

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 18/02/2019

RELATÓRIO N°. 006/2019 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **janeiro/2019**, 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 16);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV/ALEAM (páginas 16 a 17);
- 4) Recursos do Ministério Público - FPREV - (páginas 18)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (páginas 18 a 19);
- 6) Recursos do FFIN Executivo – (página 19 a 20);
- 7) Recursos da Taxa de Administração - (página 20);
- 7) Recursos dos Outros Poderes: Saldo e Composição – TCE e TJA (página 22 a 23);
- 8) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 23 a 26);
- 9) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 27 a 28).

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

No Brasil, a inflação ao consumidor (IPCA) fechou 2018 abaixo do centro da meta estipulada pelo governo. No mês de dezembro, o indicador registrou inflação ao consumidor de 0,15%, em linha com a nossa expectativa (0,15%). Essa variação é a menor para o mês desde 1994. Considerando o ano de 2018, o IPCA acumulou alta de 3,75%, resultado abaixo do centro da meta do Banco Central, de 4,5%. Em 2018, os destaques do índice foram os grupos Alimentação e Bebidas, com alta de 4,04% no ano, ante -1,87% em 2017. O grupo Habitação subiu 4,72%, enquanto Transportes apresentou elevação de 4,19%. Com relação aos preços de Serviços, houve aumento de 3,35% em 2018, a menor variação da série histórica. Esse grupo teve elevação de 4,5% em 2017 e média de 7,49% de 2012 a 2017. A média dos núcleos encerrou o ano com alta de 2,82% após elevação de 3,24% em 2017, e segue bem-comportada. Além disso, a prévia da inflação de janeiro (IPCA-15), registrou aumento de 0,30% no período. Diante desse cenário, os indicadores de preços têm sugerido um quadro de inflação benigno em 2019. Espera-se que a inflação encerre 2019 com variação de 3,7%, novamente abaixo da meta do Banco Central para o ano, de 4,25%.

Com relação aos dados de atividade de novembro, a indústria apresentou recuperação modesta, o crescimento do setor de serviços desacelerou, e os dados de varejo foram impactados positivamente pela Black Friday. No mês, a produção industrial cresceu 0,1% na margem, impactada pela queda na produção de bens de capital e de bens duráveis de 2,7% e 3,4%, respectivamente. O destaque positivo foi a produção de bens intermediários, com crescimento de 0,7% na margem. Por sua vez, o setor de serviços registrou estabilidade na margem. Em termos anuais, a Pesquisa Mensal de Serviços mostrou menor expansão do setor entre outubro e novembro, desacelerando de 1,6% para 0,9%. Por fim, as vendas do varejo foram positivamente impactadas pela Black Friday, fechando novembro com crescimento de 2,9% na margem, acima de nossa projeção (1,2%) e do mercado (1,0%). Entre os grupos, destaque para o segmento de móveis e eletrodomésticos, que cresceu 5,0% na margem, e para a expansão de 6,9% no segmento de outros artigos de uso pessoal, que inclui vendas on-line. O destaque negativo ficou por conta do setor de automóveis, que registrou contração de 2,2% na variação mensal. Tais resultados implicaram o aumento de 0,3% do Índice de Atividade do Banco Central (IBC-Br), na margem. Em termos anuais, o IBC-Br registrou expansão de 1,9%. Diante desses números, nossa expectativa de crescimento no 4º trimestre é de 0,3% ante o trimestre anterior. Com isso, o PIB deverá encerrar o ano com elevação de 1,3%. Para 2019, projeta-se crescimento de 2,6%.

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

A criação de emprego formal (Caged) registrou saldo positivo em 2018, após três anos consecutivos com fechamento de vagas com carteira assinada. Em dezembro, ocorreu o fechamento líquido de 334,5 mil vagas, resultado acima da nossa projeção (-385 mil) e da expectativa do mercado (-344 mil). Na série com ajuste sazonal, esse número sobe para 65,1 mil vagas criadas, desacelerando em relação às 74,1 mil vagas geradas no mês anterior. No total de 2018, houve a criação líquida de 529,5 mil novos postos de trabalho com carteira assinada (considerando as declarações de emprego entregues fora do prazo), e assim retornando ao saldo positivo após três anos. Diante do resultado melhor do que o esperado no final do ano, e com a expectativa de uma maior recuperação da atividade econômica, nossas projeções apontam que o ritmo de abertura de vagas formais, com ajuste sazonal, deve acelerar para cerca de 70 mil novos postos ao mês no 1º trimestre de 2019.

Nos EUA, a inflação apresentou queda em dezembro, o mercado de trabalho segue robusto e a ata do comitê de política monetária (FOMC) reiterou cautela na política monetária. Na margem, o índice de preços ao consumidor (CPI) dos Estados Unidos caiu 0,1% em dezembro, o menor valor desde março. Na comparação anual, o CPI subiu 1,9% em dezembro, após crescimento de 2,2% em novembro. Por sua vez, a medida de núcleo apresentou elevação de 2,2% em dezembro, mesmo valor do mês anterior. A inflação segue bem-comportada e próxima da meta do Banco Central americano (Fed), de 2,0%. Já o mercado de trabalho registrou abertura de 184 mil vagas em dezembro, totalizando 2,6 milhões de vagas em 2018. Apesar do quadro benigno do mercado de trabalho, alguns indicadores de confiança sinalizam perda de ímpeto da atividade nos próximos meses. Nesse contexto, o índice de confiança da indústria (ISM) cedeu de 59,3 para 54,1 pontos entre novembro e dezembro, a maior queda na margem desde a crise de 2008. Diante desse cenário, a ata do FOMC reiterou que uma mudança na sinalização futura da política monetária e as altas de juros se tornaram mais condicionadas à evolução da conjuntura econômica de curto prazo. Na ata é sinalizado que, com base nas informações atuais, a taxa básica de juros encontra-se próxima do limite inferior das estimativas de taxa de juros neutra considerada pelos membros do comitê. Assim, o espaço adicional para aperto de política monetária seria modesto. Na nossa avaliação, o Fed elevará a taxa básica de juros (Fed Funds) duas vezes em 2019, terminando o ano no intervalo entre 2,75% a 3,0% a.a.

Na Zona do Euro, Banco Central Europeu (BCE) manteve a taxa de juros e o indicador de confiança da região permanece em queda. O BCE manteve a taxa de juros de referência em zero e a taxa de depósito negativa em 0,4% a.a., conforme o esperado. Já a taxa de empréstimos segue

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

em 0,25% a.a. A autoridade monetária reafirmou o plano de manter os juros nos baixos níveis atuais pelo menos até outubro. Em seu discurso, Mario Draghi (presidente do BCE), mudou a avaliação sobre a perspectiva de crescimento da zona do euro para um quadro mais negativo, impactado por diversos fatores, entre eles a desaceleração da China e os possíveis efeitos do Brexit (saída do Reino Unido da União Europeia). Na sua avaliação, as condições robustas do mercado de trabalho ainda oferecem suporte para a inflação convergir para a meta, de 2,0% a.a.. Porém, no curto prazo, o quadro de inflação ainda não demonstra sinais de aceleração mais consistente. Além disso, os indicadores de confiança (PMI) da zona do euro registraram queda em janeiro. A confiança da indústria diminuiu de 51,4 pontos em dezembro, para 50,5 pontos em janeiro (com previsão de estabilidade pelo mercado), atingindo assim o menor nível em 50 meses. Vale destacar que o indicador acima da marca de 50 pontos indica expansão de atividade. Diante desse cenário sem sinais de recuperação da atividade na região, e diminuição no nível de confiança, o BCE deve manter o estímulo monetário em 2019.

