

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 14/12/2018

RELATÓRIO Nº. 37/2018 – COMIV

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 05);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e performance dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos e Recursos Consolidados do FPREV (páginas 06 a 17);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário FPREV/ALEAM (páginas 17 a 18);
- 4) Recursos do Ministério Público - FPREV - (páginas 19)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (páginas 20);
- 6) Recursos do FFIN Executivo – (página 21);
- 7) Recursos da Taxa de Administração - (página 22);
- 7) Recursos dos Outros Poderes: Saldo e Composição – TCE e TJA (página 22 a 23);
- 8) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 24 a 27);
- 9) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 28 a 30).

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

No Brasil, expansão do PIB no 3º trimestre e dados de atividade mostram recuperação gradual da economia. No cenário global, FED manteve a taxa de juros, e sinalizou aperto monetário gradual.

No Brasil, os dados de atividade confirmam a recuperação moderada da economia. No 3º trimestre, o PIB teve expansão de 0,8% em relação ao 2º trimestre. Resultado ficou em linha com a expectativa do mercado (0,8%) e ligeiramente acima da projeção (0,7%). O resultado do 3º trimestre reflete em parte a normalização da economia após a greve dos caminhoneiros. Apesar de ter crescido 3,1% em termos anualizados, não se considera que a economia esteja crescendo nesse ritmo, mas sim em uma velocidade atual de expansão próxima da média do resultado do 2º e 3º trimestre, que é 0,5% na margem e 2,0% em termos anualizados. Considerando dados de emprego de outubro, houve um menor ritmo na criação de vagas formais, segundo dados do CAGED. No mês, houve uma abertura líquida de 57,7 mil vagas, abaixo de expectativa (75 mil) e do mercado (65 mil). Por sua vez, a média móvel de três meses com ajuste sazonal subiu de 40,7 mil para 53,2 mil vagas entre setembro e outubro. Já a taxa de desemprego recuou 0,2% passagem de setembro e outubro, e atingiu 11,7% no mês. Diante desse cenário, os dados de mercado de trabalho e outros indicadores de atividade devem continuar apresentando melhora gradual, compatível com o cenário de crescimento mais moderado do PIB do 4º trimestre. A projeção para crescimento de 2018 é de 1,3%. Para 2019, espera-se uma aceleração do crescimento para 2,6%.

A ata do Copom reforçou o cenário de manutenção da taxa Selic em 6,5% a.a. nos próximos meses. Na mesma direção dos seus comunicados mais recentes, a última ata da reunião do Copom, no final de outubro, reiterou que a manutenção da taxa de juros é compatível com a convergência da inflação para a trajetória das metas. Dados recentes apontam um quadro de inflação benigno, o IPCA de outubro e o IPCA-15 de novembro vieram abaixo das expectativas de mercado: altas de 0,45% e 0,19%, ante projeções de 0,57% e 0,24%, respectivamente. Em 12 meses, enquanto o IPCA-15 acumula alta de 4,39%, a média dos núcleos (excluem itens voláteis) se situa em 2,48%. Segundo o Copom, as próximas decisões de política monetária estão condicionadas à evolução das projeções e expectativas de inflação, balanço de riscos e da atividade econômica. Acredita-se que o Copom mantenha a taxa de juros em 6,5% a.a. na última reunião de 2018, e que o IPCA encerre esse ano com variação de 3,7%, abaixo do centro da meta

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

do Banco Central (4,5%). Para 2019, projeta-se elevação da taxa de juros no segundo semestre, atingindo 7,75% a.a. ao final do ano. Avalia-se, também, que o IPCA de 2019 deverá encerrar o ano em 3,9%, também abaixo do centro da meta do Banco Central para o ano, de 4,25%.

Nos EUA, Fed manteve a taxa de juros em novembro, sinalizando que aperto monetário prosseguirá de modo gradual. Em novembro, a autoridade monetária norte-americana manteve os juros no intervalo entre 2,0 % a.a e 2,25% a.a, conforme esperado. Além disso, Jerome Powell (presidente do Fed) afirmou que as taxas de juros nos Estados Unidos estão perto do nível neutro (sem afetar o crescimento). No que concerne os próximos passos da política monetária, o Fed reforçou que o ajuste da taxa de juros prosseguirá de modo gradual. Tendo vista o crescimento robusto, taxa de desemprego em níveis historicamente baixos, e a expansão fiscal, mantido o cenário de mais uma alta de juros na reunião de dezembro, levando a taxa de juros para o intervalo entre 2,25% a.a e 2,5% a.a em dezembro. Para 2019, mantida a avaliação de que o Fed implementará quatro altas de juros.

Na Zona do Euro, houve fraco crescimento do PIB no 3º trimestre, e desaceleração da inflação em novembro. O PIB do terceiro trimestre teve expansão de 0,2%, abaixo das projeções do mercado e do trimestre anterior, ambos em 0,4%. Em termos anuais, o crescimento foi de 1,7%, também abaixo das expectativas (1,8%) e do segundo trimestre (2,1%). O índice de preços ao consumidor (CPI), apresentou aumento de 2,0% em novembro, contra 2,2% registrado em outubro, em termos anuais. Tal avanço permaneceu em valores próximos da meta do Banco Central Europeu (BCE), de 2,0% a.a. Diante das surpresas negativas com atividade e inflação acomodada, acredita-se que Draghi deixará o comando do BCE em outubro de 2019 sem elevação dos juros. Em termos de atividade, a confiança (PMI) cedeu de 53,1 para 52,4 pontos, mas ainda indicando expansão da indústria. Após iniciar o ano com expectativa de PIB crescendo acima de 2,5%, a Zona do Euro deverá encerrar 2018 com um crescimento abaixo de 2,0%.

