	1%	30%	art. 8º, inciso I, "a"
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 5.232.167,63	0,92%	2%	20%	art. 8º, inciso II, "a"
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.022.743,42				
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 27.393.608,59				
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.162.812,79				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 5.131.719,81	0,59%	1%	10%	art. 8º, inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.037.485,99				
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.243.188,09				
TÍTULOS CVS	R\$ 14.511.167,76	0,33%	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	-	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC
TOTAL	R\$ 4.333.428.620,69	100,00%			

Quadro 39

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\$ 3.812.208,39	R\$ 4.333.428.620,69	0,09%	20%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 364.226.525,74		8,41%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 442.150.776,04		10,20%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 70.282.380,53		1,62%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 206.311.470,47		4,76%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 222.992.571,33		5,15%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ -		0,00%	
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 76.387.652,83		1,76%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 10.178.529,23		0,23%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 15.499.343,89		0,36%	

Quadro 40

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

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

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 650.323.533,35	12.924.978.431,45	5,03%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 18.058.086,14	629.013.509,37	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX - 15/08/2018	R\$ 8.785.982,88	179.086.197,93	4,91%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 451.450.035,92	6.422.224.907,49	7,03%	
SANTANDER FIC INST. REF DI	R\$ 76.387.652,83	4.825.752.877,70	1,58%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 153.040.189,50	1.243.901.746,15	12,30%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 27.393.608,59	598.029.169,60	4,58%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 206.311.470,47	2.165.446.758,26	9,53%	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI	R\$ 10.178.529,23	1.055.817.736,17	0,96%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 15.499.343,89	690.590.662,84	2,24%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIS FIC FI	R\$ 2.022.743,42	1.001.639.246,48	0,20%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 5.131.719,81	432.767.405,01	1,19%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.037.485,99	2.143.096.683,11	0,24%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 269.364.419,44	19.599.360.376,27	1,37%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 604.559.680,46	8.138.580.047,05	7,43%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 222.992.571,33	2.363.020.349,90	9,44%	
CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF	R\$ -	1.373.035.693,85	0,00%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 41.923.130,90	245.459.549,30	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 43.725.684,56	178.443.589,90	24,50%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.162.812,79	257.471.906,54	2,01%	
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.243.188,09	581.535.867,79	2,62%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 5.232.167,63	35.328.271,06	14,81%	
BRASESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 364.226.525,74	7.982.225.397,35	4,56%	
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 70.282.380,53	536.397.492,78	13,10%	
BRASESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 8.173.428,91	1.878.352.292,23	0,44%	
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 3.812.208,39	401.334.763,11	0,95%	
BRASESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 442.150.776,04	9.040.363.132,81	4,89%	

Quadro 41

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.

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA JULHO/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\$ 908.219,34	R\$ 1.128.617.638,29	0,1243%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 637.121,78	R\$ 888.645.319,61	0,1395%	
BRADESCO	R\$ 597.485,04	R\$ 231.989.343,59	0,0388%	
CAIXA	R\$ 302.030,33	R\$ 1.208.203.655,20	0,4000%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	R\$ 257.955,00	R\$ 256.821.450,92	0,0996%	

Quadro 42

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 Agosto de 2018

10. TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO	
DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.064.089.834,69
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 590.454.844,09
CVS	R\$ 14.511.167,76
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 5.748,19
TOTAL	R\$ 3.733.589.594,73
ASSEMBLEIA LEGISLATIVA - ALE FPREV E ALE FFIN	
DESCRIÇÃO	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 6.660.980,17
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 1.993.252,02
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ -
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 8.654.233,19
MPE FPREV	
DESCRIÇÃO	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 97.414.926,59
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 97.414.927,59
TAXA DE ADM. FFIN EXECUTIVO, COMPREV, SAL. NÃO RECL. E DISP. FINANCEIRA	
DESCRIÇÃO	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	R\$ 36.415.521,56
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 2.612.109,67
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 8.173.428,91
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM.	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - FFIN	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ 6.668,32
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 109.214,90
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -
TOTAL	R\$ 47.316.945,36
OUTROS PODERES	
ORGÃOS	SALDO
TJ/AM	R\$ 361.862.033,90
TCE/AM	R\$ 149.240.521,34
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA/TCE	R\$ 141,06
TOTAL	R\$ 511.102.696,30
TOTAL GERAL	4.398.078.397,16

Quadro 43

Relatório de Investimentos Agosto de 2018

10.1 CONSOLIDADO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	FPREV PODER EXECUTIVO	FPREV - ALE	TOTAL - FPREV
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.064.089.834,69	R\$ 6.660.980,17	R\$ 3.070.750.814,86
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 590.454.844,09	R\$ 1.993.252,02	R\$ 592.448.096,10
CVS	R\$ 14.511.167,76	R\$ -	R\$ 14.511.167,76
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ -	R\$ 64.528.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 5.748,19	R\$ 1,00	R\$ 5.749,19
TOTAL	R\$ 3.733.589.594,73	R\$ 8.654.233,19	R\$ 3.742.243.827,91

DESCRIÇÃO	FFIN - PODER EXECUTIVO	FFIN - ALE	TOTAL FFIN
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 2.612.109,67	R\$ -	R\$ 2.612.109,67
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 2.612.109,67	R\$ 1,00	R\$ 2.612.110,67

DESCRIÇÃO	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	SALARIOS NÃO RECLAMADOS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 36.415.521,56	R\$ -	R\$ 36.415.521,56
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 109.214,90	R\$ 109.215,90
TOTAL	R\$ 36.415.522,56	R\$ 109.214,90	R\$ 36.524.737,46

DESCRIÇÃO	COMPREV	DISP. COBERTURA DEFICIT E REPASSE PATRONAIS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 8.173.428,91	R\$ -	R\$ 8.173.428,91
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ 6.668,32	R\$ 6.668,32
TOTAL	R\$ 8.173.428,91	R\$ 6.668,32	R\$ 8.180.097,23

DESCRIÇÃO	RECURSOS TJ/AM	RECURSOS TCE/AM	TOTAL RECURSOS TCE E TJ
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 361.862.033,90	R\$ 149.240.521,34	R\$ 511.102.555,24
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 141,06	R\$ 141,06
TOTAL	R\$ 361.862.033,90	R\$ 149.240.662,40	R\$ 511.102.696,30

DESCRIÇÃO	RECURSOS MPE FPREV		TOTAL RECURSOS MPE FPREV
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 97.414.926,59	R\$ -	R\$ 97.414.926,59
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 97.414.927,59	R\$ -	R\$ 97.414.927,59

TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV			R\$ 4.398.078.397,16
--	--	--	-----------------------------

Quadro 44

Relatório de Investimentos Agosto de 2018



Gráfico 6.

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

Sem mais a informar, segue para Superior Consideração.

Respeitosamente,

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Leonardo Cavalcanti
Membro

Renízio Ferreira
Membro