Na China a desaceleração da atividade resultou no menor crescimento anual do Produto Interno Bruto (PIB) desde 1990. Ao longo de 2018, a economia chinesa cresceu 6,6%, ritmo inferior à expansão de 6,8% observada em 2017, porém atingindo a meta de crescimento do governo (cerca de 6,5%). Esse crescimento é o menor em 28 anos, corroborando o cenário de desaceleração da economia chinesa. Com relação aos indicadores de atividade, a indústria cresceu 6,2% em 2018, ante 6,6% em 2017. As vendas do varejo avançaram 9% e o Investimento em Ativo Fixo (FAI) expandiu 5,9%. Em termos de comércio exterior, as exportações caíram 4,4% em dezembro, ante expansão de 5,4% em novembro, enquanto importações caíram 7,6% em dezembro, ante alta de 3,0% em novembro, na comparação com o mesmo período no ano anterior. Com esses números, a balança comercial registrou superávit de US\$ 57,1 bilhões no mês. Para 2019, diante dos impactos esperados da tensão comercial e refletindo a perspectiva de menor expansão da economia global, o PIB chinês deverá desacelerar para um patamar de crescimento mais próximo de 6,0%. Fonte: SÍNTESE ECONÔMICA DE JANEIRO – BRAM.

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO %					
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 591.436.393,94	R\$ 594.592.023,17	0,4855	0,4855	0,5338	1,5123%	0,5338%	6,2804%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.081.978,58	R\$ 60.014.475,59	0,1488	1,3642	1,5783	3,1173%	1,5783%	NC
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 9.976.576,35	R\$ 57.481,60	0,4699	0,4694	0,5189	1,4652%	0,5189%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 29.070.419,11	R\$ 34.382.271,89	0,5283	0,5423	0,5679	1,6475%	0,5679%	NC
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 43.605.856,12	R\$ 44.062.854,44	0,1000	0,9230	1,0480	2,0827%	1,0480%	8,9585%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 47.176.802,93	R\$ 48.318.355,17	0,1166	1,7701	2,4197	4,3542%	2,4197%	11,0194%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 228.664.067,28	R\$ 235.251.671,42	0,3748	1,3260	2,8809	4,6358%	2,8809%	NC
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 638.148.398,84	R\$ 647.930.638,74	0,1348	1,3784	1,5329	3,0712%	1,5329%	NC
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 68.746.040,33	R\$ 73.233.223,43	1,6801	1,8008	6,5272	10,2675%	6,5272%	NC
SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	R\$ 77.929.446,68	R\$ 78.356.130,23	0,4933	0,5047	0,5475	1,5535%	0,5475%	6,3684%
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 161.498.787,27	R\$ 163.956.008,06	0,1270	1,3445	1,5215	3,0171%	1,5215%	NC
BB PREVID RF IRF MI	R\$ 380.418.978,54	R\$ 387.753.490,53	0,5204	0,5360	0,5753	1,6406%	0,5753%	6,7451%
BB PREVID TP VII	R\$ 18.957.943,62	R\$ 19.212.239,36	0,1671	1,1617	1,3413	2,6899%	1,3413%	9,9791%
BB PREVID TP IX	R\$ 8.955.314,25	R\$ 9.001.759,34	0,4715	0,4705	0,5186	1,4677%	0,5186%	6,8903%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 526.943.106,02	R\$ 533.347.173,94	0,1085	1,2226	1,2153	2,5639%	1,2153%	NC
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ 103.358.326,50	R\$ 110.161.303,51	1,5822	1,8399	6,5819	10,2603%	6,5819%	NC
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 223.451.683,80	R\$ 228.754.554,17	0,7500	1,4896	2,3732	4,6774%	2,3732%	9,1780%
TOTAL	R\$ 3.217.420.120,16	R\$ 3.268.385.654,59						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO %					
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.382.009,00	R\$ 5.411.979,69	0,6028	0,8289	0,5569	2,0015%	0,5569%	NC
CAIXA FI JUROS E MOEDAS	R\$ 15.543.788,95	R\$ 15.618.427,70	0,3920	0,4638	0,4802	1,3419%	0,4802%	NC
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 3.466.870,81	R\$ 3.902.087,76	3,3047	(0,3918)	12,5536	15,8176%	12,5536%	NC
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 32.565.194,04	R\$ 35.433.478,32	2,1810	0,4100	8,8078	11,6367%	8,8078%	NC
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 33.622.002,29	R\$ 44.985.421,91	3,0600	0,0561	9,8800	13,3059%	9,8800%	NC
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.433.185,55	R\$ 2.634.843,15	2,8900	3,6705	8,2878	15,5069%	8,2878%	NC
SAFRA S&P REAIS	R\$ 4.497.393,48	R\$ 4.838.695,77	1,8008	(8,9543)	7,5889	-0,2810%	7,5889%	NC
SAFRA PREMIUM MULTMERCADO	R\$ 5.167.238,26	R\$ 5.212.223,75	0,6882	0,3579	0,8706	1,9283%	0,8706%	NC
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 25.910.354,60	R\$ 37.197.062,14	2,1954	2,2298	12,3200	17,3453%	12,3200%	NC
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 25.766.949,73	R\$ 35.811.160,13	(0,4240)	2,8025	7,6200	10,1669%	7,6200%	NC
TOTAL	R\$ 154.354.986,71	R\$ 191.045.380,32						
TOTAL GERAL	R\$ 3.371.775.106,87	R\$ 3.459.431.034,91						

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.

Nota 2: Registra-se, com base no Cenário comentado, o resultado para o mês de janeiro/2019 dos fundos de Renda Fixa indexados ao IMA B5+, e para os fundos de Renda Variável Ibovespa Ativo, com ganhos que atingem, no trimestre, até 17,34%.

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

2.2 EVOLUÇÃO DOS SALDOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	nov/18	dez/18	jan/19
BRADESCO	R\$ 648.468.343,24	R\$ 660.494.948,87	R\$ 654.663.980,36
CAIXA	R\$ 1.055.410.395,25	R\$ 1.079.804.253,37	R\$ 1.108.111.510,24
BANCO DO BRASIL	R\$ 1.018.104.354,61	R\$ 1.038.633.668,93	R\$ 1.059.475.966,68
ITAÚ	R\$ 240.697.268,57	R\$ 259.506.871,64	R\$ 276.374.819,23
SANTANDER	R\$ 269.326.001,48	R\$ 271.993.427,99	R\$ 277.745.616,61
SAFRA	R\$ 10.048.846,20	R\$ 9.664.631,74	R\$ 10.050.919,52
ICATÚ	R\$ 10.219.536,06	R\$ 25.910.354,60	R\$ 37.197.062,14
BTG	R\$ 9.957.601,79	R\$ 25.766.949,73	R\$ 35.811.160,13
TOTAL	R\$ 3.262.232.347,20	R\$ 3.371.775.106,87	R\$ 3.459.431.034,91