Na China, os dados de atividade apresentaram um quadro misto em outubro. No mês, a produção industrial expandiu 5,9% em termos anuais, acima da expectativa do mercado (5,8%). O investimento em ativo fixo (FAI) também surpreendeu positivamente, acelerou entre setembro e outubro, saindo de 5,4% para 5,7%, acima da expectativa (5,5%). As vendas no varejo, por sua vez, cresceram 8,6% em termos nominais, abaixo da expectativa do mercado e do crescimento de setembro (ambas em 9,2%). O desempenho pior das vendas em outubro contou com uma nova contração das vendas de automóveis (-6,4%). Os indicadores de confiança (PMI) decepcionaram

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

em novembro, não revelando efeito das medidas de estímulo. Entre outubro e novembro, o PMI do setor industrial da China recuou de 50,2 para 50,0 pontos. O PMI de serviços da China recuou de 53,9 em outubro para 53,4 pontos em novembro, sugerindo expansão mais fraca do segmento. Vale ressaltar que o indicador acima de 50 pontos indica expansão do setor. Assim, após o crescimento acumulado de 6,8% em termos anuais no primeiro semestre, espera-se que o PIB desacelere para um crescimento de 6,5% ao final desse ano. Para 2019, o PIB chinês deverá desacelerar para um patamar mais próximo de 6%. Fonte: SÍNTESE ECONÔMICA DE NOVEMBRO – BRAM.

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

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 %						
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 580.869.567,64	R\$ 588.579.061,61	0,4630	0,5365	0,4855	1,4924%	5,8109%	6,3800%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 17.666.827,82	R\$ -	0,4553	0,5293	0,0957	1,0837%	5,3076%	6,3500%	
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.200.212,09	R\$ 58.286.821,89	0,8576	3,1697	0,1488	4,2093%	4,6288%	NC	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ -	R\$ 1.602.459,74	-	-	0,4699	0,4699%	0,4699%	NC	
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 66.335.610,08	R\$ 18.901.433,97	0,5887	0,9351	0,5283	2,0657%	3,3049%	NC	
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	R\$ 43.158.967,78	R\$ 43.203.371,11	1,2179	1,7092	0,1000	3,0508%	7,8000%	8,9300%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 46.287.656,81	R\$ 46.341.721,60	(0,2728)	6,1488	0,1166	5,9826%	9,5000%	10,1500%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 224.828.971,15	R\$ 225.671.713,38	0,6563	1,6936	0,3748	2,7447%	4,7472%	NC	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 628.624.750,01	R\$ 629.471.900,06	0,8568	3,0973	0,1348	4,1208%	9,0037%	NC	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ -	R\$ 67.529.949,36	-	-	1,6801	1,6801%	1,6801%	NC	
SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI	R\$ 77.157.481,75	R\$ 77.538.130,95	0,4653	0,5405	0,4933	1,5066%	5,8716%	NC	
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 159.154.090,45	R\$ 159.356.181,51	0,8668	3,1013	0,1270	4,1270%	6,2375%	NC	
BB PREVID RF IRF MI	R\$ 476.321.296,72	R\$ 368.381.561,51	0,5902	0,9348	0,5204	2,0588%	6,1871%	6,7804%	
BB PREVID TP VII	R\$ 18.708.943,52	R\$ 18.740.222,40	1,0910	2,4861	0,1671	3,7774%	8,5346%	9,3464%	
BB PREVID TP IX	R\$ 8.871.536,09	R\$ 8.913.371,21	0,4508	0,5205	0,4715	1,4498%	6,9388%	7,3147%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 501.175.351,88	R\$ 520.578.266,62	1,1712	2,0897	0,1085	3,3974%	5,6434%	NC	
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ -	R\$ 101.490.932,87	-	-	1,5822	1,5822%	1,5822%	NC	
ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	R\$ 10.279.552,40	R\$ -	0,4579	0,5320	-	1,5565%	5,2499%	6,5200%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 208.226.413,29	R\$ 220.145.046,34	0,4172	0,5088	0,7500	1,6851%	6,6220%	7,4800%	
TOTAL	R\$ 3.125.867.229,48	R\$ 3.154.732.146,13							

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO %						
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.305.784,85	R\$ 5.337.766,56	0,9225	1,8299	0,6028	3,3888%	6,7554%	NC	
CAIXA FI JUROS E MOEDAS	R\$ 15.411.614,50	R\$ 15.472.029,02	0,5446	0,5573	0,3920	1,5012%	3,1489%	NC	
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 3.369.169,09	R\$ 3.480.510,19	0,0207	4,7515	3,3047	8,2356%	-3,8115%	NC	
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 31.739.445,33	R\$ 32.431.689,02	3,9749	11,4350	2,1810	18,3914%	11,5341%	NC	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 17.664.507,66	R\$ 18.205.184,07	1,7891	11,9700	3,0600	17,4608%	4,2748%	NC	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.281.009,66	R\$ 2.347.038,16	(1,2821)	14,2327	2,8900	16,0271%	15,1967%	NC	
SAFRA S&P REAIS	R\$ 4.813.423,96	R\$ 4.900.102,52	0,4749	(6,6459)	1,8008	-4,5134%	-2,7241%	NC	
SAFRA PREMIUM MULTMERCADO	R\$ 5.113.554,71	R\$ 5.148.743,68	0,6134	0,8912	0,6882	2,2086%	2,2119%	NC	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ -	R\$ 10.219.536,06	-	-	2,1954	2,1954%	2,1954%	NC	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ -	R\$ 9.957.601,79	-	-	(0,4240)	-0,4240%	-0,4240%	NC	
TOTAL	R\$ 85.698.509,76	R\$ 107.500.201,07							
TOTAL GERAL	R\$ 3.211.565.739,24	R\$ 3.262.232.347,20							

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.

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

2.2 EVOLUÇÃO DOS SALDOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	set/18	out/18	nov/18
BRADERCO	R\$ 653.221.662,56	R\$ 656.736.607,55	R\$ 648.468.343,24
CAIXA	R\$ 989.340.043,24	R\$ 1.033.322.524,27	R\$ 1.055.410.395,25
BANCO DO BRASIL	R\$ 973.088.753,90	R\$ 1.005.077.128,21	R\$ 1.018.104.354,61
ITAÚ	R\$ 235.170.888,53	R\$ 238.451.483,01	R\$ 240.697.268,57
SANTANDER	R\$ 259.592.218,50	R\$ 268.051.017,53	R\$ 269.326.001,48
SAFRA	R\$ 10.224.478,26	R\$ 9.926.978,67	R\$ 10.048.846,20
ICATÚ	R\$ -	R\$ -	R\$ 10.219.536,06
BTG	R\$ -	R\$ -	R\$ 9.957.601,79
TOTAL	R\$ 3.120.638.044,99	R\$ 3.211.565.739,24	R\$ 3.262.232.347,20

Quadro 2

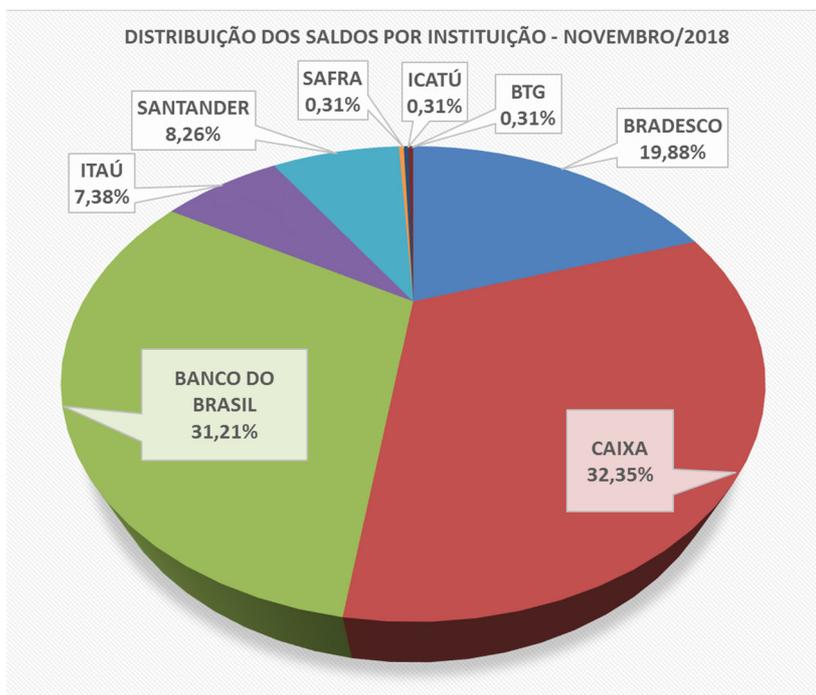


Gráfico 1

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRADESCO FI REFER DI PREMIUM BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA BRADESCO FI MAXI PODER PUBLICO SANTANDER FIC FI INST. RF REF DI ITAÚ INST. REFERENCIADO DI FI	CDI	R\$ 667.719.652,30	20,47%
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIM LP SAFRA CART PREMIUM MM	CDI ATIVO	R\$ 466.437.532,42	14,30%
CAIXA FI BRASIL IRF M1 TP RF BB PREVID RF IRF M1	IRF M 1	R\$ 387.282.995,48	11,87%
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\$ 847.114.903,46	25,97%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 520.578.266,62	15,96%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP BB PREVID RF IMA B5+	IMA B 5+	R\$ 169.020.882,23	5,18%
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\$ 117.198.686,32	3,59%
SAFRA S&P REAIS	S&P 500	R\$ 4.900.102,52	0,15%
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\$ 81.979.325,85	2,51%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 3.262.232.347,20	100%