Quadro 2

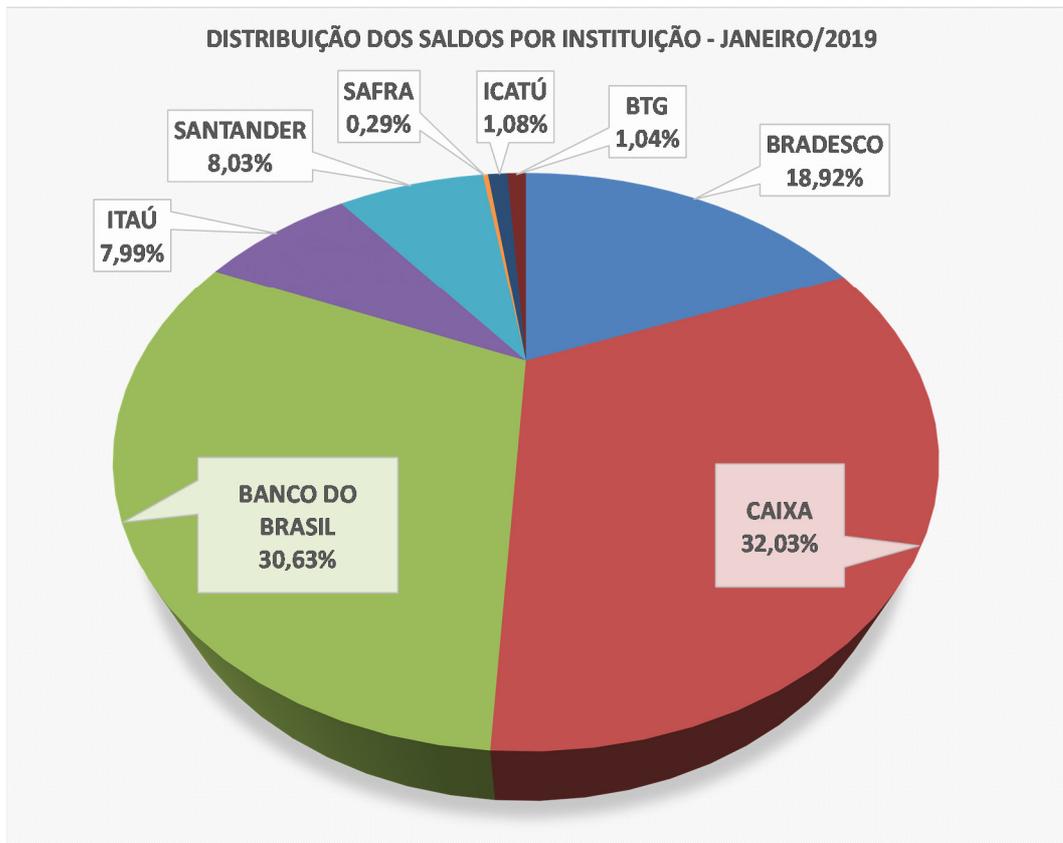


Gráfico 1

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM BRADESCO FI MAXI PODER PUBLICO SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	CDI	R\$ 673.005.635,00	19,45%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIM LP SAFRA CART PREMIUM MM	CDI ATIVO	R\$ 484.836.877,04	14,01%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF BB PREVID RF IRF MI	IRF M 1	R\$ 422.135.762,42	12,20%
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\$ 871.901.122,39	25,20%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 533.347.173,94	15,42%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP BB PREVID RF IMA B5+	IMA B 5+	R\$ 183.394.526,94	5,30%
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\$ 120.595.208,31	3,49%
SAFRA S&P REAIS	S&P 500	R\$ 4.838.695,77	0,14%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA BTG ABSOLUTO FIQ FIA	IBOVESPA	R\$ 165.376.033,10	4,78%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 3.459.431.034,91	100%

Quadro 3

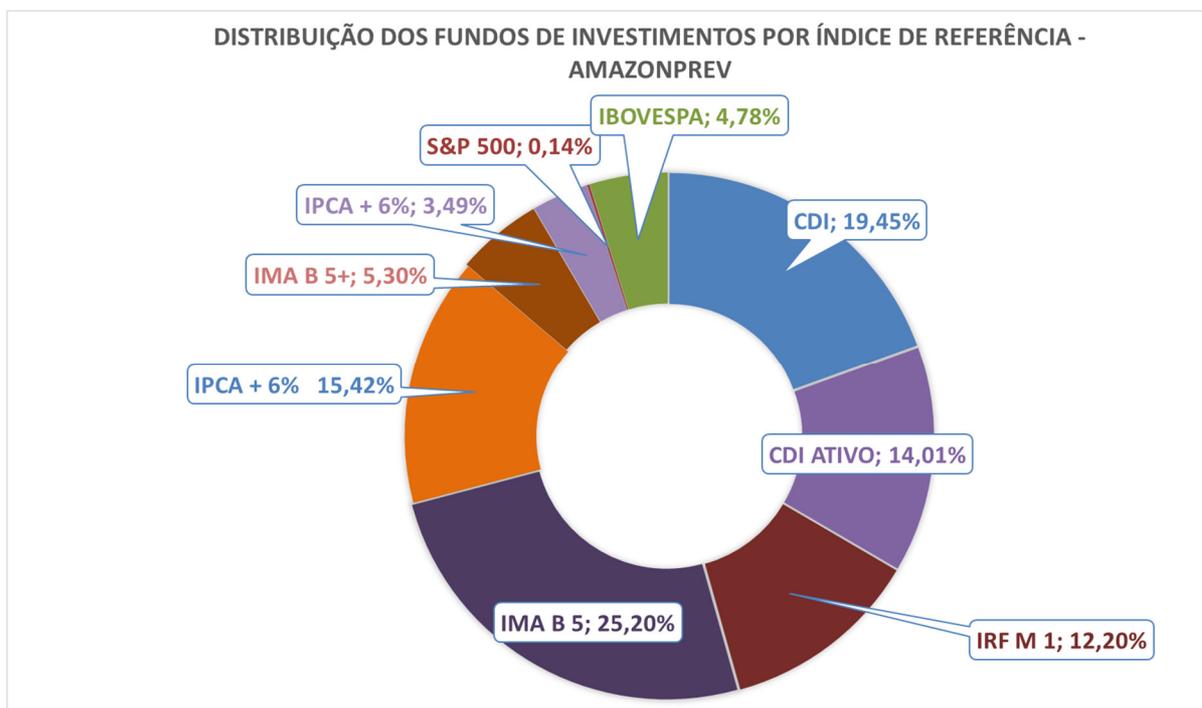


Gráfico 2

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

2.4 COMPARATIVO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA

ÍNDICE	jan/19	ACUMULADO 2019	12 MESES
CDI	0,5400%	0,5400%	6,3800%
IMA-B 5	1,5396%	1,5396%	10,0889%
IMA-B	4,3661%	4,3661%	14,1137%
IMA B 5+	6,6111%	6,6111%	17,2334%
IRF M 1	0,5799%	0,5799%	6,9612%
IDKA 2	1,2621%	1,2621%	10,2932%
IBOVESPA	10,8200%	10,8200%	14,7000%

Quadro 4

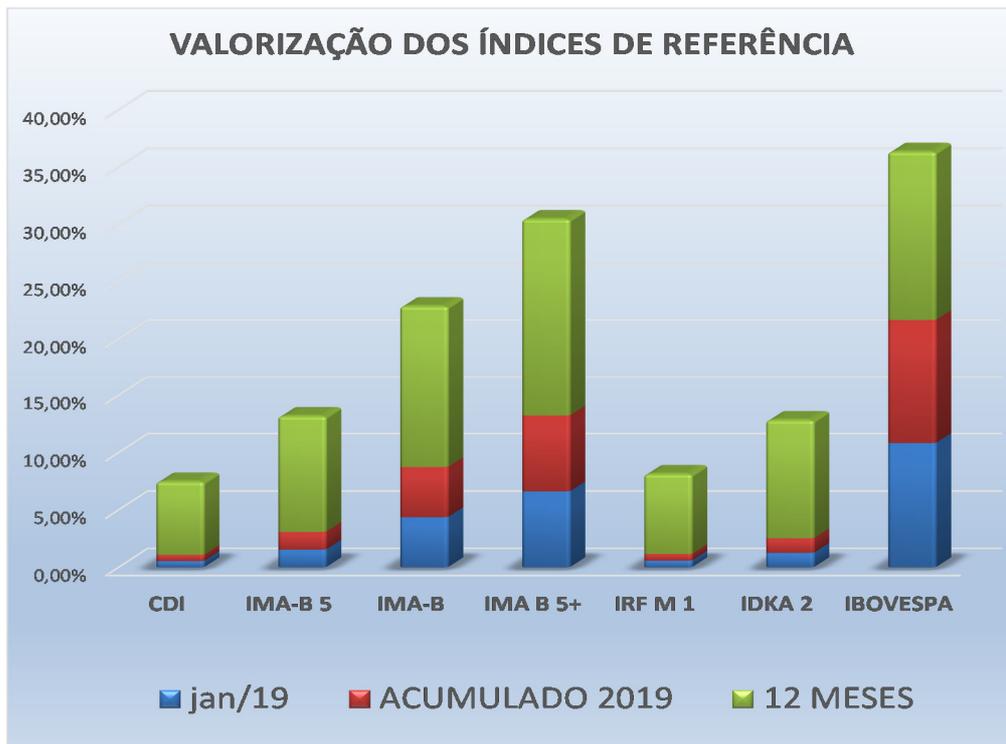


Gráfico 3.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 144.030.686,09	R\$ 146.230.572,51	0,3135	0,6754	0,8463	1,8457%	0,8463%	8,9304%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 149.469.639,42	R\$ 151.781.041,62	0,3229	0,6848	0,8557	1,8743%	0,8557%	6,4482%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 152.095.675,33	R\$ 154.520.092,77	0,3464	0,7084	0,8794	1,9459%	0,7994%	6,7743%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 154.727.580,93	R\$ 157.120.341,21	0,3229	0,6848	0,8557	1,8743%	0,8557%	5,4717%
TOTAL GERAL	R\$ 600.323.581,77	R\$ 609.652.048,11						

Quadro 5.

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

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS – TPF

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45
VALOR ATUAL	R\$ 146.230.572,51	R\$ 151.781.041,62	R\$ 154.520.092,77	R\$ 157.120.341,21
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	
	31/12/2018	31/01/2019
CVS - A	R\$ 1.676.332,46	R\$ 1.658.879,14
CVS - B	R\$ 10.847.469,70	R\$ 10.734.491,90
CVS - C	R\$ 217.457,24	R\$ 215.193,16
CVS - D	R\$ 1.189.569,48	R\$ 1.177.179,96
TOTAL	R\$ 13.930.828,88	R\$ 13.785.744,16

Quadro 7

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/19	R\$ 40.326,42	R\$ 145.084,72	R\$ 185.411,14
TOTAL	R\$ 40.326,42	R\$ 145.084,72	R\$ 185.411,14

Quadro 8

2.9 CONTROLE DE RECEBIMENTO DE ALUGUEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2019			TOTAL
MÊS	UEA	SEAS	
jan/19	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ -	R\$ -

Quadro 9

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

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

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

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

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

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

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

CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - UEA

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

Quadro 10

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

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

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

parcela mensal R\$ 58.180,96

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

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

Quadro 11

2.12 CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL – SEAS

CONTRATO	Nº PARCELA	Nº OB	DATA PAGAMENTO	PARCELA	COMPETÊNCIA	vencimento	VALOR (R\$)
PAGO POR INDENIZAÇÃO			18/11/14	PAGO	out/14		R\$ 155.900,00
PAGO POR INDENIZAÇÃO			12/12/14	PAGO	nov/14		R\$ 155.900,00
PAGO POR INDENIZAÇÃO			30/12/14	PAGO	dez/14		R\$ 155.900,00
PAGO POR INDENIZAÇÃO			10/04/15	PAGO	jan/15		R\$ 160.800,00
PAGO POR INDENIZAÇÃO			10/04/15	PAGO	fev/15		R\$ 160.800,00
TOTAL							R\$ 789.300,00
CONTROLE DE PAGAMENTO DE ALUGUEL - SEAS -							
CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12		06/05/15	PAGO	mar/15	10/04/2015	R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	2/12		16/06/15	PAGO	abr/15	10/05/2015	R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	3/12		16/06/15	PAGO	mai/15	10/06/2015	R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	4/12		10/07/15	PAGO	jun/15	10/07/2015	R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	5/12		10/08/15	PAGO	jul/15	10/08/2015	R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	6/12		10/09/15	PAGO	ago/15	10/09/2015	R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	7/12		09/11/15	PAGO	set/15	10/10/2015	R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	8/12		24/11/15	PAGO	out/15	10/11/2015	R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	9/12		21/01/16	PAGO	nov/15	10/12/2015	R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	10/12		26/03/16	PAGO	dez/15	10/01/2016	R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	11/12		30/05/16	PAGO	jan/16	10/02/2016	R\$ 160.800,00
CONTRATO 002/2015-SEAS	12/12		30/05/16	PAGO	fev/16	10/03/2016	R\$ 160.800,00
TOTAL A RECEBER CT 2/2015							R\$ 1.929.600,00
TOTAL RECEBIDO CT 2/2015							R\$ 1.929.600,00
SALDO CT 2/2015							R\$ -
CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12			9 DIAS	mar/16	1 PARCIAL	R\$ 48.240,00
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12	30147	06/07/17	PAGO 21 DIAS	mar/16	2 PARCIAL	R\$ 124.897,92
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	2/12		31/01/17	PAGO	abr/16	10/05/2016	R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	3/12	9993	14/03/2017	PAGO	mai/16	10/06/2016	R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	4/12		31/01/17	PAGO	jun/16	10/07/2016	R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	5/12			PENDENTE	jul/16	10/08/2016	R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	6/12			PENDENTE	ago/16	10/09/2016	R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	7/12			PENDENTE	set/16	10/10/2016	R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	8/12			PENDENTE	out/16	10/11/2016	R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	9/12			PENDENTE	nov/16	10/12/2016	R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	10/12			PENDENTE	dez/16	10/01/2017	R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	11/12			PENDENTE	jan/17	10/02/2017	R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	12/12			PENDENTE	fev/17	10/03/2017	R\$ 178.425,60
1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	12/12	31093	07/07/17	PAGO	mar/17	1 PARCIAL	R\$ 53.527,68
TOTAL RECEBIDO 1TAC							R\$ 713.702,40
TOTAL A RECEBER 1TAC							R\$ 2.141.107,20