Quadro 3

DISTRIBUIÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA - AMAZONPREV

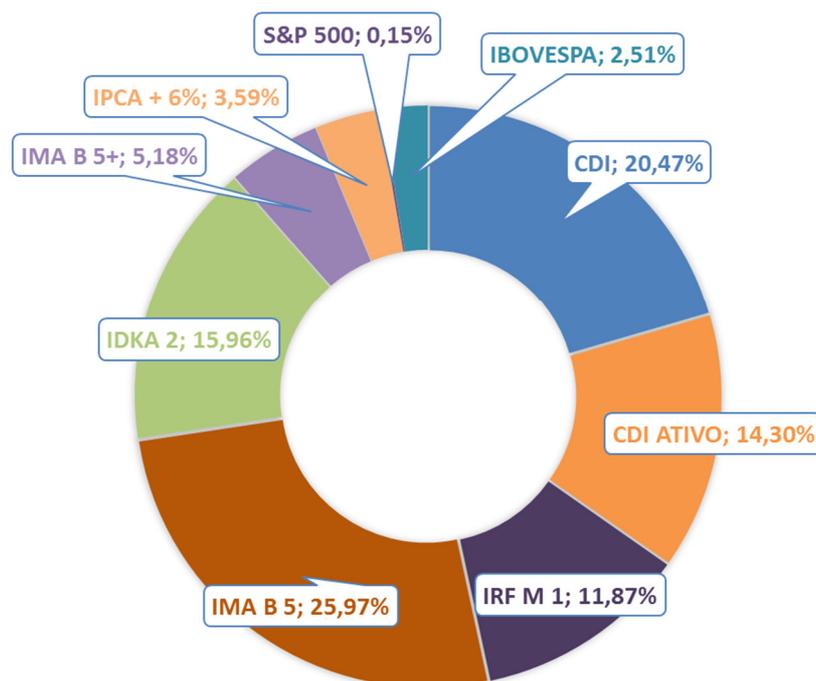


Gráfico 2

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

2.4 COMPARATIVO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA

ÍNDICE	nov/18	ACUMULADO 2018	12 MESES
CDI	0,4900%	5,9000%	6,4700%
IMA-B 5	0,1428%	8,3891%	9,3459%
IMA-B	0,9044%	11,2242%	12,1453%
IMA B 5+	1,5230%	13,2773%	14,1674%
IRF M 1	0,5437%	6,3814%	6,9830%
IDKA 2	0,1739%	8,3950%	9,6541%
IBOVESPA	2,3800%	17,1500%	24,3600%

Quadro 4

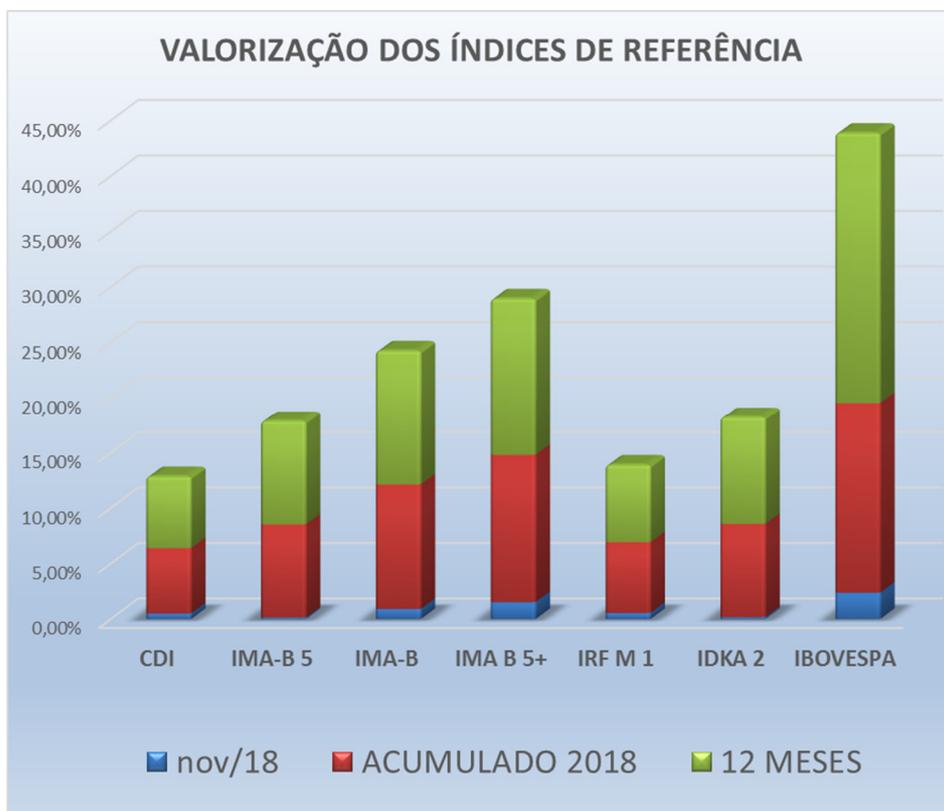


Gráfico 3.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 147.595.522,44	R\$ 148.058.226,23	1,0071	0,9770	0,3135	2,3137%	12,0437%	13,1550%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 148.988.563,11	R\$ 149.469.639,42	1,0166	0,9864	0,3229	2,3424%	9,5597%	10,4266%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 151.570.622,47	R\$ 152.095.675,33	1,0403	1,0101	0,3464	2,4144%	9,8439%	10,7130%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 154.229.557,54	R\$ 154.727.580,93	1,0166	0,9864	0,3229	2,3425%	9,7499%	10,7796%
TOTAL GERAL	R\$ 602.384.265,56	R\$ 604.351.121,91						

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 Novembro 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\$ 3.391,357978	R\$ 3.395,472186	R\$ 3.401,603505	R\$ 3.443,586107
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\$ 147.595.522,44	R\$ 148.988.563,11	R\$ 151.570.622,47	R\$ 154.229.557,53
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	
	31/10/2018	30/11/2018
CVS - A	R\$ 1.711.239,10	R\$ 1.693.785,78
CVS - B	R\$ 11.073.425,30	R\$ 10.960.447,50
CVS - C	R\$ 221.985,40	R\$ 219.721,32
CVS - D	R\$ 1.214.348,52	R\$ 1.201.959,00
TOTAL	R\$ 14.220.998,32	R\$ 14.075.913,60