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

SALDO 1 TAC							R\$ 1.427.404,80
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12	36300	11/08/17	PAGO 21 DIAS	mar/17	2 PARCIAL	R\$ 92.186,56
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12			PENDENTE	mar/17	2 PARCIAL	R\$ 1.486,88
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	2/12	23739	05/06/16	PAGO	abr/17	10/05/2017	R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	3/12	30146	06/07/17	PAGO	mai/17	10/06/2017	R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	4/12	40592	01/09/17	PAGO	jun/17	10/07/2017	R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	5/12	40593	01/09/17	PAGO	jul/17	10/08/2017	R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	6/12	53846	14/12/17	PAGO	ago/17	10/09/2017	R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	7/12	54764	18/12/17	PAGO	set/17	10/10/2017	R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	8/12	8369	23/02/18	PAGO	out/17	10/11/2017	R\$ 126.384,80
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	8/12			PENDENTE	out/17	10/11/2017	R\$ 7.434,40
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	9/12	8366	23/02/18	PAGO	nov/17	10/12/2017	R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	10/12	8367	23/02/18	PAGO	dez/17	10/01/2018	R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	11/12	17829	27/03/18	PAGO	jan/18	10/02/2018	R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	12/12	17831	27/03/18	PAGO	fev/18	10/03/2018	R\$ 133.819,20
2 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	12/12	31155	10/05/18	PAGO 9 dias	mar/18	10/04/2018	R\$ 40.145,76
TOTAL RECEBIDO 2TAC							R\$ 1.596.909,12
TOTAL A RECEBER 2TAC							R\$ 1.605.830,40
SALDO							R\$ 8.921,28
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	1/12			pendente 21 dias	mar/18	10/04/2018	R\$ 93.673,44
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	2/12	71036	12/09/18	PAGO	abr/18	10/05/2018	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	3/12	71037	12/09/18	PAGO	mai/18	10/06/2018	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	4/12	71038	12/09/18	PAGO	jun/18	10/07/2018	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	5/12	75324	26/09/18	PAGO	jul/18	10/08/2018	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	6/12	75323	26/09/18	PAGO	ago/18	10/09/2018	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	7/12	94277	05/12/18	PAGO	set/18	10/10/2018	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	8/12	94278	05/12/18	PAGO	out/18	10/11/2018	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	9/12	2060	18/12/18	PAGO	nov/18	10/12/2018	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	10/12	7114	26/12/18	PAGO	dez/18	10/01/2019	R\$ 133.819,20
3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS	11/12				jan/19	10/02/2019	R\$ 133.819,20

*Nota: o valor da dívida principal, até 31/01/19, está no valor de 1.712.058,72

* Nota: 1 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS - valor mensal de R\$ 178.425,60.

** Nota: 2TAC CONTRATO 002/2015-SEAS - valor mensal de R\$ 133.819,20.

*** Nota: 3 TAC CONTRATO 002/2015-SEAS - valor mensal de R\$ 133.819,20.

Quadro 12

Fonte: GERAF/COMAP.

IMÓVEIS DO COMPLEXO IPIXUNA E DUQUE DE CAXIAS. Encaminhado memorando nº 180/2016 à DIRAF dando conhecimento sobre as licitações dos imóveis declaradas desertas. Encaminhado memorando nº 345/2016 com histórico da locação dos imóveis. Deliberação da Diretoria, do dia 31/08/2016, que a GEJUR analise a possibilidade de contratação de corretor de imóveis, através de procedimento licitatório, para locação dos imóveis. Em resposta através de parecer no processo 2014.A.04879, a GEJUR opina pela possibilidade de contratação de corretor de imóveis, com a ressalva que o percentual referente pagamento dos honorários seja pago diretamente pelo locatário. Em elaboração de Projeto Básico para encaminhar para Licitação. Em abril, o corretor de imóvel, mandou as propostas com os ajustes, em elaboração processo licitatório. Em razão da irregularidade fiscal da empresa Corretora de imóveis, será realizada nova pesquisa de mercado para proposta de serviços. Aguardando proposta de empresa Corretora de Imóveis. Em elaboração pela COMAP de projeto básico. Recebido documentação e certidões de regularidade fiscal da empresa corretora de imóveis para compor o processo. Solicitado ajustes de proposta e regularização de certidões fiscais. Projeto básico em ajustes pela GERAF e COMAP em razão da necessidade de outras propostas. Aguardando novas propostas para prestação dos serviços. Não recebido propostas para prestação dos serviços neste mês. Dificuldades para recebimento de propostas. Reiterado pedido de propostas, caso negativo,

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

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: GERA/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: GERA/COMAP.**

IMÓVEIS EM LITÍGIO

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

Quadro 13

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

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

2.13 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	31/12/2018	31/01/2019
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.371.775.106,87	R\$ 3.459.431.034,91
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 604.457.029,06	R\$ 609.652.048,11
TÍTULOS CVS	R\$ 13.930.828,88	R\$ 13.785.744,16
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00	R\$ 62.060.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 4.052.222.964,81	R\$ 4.144.928.828,18

Quadro 14

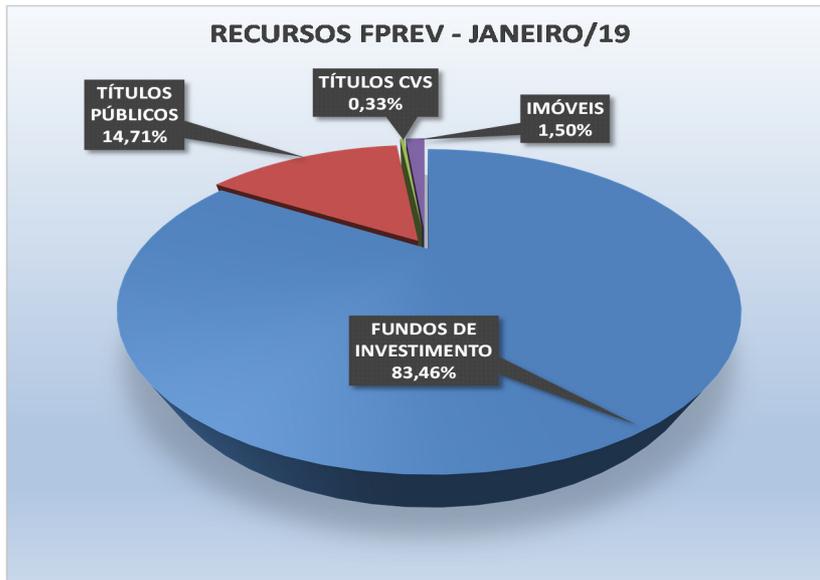


Gráfico 4

2.14 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%
set/18	R\$ 3.796.010.936,86	1,67%	13,33%	18,04%
out/18	R\$ 3.892.701.887,62	2,55%	16,21%	19,68%
nov/18	R\$ 3.938.714.727,46	1,18%	17,59%	19,70%
dez/18	R\$ 4.052.222.964,81	2,88%	20,98%	20,98%
jan/19	R\$ 4.144.928.828,18	2,29%	2,29%	20,76%

Quadro 15

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

2.15 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO

IPCA (Fonte: IBGE)

PERÍODO	TAXA
janeiro/18	0,29%
dezembro/18	0,15%
janeiro/19	0,32%
Acumulado no ano de 2019	0,29%
Acumulado nos últimos 12 meses	3,78%
Meta Atuarial no mês	0,8083%

Quadro 16

DESCRIÇÃO	JANEIRO/19	ACUMULADO 2019	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2005 - 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	1,6926%	1,6926%	8,9102%	431,7497%
META ATUARIAL	0,8083%	0,8083%	10,0031%	384,5042%
RESULTADO ATUARIAL	0,8772%	0,8772%	-0,9935%	9,7513%

Quadro 17

Nota: Rentabilidade validada pelo atuário.

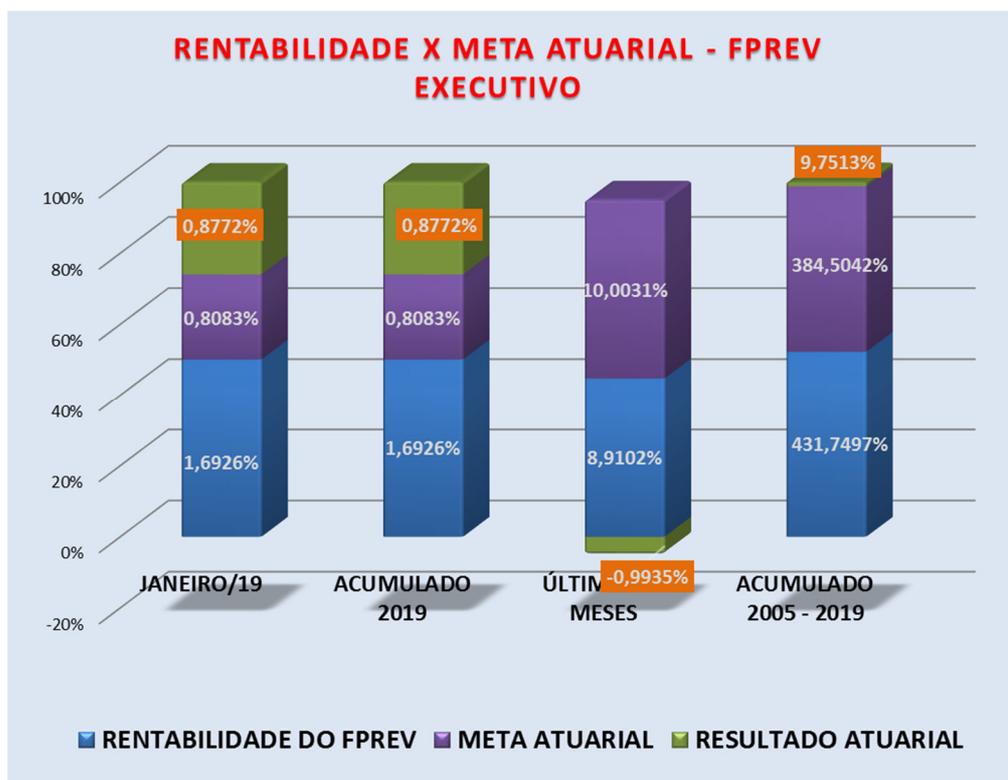


Gráfico 5

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRDESCO FI REF. FEDERAL EXTRA	R\$ 3.375.633,16	R\$ 3.393.437,21	0,4752	0,4822	0,5274	1,4921%	0,5274%	NC	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 2.102.139,37	R\$ 2.283.218,62	0,3748	1,3260	2,8809	4,6358%	2,8809%	NC	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II	R\$ 2.118.806,81	R\$ 2.288.887,46	0,7879	1,5020	2,3732	4,7295%	2,3732%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -							
TOTAL	R\$ 7.596.579,34	R\$ 7.965.543,29							

Quadro 18

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.053.912,26	R\$ 2.071.488,10	0,3229	0,6848	0,8557	1,8743%	0,8557%	6,4482%	
TOTAL GERAL	R\$ 2.053.912,26	R\$ 2.071.488,10							

Quadro 19.

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	nov/18	dez/18	jan/19
SALDO ANTERIOR	9.012.136,46	9.198.813,51	9.650.491,60
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	143.781,95	468.098,91	239.632,65
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	42.895,10	(16.420,82)	146.907,14
SALDO FINAL	9.198.813,51	9.650.491,60	10.037.031,39

Quadro 20

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS FPREV ALE	SALDO	
	31/12/2018	31/01/2019
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 7.596.579,34	R\$ 7.965.543,29
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.053.912,26	R\$ 2.071.488,10
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 9.650.491,60	R\$ 10.037.031,39

Quadro 21

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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%
set/18	R\$ 8.992.274,76	3,91%	18,72%	24,11%
out/18	R\$ 9.012.136,46	0,22%	18,98%	22,63%
nov/18	R\$ 9.198.813,51	2,07%	21,44%	25,17%
dez/18	R\$ 9.650.491,60	4,91%	27,41%	27,41%
jan/19	R\$ 10.037.031,39	4,01%	4,01%	28,94%

Quadro 22

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

DESCRIÇÃO	JANEIRO/19	ACUMULADO 2019	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2012 - 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	1,5223%	1,5223%	7,5959%	128,635060%
META ATUARIAL	0,8083%	0,8083%	10,0031%	123,134397%
RESULTADO ATUARIAL	0,7082%	0,7082%	-2,1883%	2,465180%

Quadro 23

4. RECURSOS DO MPE e DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FI REF DI PREMIUM	R\$ 99.352.766,72	R\$ 99.882.866,83	0,4855	0,4915	0,5336	1,5182%	0,5336%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 99.352.766,72	R\$ 99.882.866,83						

Quadro 24.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

DESCRIÇÃO	JANEIRO/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	0,5335%	0,5335%
META ATUARIAL	0,8083%	0,8083%
RESULTADO ATUARIAL	-0,2726%	-0,2726%

Quadro 25.

Nota: Registra-se que Ministério Público Estadual, representado pela Procuradoria Geral de Justiça do Estado do Amazonas – PGJ/AM, depositou no dia 04/05/2018, o valor de R\$ 95.520.906,30 a título de contribuições passadas, corrigidas pela meta atuarial do período de janeiro/2004 a novembro/17, devidas ao Fundo Previdenciário de seus servidores conforme disposto no Termo de Compromisso de Adesão, celebrado com esta Unidade Gestora de Previdência em 14/11/2017. Considerando que as ações operacionais do processo de adesão ainda estão em curso, não estão sendo repassadas as contribuições mensais nem executadas as despesas previdenciárias, o que poderá alterar o resultado atuarial.

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRABESCO FI REF DI PREMIUM	R\$ 2.441.450,05	R\$ 2.454.326,96	0,1676	0,4915	0,5274	1,1908%	0,5274%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 2.441.450,05	R\$ 2.454.326,96						

Quadro 26

4.4 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

DESCRIÇÃO	JANEIRO/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	0,5274%	0,5274%
META ATUARIAL	0,8083%	0,8086%
RESULTADO ATUARIAL	-0,2786%	-0,2789%

Quadro 27

5. CONSOLIDADO – FPREV

5.1 Evolução dos Recursos Consolidados – FPREV.

ANO	ALE FPREV	EXEC. FPREV	MPE FPREV	DPE FPREV	TOTAL FPREV
2004	R\$ -	R\$ 15.862.618,50	R\$ -		R\$ 15.862.618,50
2005	R\$ -	R\$ 57.510.136,49	R\$ -		R\$ 57.510.136,49
2006	R\$ -	R\$ 83.649.681,60	R\$ -		R\$ 83.649.681,60
2007	R\$ -	R\$ 75.698.485,78	R\$ -		R\$ 75.698.485,78
2008	R\$ -	R\$ 179.805.240,72	R\$ -		R\$ 179.805.240,72
2009	R\$ -	R\$ 341.872.841,56	R\$ -		R\$ 341.872.841,56
2010	R\$ -	R\$ 489.868.867,80	R\$ -		R\$ 489.868.867,80
2011	R\$ -	R\$ 657.928.672,97	R\$ -		R\$ 657.928.672,97
2012	R\$ 436.901,72	R\$ 936.612.579,50	R\$ -		R\$ 937.049.481,22
2013	R\$ 1.239.708,12	R\$ 1.166.915.511,62	R\$ -		R\$ 1.168.155.219,74
2014	R\$ 2.509.280,78	R\$ 1.571.464.403,45	R\$ -		R\$ 1.573.973.684,23
2015	R\$ 3.643.310,21	R\$ 2.012.490.466,39	R\$ -		R\$ 2.016.133.776,60
2016	R\$ 5.660.283,00	R\$ 2.700.997.719,11	R\$ -		R\$ 2.706.658.002,11
2017	R\$ 7.574.592,78	R\$ 3.349.596.826,89	R\$ -		R\$ 3.357.171.419,67
2018	R\$ 9.650.491,60	R\$ 4.052.222.964,81	R\$ 99.352.766,72	R\$ 2.441.450,05	R\$ 4.163.667.673,17
2019	R\$ 10.037.031,39	R\$ 4.144.928.828,18	R\$ 99.882.866,83	R\$ 2.454.326,96	R\$ 4.257.303.053,36