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
set/18	R\$ 42.006,30	R\$ 145.084,72	R\$ 187.091,02
out/18	R\$ 41.586,33	R\$ 145.084,72	R\$ 186.671,05
nov/18	R\$ 41.166,36	R\$ 145.084,72	R\$ 186.251,08
TOTAL	R\$ 475.928,10	R\$ 1.595.805,03	R\$ 2.071.733,13

Quadro 8

Relatório de Investimentos Novembro 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\$ 669.096,00	R\$ 669.096,00
out/18	R\$ -	R\$ -	R\$ -
nov/18	R\$ -	R\$ 267.638,40	R\$ 267.638,40
TOTAL	R\$ 160.268,49	R\$ 1.638.541,76	R\$ 1.798.810,25

Quadro 9

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

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

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

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\$ 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 Novembro de 2018

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
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				set/18	10/10/2018	R\$ 133.819,20

1.710.571,84

Quadro 12

*Nota: o valor da dívida principal, até 30/09/18, está no valor de

* 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.

Fonte: GERAFC/COMAP.

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

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

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

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

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.**

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.

2.14 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	31/10/2018	30/11/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.211.565.739,24	R\$ 3.262.232.347,20
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 602.384.265,56	R\$ 604.351.121,91
TÍTULOS CVS	R\$ 14.220.998,32	R\$ 14.075.913,60
IMÓVEIS	R\$ 64.528.000,00	R\$ 62.060.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 2.884,50	R\$ 22.884,89
TOTAL	R\$ 3.892.701.887,62	R\$ 3.942.742.267,60

Quadro 14

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

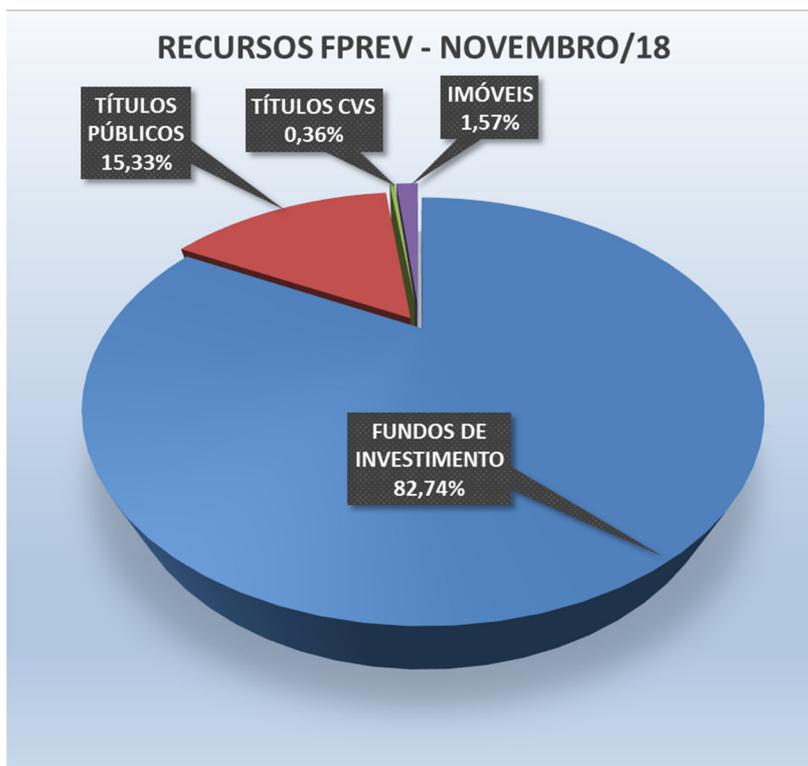


Gráfico 4

2.15 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
dez/17	R\$ 3.349.596.826,89	1,80%	24,01%	24,01%
jan/18	R\$ 3.432.495.345,53	2,47%	2,47%	24,58%
fev/18	R\$ 3.476.496.589,48	1,28%	3,79%	22,11%
mar/18	R\$ 3.535.665.708,63	1,70%	5,55%	21,86%
abr/18	R\$ 3.575.920.197,63	1,14%	6,76%	22,04%
mai/18	R\$ 3.561.828.017,47	-0,39%	6,34%	20,65%
jun/18	R\$ 3.598.964.002,84	1,04%	7,44%	20,22%
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\$ 3.942.742.267,60	1,29%	17,71%	17,71%

Quadro 15

2.16 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO

PERÍODO	TAXA
novembro/17	0,28%
outubro/18	0,45%
novembro/18	-0,21%
Acumulado no ano de 2018	3,59%
Acumulado nos últimos 12 meses	4,05%
Meta Atuarial no mês	0,2757%

Quadro 16

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

DESCRIÇÃO	NOVEMBRO/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2005 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,4564%	7,3494%	7,9849%	418,0163%
META ATUARIAL	0,2757%	9,2736%	10,2887%	377,5748%
RESULTADO ATUARIAL	0,1802%	-1,7609%	-2,0888%	8,4681%

Quadro 17

Nota: Rentabilidade validada pelo atuário.