Quadro 28

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

5.2 Resumo da rentabilidade 2019 – FPREV.

Mês	Receitas	Despesas	Saldo	Patrimônio	Ganhos
				4.163.667.673,17	Financeiros
jan/19	25.980.772,80	1.624.312,33	24.356.460,47	4.257.303.053,36	69.278.919,72
fev/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
mar/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
abr/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
mai/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
jun/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
jul/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
ago/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
set/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
out/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
nov/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
dez/19	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Meta				0,81%	69.278.919,72
Rentabilidade				1,66%	
Resultado				0,85%	

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 (%)					
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 10.128.579,28	R\$ 3.626.926,65	0,4720	0,4716	0,5189	1,4696%	0,5189%	6,0905%
BRDESCO FI RF IRF M1 - COMPREV	R\$ 8.204.597,24	R\$ 8.244.264,72	0,5244	0,5386	0,5569	1,0659%	0,5569%	6,7200%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 388,46						
TOTAL	R\$ 18.333.176,52	R\$ 11.871.579,83						

Quadro 30

6.2 Defensoria Pública - FFIN

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FI REF FEDERAL EXTRA	R\$ 460.162,27	R\$ -	0,1676	0,4822	0,4794	1,1330%	0,4794%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 110,49						
TOTAL	R\$ 460.162,27	R\$ 110,49						

Quadro 31

6.3 Disponibilidade Financeira – FFIN EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2018	31/01/2019
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 112.128,83	R\$ 867.137,04
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 17,70	R\$ 17,70
REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ -

Quadro 32

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

Nota: Valor de Cobertura do Déficit referente à IRRF s/ folha de pagamento, já regularizado.

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

6.4 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit - FFIN ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2018	31/01/2019
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.940,70	R\$ 15.064,07
TOTAL	R\$ 1.940,70	R\$ 15.064,07

Quadro33.

6.5 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	nov/18	dez/18	jan/19
SALDO ANTERIOR	R\$ 10.238,02	R\$ 46.323,43	R\$ 1.940,70
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 1.199.306,07	R\$ 3.144.133,02	R\$ 3.684.769,54
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.291.396,51	R\$ 1.758.739,48	R\$ 1.704.970,41
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$ 2.454.617,17	-R\$ 4.947.255,23	-R\$ 5.376.616,58
SALDO FINAL	R\$ 46.323,43	R\$ 1.940,70	R\$ 15.064,07

Quadro 34

7. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

7.1 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.219.598,90	R\$ 2.331.260,18	0,4720	0,4680	0,5189	1,4660%	0,5189%	6,0905%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 38.111.524,87	R\$ 40.314.113,04	0,5283	0,5423	0,5679	1,6475%	0,5679%	6,8032%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.674.898,66	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 41.006.022,43	R\$ 42.645.374,22						

Quadro 35

7.2 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 394.365,58	R\$ 396.445,58	0,4792	0,4680	0,5274	1,4818%	0,5274%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 394.365,58	R\$ 396.445,58						

Quadro 36

8. RECURSOS DOS OUTROS PODERES – TJA E TCE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO IRF MI - TJA	R\$ 110.282.134,69	R\$ 110.896.243,57	0,5244	0,5386	0,5569	1,6287%	0,5569%	6,7000%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 140.099.175,84	R\$ 142.521.995,13	0,5283	0,5423	0,5679	1,6475%	0,5679%	6,8032%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 134.976.674,83	R\$ 137.380.410,80	0,5204	0,5360	0,5753	1,6406%	0,5753%	6,7458%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 688,79	R\$ -						
TOTAL	R\$ 385.358.674,15	R\$ 390.798.649,50						

Quadro 37

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

8.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	nov/18	dez/18	jan/19
SALDO ANTERIOR	372.779.305,77	377.577.116,61	385.358.674,15
REPASSES FINANCEIROS	2.980.818,91	5.972.687,39	3.400.607,98
VARIAÇÃO FINANCEIRA	1.950.296,79	2.042.370,93	2.187.782,77
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(133.304,86)	(233.500,78)	(148.415,40)
SALDO FINAL	R\$ 377.577.116,61	R\$ 385.358.674,15	R\$ 390.798.649,50

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.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/12/2018	31/01/2019	nov/18	dez/18	jan/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRABESCO IRF MI - TCE	R\$ 46.310.560,92	R\$ 46.422.266,20	0,5244	0,5386	0,5569	1,6287%	0,5569%	6,7000%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 56.160.394,59	R\$ 56.479.332,67	0,5283	0,5423	0,5679	1,6475%	0,5679%	6,8032%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 54.572.190,67	R\$ 54.886.159,51	0,5204	0,5360	0,5753	1,6406%	0,5753%	6,7458%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 919.136,42						
TOTAL	R\$ 157.043.146,18	R\$ 158.706.894,80						

Quadro 39

8.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	nov/18	dez/18	jan/19
SALDO ANTERIOR	152.685.324,61	154.682.645,64	157.043.146,18
REPASSES FINANCEIROS	1.334.684,35	1.759.444,56	902.592,16
VARIAÇÃO FINANCEIRA	800.673,19	835.938,71	890.692,90
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(138.036,51)	(234.882,73)	(129.536,44)
SALDO FINAL	R\$ 154.682.645,64	R\$ 157.043.146,18	R\$ 158.706.894,80

Quadro 40

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 janeiro de 2019

9. ENQUADRAMENTO

9.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2019	LIMITE DA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
TÍTULOS DO TN	R\$ 611.723.536,21	12,75%	11,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 580.020.060,84				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.212.239,36				
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 9.001.759,34				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 110.161.303,51				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 533.347.173,94				
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 163.956.008,06	55,61%	50,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 165.562.774,49				
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 273.697.712,73				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 647.930.638,74				
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 73.233.223,43				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.062.854,44				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 48.318.355,17				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.015.668,43				
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 6.244.209,75				
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 694.474.890,00				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.014.475,59	27,38%	40%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II	R\$ 231.043.441,63				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 237.534.890,04				
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 78.356.130,23				
TÍTULOS CVS	R\$ 13.785.744,16	0,29%	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	-	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.607.697.090,09	96,02%			

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2019	LIMITE DA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 44.985.421,91	0,94%	5%	30%	art. 8º, inciso I, "a"
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.902.087,76				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.634.843,15				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 37.197.062,14	2,40%	8%	20%	art. 8º, inciso II, "a"
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 35.811.160,13				
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 35.433.478,32				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 4.838.695,77				
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.411.979,69	0,65%	3%	10%	art. 8º, inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.212.223,75				
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.618.427,70				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 191.045.380,32	3,98%			

TOTAL GERAL DA CARTEIRA	R\$ 4.798.742.470,41	100,00%
--------------------------------	-----------------------------	----------------

Quadro 41

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Res. nº . 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 580.020.060,84	12,09%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.212.239,36	0,40%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 9.001.759,34	0,19%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 110.161.303,51	2,30%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 533.347.173,94	11,11%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 163.956.008,06	3,42%	
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 165.562.774,49	3,45%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 273.697.712,73	5,70%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 647.930.638,74	13,50%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 73.233.223,43	1,53%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.062.854,44	0,92%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 48.318.355,17	1,01%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.015.668,43	0,13%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 6.244.209,75	0,13%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 694.474.890,00	14,47%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.014.475,59	1,25%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II	R\$ 231.043.441,63	4,81%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 237.534.890,04	4,95%	
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 78.356.130,23	1,63%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 44.985.421,91	0,94%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.902.087,76	0,08%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.634.843,15	0,05%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 37.197.062,14	0,78%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 35.811.160,13	0,75%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 35.433.478,32	0,74%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 4.838.695,77	0,10%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.411.979,69	0,11%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.212.223,75	0,11%	
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.618.427,70	0,33%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 4.173.233.190,04		

TOTAL DOS RECURSOS DO RPPS	R\$ 4.798.742.470,41
-----------------------------------	-----------------------------

Quadro 42

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

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. n.º 3.922/2010 atualizada pela Res. n.º 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 580.020.060,84	11.421.020.245,51	5,08%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 19.212.239,36	669.215.885,08	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX - 15/08/2018	R\$ 9.001.759,34	120.925.471,48	7,44%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 110.161.303,51	1.326.189.160,15	8,31%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 533.347.173,94	6.832.498.254,71	7,81%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 163.956.008,06	1.308.500.779,85	12,53%	
BRADERCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 165.562.774,49	1.541.434.392,74	10,74%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 273.697.712,73	17.170.876.640,61	1,59%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 647.930.638,74	8.675.733.038,54	7,47%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 73.233.223,43	1.916.389.005,79	3,82%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 44.062.854,44	257.987.771,75	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 48.318.355,17	197.186.227,07	24,50%	
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.015.668,43	327.456.683,68	1,84%	
BRADERCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 6.244.209,75	7.049.972.096,34	0,09%	
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 694.474.890,00	7.564.975.012,87	9,18%	
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.014.475,59	562.385.050,46	10,67%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA II	R\$ 231.043.441,63	2.728.209.369,22	8,47%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 237.534.890,04	3.607.219.056,01	6,58%	
SANTANDER FIC INST. REF DI	R\$ 78.356.130,23	4.465.650.824,34	1,75%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 44.985.421,91	869.865.682,06	5,17%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.902.087,76	56.282.351,98	6,93%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.634.843,15	1.449.444.222,48	0,18%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 37.197.062,14	394.325.958,29	9,43%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 35.811.160,13	984.007.350,40	3,64%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 35.433.478,32	656.052.037,56	5,40%	
TOTAL	R\$ 4.142.151.863,13			

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. n.º 3.922/2010 atualizada pela Res. n.º 4.604/2017
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.618.427,70	519.088.538,99	3,01%	5%
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.411.979,69	269.590.267,28	2,01%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 4.838.695,77	370.542.198,34	1,31%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.212.223,75	2.029.838.171,14	0,26%	
TOTAL	R\$ 31.081.326,91			

Quadro 43

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

Nota 2: Art. 14 § 1º O limite de que trata o caput será de até 5% (cinco por cento) do patrimônio líquido dos fundos de investimento de que tratam os incisos VII do art. 7º, III e IV do art. 8º (ver Enquadramento 1);

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

Nota 4: Art. 21. § 1º As aplicações que apresentem prazos para vencimento, resgate, carência ou para conversão de cotas de fundos de investimento previstas em seu regulamento então vigente poderão ser mantidas em carteira até a respectiva data, caso superior ao prazo previsto no caput. Assim, considera-se que os fundos Caixa FI Brasil 2020

Relatório de Investimentos janeiro de 2019

V TP RF e Caixa FI Brasil 2024 VI TP RF encontram-se enquadrados, pois o resgate dessas aplicações ocorrerá no vencimento dos TPF que compõe a carteira dos fundos, ou seja, 16/08/2020 e 16/08/2024, respectivamente.

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA DEZ/18) EM R\$ BI	TOTAL DE RECURSOS - ANBIMA	TOTAL RECURSOS - AMAZONPREV	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Res. nº. 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB DTVM S.A	R\$ 927.357,20	R\$ 927.357.200.000,00	R\$ 1.251.742.536,99	0,1350%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 679.507,33	R\$ 679.507.330.000,00	R\$ 278.663.706,69	0,0410%	
BRDESCO	R\$ 606.845,27	R\$ 606.845.270.000,00	R\$ 932.312.018,26	0,1536%	
CAIXA	R\$ 334.368,52	R\$ 334.368.520.000,00	R\$ 1.276.476.946,27	0,3818%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	R\$ 249.927,62	R\$ 249.927.620.000,00	R\$ 277.745.616,61	0,1111%	
BANCO BTG	R\$ 96.681,10	R\$ 96.681.100.000,00	R\$ 10.050.919,52	0,0104%	
BANCO SAFRA	R\$ 96.352,21	R\$ 96.352.210.000,00	R\$ 35.811.160,13	0,0372%	
ICATÚ	R\$ 19.300,53	R\$ 19.300.530.000,00	R\$ 37.197.062,14	0,1927%	

Quadro 44

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 janeiro de 2019

10. TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.459.431.034,91
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 609.652.048,11
CVS	R\$ 13.785.744,16
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00
DEFENSORIA PÚBLICA - FPREV	R\$ 2.454.326,96
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 4.147.383.155,14

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA - ALE FPREV E ALE FFIN

DESCRIÇÃO	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 7.965.543,29
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.071.488,10
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ -
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 15.064,07
TOTAL	R\$ 10.052.095,46

MPE FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 99.882.866,83
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
TOTAL	R\$ 99.882.866,83

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

DESCRIÇÃO	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	R\$ 42.645.373,22
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$ 396.445,58
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 3.626.926,65
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 8.244.264,72
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA DPE - FFIN	R\$ 110,49
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM.	R\$ 32.820,75
DISP. FINANCEIRA - FFIN	R\$ 388,46
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ 17,70
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 867.137,04
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -
TOTAL	R\$ 55.813.484,61

OUTROS PODERES

ORGÃOS	SALDO
TJ/AM	R\$ 390.798.649,50
TCE/AM	R\$ 157.787.758,38
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJ/TCE	R\$ 919.136,42
TOTAL	R\$ 549.505.544,30
TOTAL GERAL	4.862.637.146,34

Quadro 45

Relatório de Investimentos janeiro de 2019



Gráfico 6.

Nota: Conforme PPA 2019-202 o valor projetado para 2019, equivale ao total de R\$ 5.274.918,303.

Sem mais a informar, segue para Superior Consideração.

Respeitosamente,

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Leonardo Cavalcanti
Membro

Renízio Ferreira
Membro

Marcos Souza
Membro-ALE

Bruno Barroso
Membro-ALE