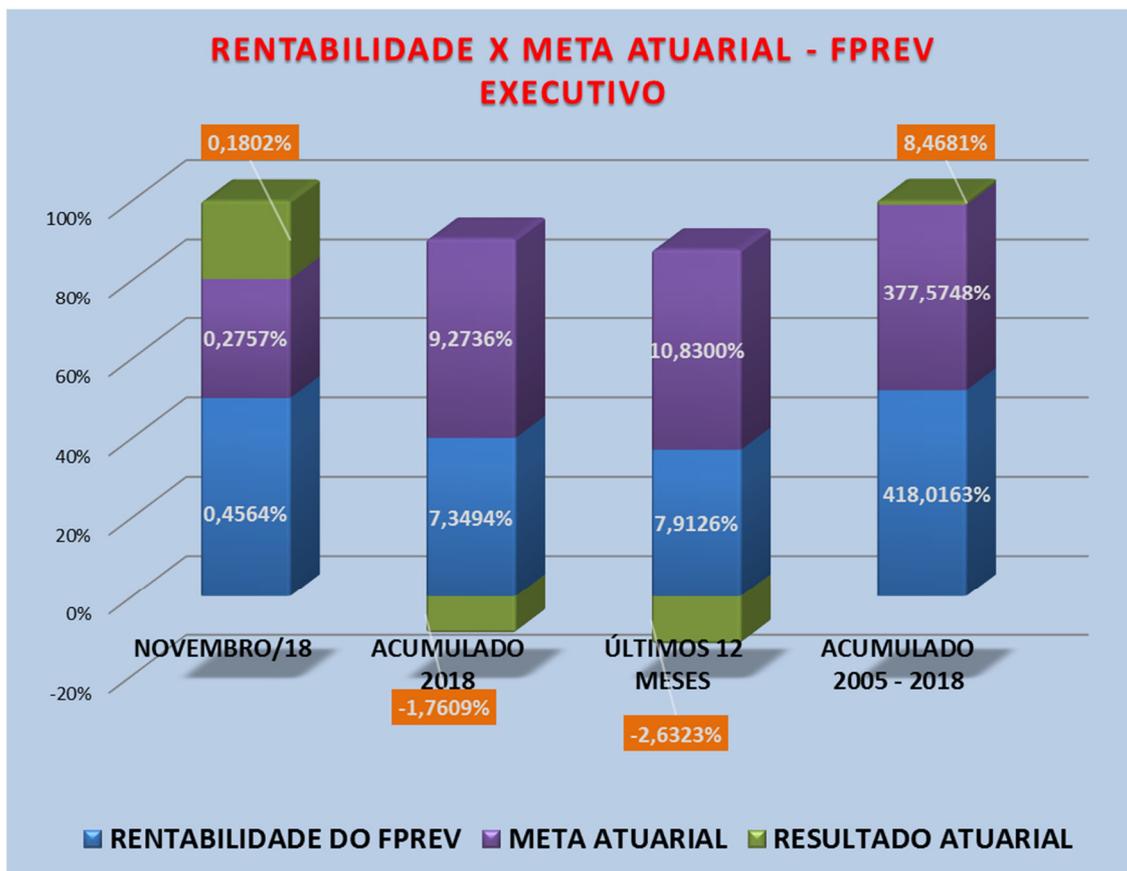


Gráfico 5.

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRASESCO FI REF. FEDERAL EXTRA	R\$ 3.344.307,88	R\$ 3.359.531,41	0,4571	0,5300	0,4752	1,4694%	5,7200%	NC	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 3.634.451,87	R\$ 1.893.454,45	0,6563	1,6936	0,3748	2,7447%	3,4513%	NC	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃ DINÂMICA II	R\$ -	R\$ 1.905.885,27	-	-	0,7879	0,7879%	0,7879%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -							
TOTAL	R\$ 6.978.759,75	R\$ 7.158.871,13							

Quadro 18

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.033.376,71	R\$ 2.039.942,38	1,0166	0,9864	0,3229	2,4655%	9,5597%	10,4266%
TOTAL GERAL	R\$ 2.033.376,71	R\$ 2.039.942,38						

Quadro 19.

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	set/18	out/18	nov/18
SALDO ANTERIOR	8.654.232,19	8.813.437,96	9.012.136,46
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	101.797,94	102.421,40	143.781,95
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	57.407,83	96.277,10	42.895,10
SALDO FINAL	8.813.437,96	9.012.136,46	9.198.813,51

Quadro 20

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO	
	31/10/2018	30/11/2018
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 6.978.759,75	R\$ 7.158.871,13
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.033.376,71	R\$ 2.039.942,38
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 9.012.136,46	R\$ 9.198.813,51

Quadro 21

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%
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%

Quadro 22

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

DESCRIÇÃO	NOVEMBRO/18	ACUMULADO 2018	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2012 - 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,4760%	6,4657%	7,1209%	123,057695%
META ATUARIAL	0,2757%	9,2736%	10,2886%	119,943130%
RESULTADO ATUARIAL	0,1997%	-2,5696%	-2,8722%	1,416077%

Quadro 23

Nota: Obs: Rentabilidade validada pelo atuário.

4. RECURSOS DO MPE e DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FI REF DI PREMIUM	R\$ 97.868.059,47	R\$ 98.872.776,18	0,4651	0,5365	0,4855	1,4945%	5,8200%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,01	R\$ -						
TOTAL	R\$ 97.868.060,48	R\$ 98.872.776,18						

Quadro 24.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

DESCRIÇÃO	NOVEMBRO/18	ACUMULADO 2018
RENTABILIDADE DO FPREV	0,4876%	4,0203%
META ATUARIAL	0,2757%	5,3356%
RESULTADO ATUARIAL	0,2113%	-1,2487%

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.

4.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)			
	31/10/2018	30/11/2018	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FI REF DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 598.798,24	0,1676	0,1676%	0,1676%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -				
TOTAL	R\$ -	R\$ 598.798,24				

Nota: Registra-se que a partir de Novembro/2018, os repasses de Contribuição Previdenciária do órgão DEFENSORIA PÚBLICA DO ESTADO DO AMAZONAS serão segregados dos demais repasses do poder Executivo.

Relatório de Investimentos Novembro 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\$ 9.198.813,51	R\$ 3.942.742.267,60	R\$ 98.872.776,18	R\$ 4.050.813.857,29

Quadro 26

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

				Patrimônio
Mês	Receitas	Despesas	Saldo	3.357.171.419,67
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	34.199.496,93	1.633.978,49	32.565.518,44	3.902.692.435,30
out/18	34.110.221,35	1.507.817,02	32.602.404,33	4.000.107.063,35
nov/18	33.881.603,04	1.464.475,87	32.417.127,17	4.050.813.857,29
dez/18	0,00	0,00	0,00	0,00
			Meta	9,27%
			Rentabilidade	7,34%
			Resultado	-1,77%

Quadro 27. Validado pelo atuário. Não está incluído na Avaliação de Novembro/2018 o primeiro repasse de Contribuição realizado pela DPE/AM, devendo ser incluído a partir de dezembro/2018.

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

6. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

6.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Investimentos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.327.677,60	R\$ 11.253.743,84	0,4500	0,5208	0,4720	1,4497%	5,6507%	6,2001%
BRADESCO FI RF IRF MI - COMPREV	R\$ 8.134.097,81	R\$ 8.171.365,84	0,5821	0,9008	0,5244	2,0204%	6,1500%	6,7400%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 573,49	R\$ 1.170.746,06						
TOTAL	R\$ 12.462.348,90	R\$ 20.595.855,74						

Quadro 28

6.2 Defensoria Pública - FFIN

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO			
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE
BRADESCO FI REF FEDERAL EXTRA	R\$ -	R\$ 295.453,05			0,1676	0,1676%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -				
TOTAL	R\$ -	R\$ 295.453,05				

6.3 Disponibilidade Financeira – FFIN EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/10/2018	30/11/2018
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 169.989,22	R\$ 115.436,98
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ -	R\$ 440.884,82
REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ 186,35

Quadro 31

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

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

6.4 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit - FFIN ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/10/2018	30/11/2018
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 10.238,02	R\$ 46.323,43
TOTAL	R\$ 10.238,02	R\$ 46.323,43

Quadro 29.

6.5 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	set/18	out/18	nov/18
SALDO ANTERIOR	R\$ 6.668,32	R\$ 5.837,68	R\$ 10.238,02
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 869.868,60	R\$ 870.983,03	R\$ 1.199.306,07
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.335.033,86	R\$ 1.345.658,31	R\$ 1.291.396,51
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00
SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$ 2.205.733,10	-R\$ 2.212.241,00	-R\$ 2.454.617,17
SALDO FINAL	R\$ 5.837,68	R\$ 10.238,02	R\$ 46.323,43

Quadro 30

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

7. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

7.1 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 476.344,99	R\$ 1.568.931,46	0,4500	0,5208	0,4720	1,4497%	5,6297%	6,1790%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF	R\$ 36.214.604,66	R\$ 37.905.942,24	0,5887	0,6351	0,5283	1,7623%	6,2291%	6,8323%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 2.016.244,41	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 38.707.194,06	R\$ 39.474.874,70						

Quadro 32

7.2 TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 41.583,58	R\$ 41.782,85			0,4792	0,4792%	0,4792%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 41.583,58	R\$ 41.782,85						

8. RECURSOS DOS OUTROS PODERES – TJA E TCE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO IRF MI - TJA	R\$ 100.605.989,36	R\$ 103.961.990,50	-	0,5022	0,5244	1,0293%	6,1500%	6,7400%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 138.611.104,54	R\$ 139.343.447,60	0,5887	0,9351	0,5283	2,0657%	6,2291%	6,8323%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 132.128.691,08	R\$ 134.257.035,75	0,5901	0,9348	0,5204	2,0588%	6,1871%	6,7804%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.433.520,79	R\$ 14.642,76						
TOTAL	R\$ 372.779.305,77	R\$ 377.577.116,61						

Quadro 33

8.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	set/18	out/18	nov/18
SALDO ANTERIOR	361.862.033,90	366.717.503,08	372.779.305,77
REPASSES FINANCEIROS	3.002.032,15	2.999.187,14	2.980.818,91
VARIAÇÃO FINANCEIRA	2.001.618,23	3.194.212,36	1.950.296,79
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(148.181,20)	(131.596,81)	(133.304,86)
SALDO FINAL	R\$ 366.717.503,08	R\$ 372.779.305,77	R\$ 377.577.116,61

Quadro 34

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					
	31/10/2018	30/11/2018	set/18	out/18	nov/18	TRIMESTRE	2018	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO IRF MI - TCE	R\$ 43.121.174,87	R\$ 44.525.683,95	-	0,5022	0,5244	1,0293%	6,1500%	6,7400%
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 55.563.883,80	R\$ 55.857.452,08	0,5887	0,9351	0,5283	2,0657%	6,2291%	6,8323%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 53.599.993,73	R\$ 54.281.234,61	0,5901	0,9348	0,5204	2,0588%	6,1871%	6,7804%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 400.272,21	R\$ 18.275,00						
TOTAL	R\$ 152.685.324,61	R\$ 154.682.645,64						

Quadro 35

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

8.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	set/18	out/18	nov/18
SALDO ANTERIOR	149.240.662,40	150.723.382,40	152.685.324,61
REPASSES FINANCEIROS	809.419,26	825.872,95	1.334.684,35
VARIAÇÃO FINANCEIRA	823.189,48	1.308.343,66	800.673,19
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(149.888,74)	(172.274,40)	(138.036,51)
SALDO FINAL	R\$ 150.723.382,40	R\$ 152.685.324,61	R\$ 154.682.645,64

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.

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

9. ENQUADRAMENTO

9.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2018	LIMITE DA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
TÍTULOS DO TN	RS 606.391.064,29	13,24%	40,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	RS 556.919.831,87	55,91%	40,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	RS 18.740.222,40				
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	RS 8.913.371,21				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	RS 101.490.932,87				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	RS 520.578.266,62				
SANTANDER FIC IMA B-5	RS 159.356.181,51				
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	RS 156.659.040,29				
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	RS 252.008.275,89				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	RS 629.471.900,06				
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	RS 67.529.949,36				
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	RS 43.203.371,11				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 46.341.721,60				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 14.425.135,04	28,20%	15%	40%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	RS 4.295.565,55				
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 687.451.837,79				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 58.286.821,89				
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 222.050.931,61				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 227.565.167,83				
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	RS 77.538.130,95				
TÍTULOS CVS	RS 14.075.913,60	0,31%	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	-	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC
TOTAL RENDA FIXA	RS 4.473.293.633,34	97,65%			

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2018	LIMITE DA RESOLUÇÃO	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	RS 18.205.184,07	0,40%	1%	30%	art. 8º, inciso I, "a"
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	RS 3.480.510,19	1,28%	2%	20%	art. 8º, inciso II, "a"
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	RS 2.347.038,16				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 10.219.536,06				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	RS 9.957.601,79				
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 32.431.689,02				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	RS 4.900.102,52	0,67%	1%	10%	art. 8º, inciso III
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	RS 5.337.766,56				
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	RS 5.148.743,68				
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	RS 15.472.029,02				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	RS 107.500.201,07	2,35%			

TOTAL GERAL DA CARTEIRA	RS 4.580.793.834,41	100,00%
--------------------------------	----------------------------	----------------

Quadro 37

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Res. nº 3.922/2010 atualizada
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 556.919.831,87	11,99%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 18.740.222,40	0,40%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 8.913.371,21	0,19%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 101.490.932,87	2,18%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 520.578.266,62	11,20%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 159.356.181,51	3,43%	
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 156.659.040,29	3,37%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 252.008.275,89	5,42%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 629.471.900,06	13,55%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 67.529.949,36	1,45%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.203.371,11	0,93%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 46.341.721,60	1,00%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 14.425.135,04	0,31%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 4.295.565,55	0,09%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 687.451.837,79	14,80%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.286.821,89	1,25%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 222.050.931,61	4,78%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 227.565.167,83	4,90%	
SANTANDER FIC INST. RF REF DI	R\$ 77.538.130,95	1,67%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 18.205.184,07	0,39%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.480.510,19	0,07%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.347.038,16	0,05%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 10.219.536,06	0,22%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 9.957.601,79	0,21%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 32.431.689,02	0,70%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 4.900.102,52	0,11%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.337.766,56	0,11%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.148.743,68	0,11%	
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.472.029,02	0,33%	
TOTAL DOS RECURSOS DO RPPS	R\$ 4.646.484.090,94		

Quadro 38

Nota: Enquadramento II - 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 Novembro de 2018

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. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 556.919.831,87	R\$ 12.831.650.129,37	4,34%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 18.740.222,40	R\$ 652.774.217,87	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX - 15/08/2018	R\$ 8.913.371,21	R\$ 120.025.855,37	7,43%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 101.490.932,87	R\$ 846.109.020,38	12,00%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 520.578.266,62	R\$ 6.923.281.999,25	7,52%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 159.356.181,51	R\$ 1.586.321.267,86	10,05%	
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 156.659.040,29	R\$ 1.662.818.141,33	9,42%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 252.008.275,89	R\$ 18.654.905.875,42	1,35%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 629.471.900,06	R\$ 9.736.339.713,88	6,47%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 67.529.949,36	R\$ 812.961.028,89	8,31%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.203.371,11	R\$ 252.955.481,52	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 46.341.721,60	R\$ 189.119.684,26	24,50%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 14.425.135,04	R\$ 379.904.223,93	3,80%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 4.295.565,55	R\$ 7.407.238.539,70	0,06%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 687.451.837,79	R\$ 7.912.517.110,99	8,69%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.286.821,89	R\$ 551.934.907,42	10,56%	
ITAÚ INST. ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 222.050.931,61	R\$ 2.413.070.507,67	9,20%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 227.565.167,83	R\$ 2.776.261.068,71	8,20%	
SANTANDER FIC INST. REF DI	R\$ 77.538.130,95	R\$ 4.253.254.685,69	1,82%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 18.205.184,07	R\$ 753.683.288,80	2,42%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 3.480.510,19	R\$ 30.354.410,79	11,47%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 2.347.038,16	R\$ 1.367.150.526,45	0,17%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 10.219.536,06	R\$ 290.087.182,94	3,52%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 9.957.601,79	R\$ 776.617.618,93	1,28%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 32.431.689,02	R\$ 627.746.064,20	5,17%	

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Res. nº 3.922/2010 atualizada pela Res. nº 4.604/2017
CAIXA FI JUROS E MOEDAS MULTIMERCADO	R\$ 15.472.029,02	R\$ 551.635.182,51	2,80%	5%
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.337.766,56	R\$ 265.893.368,08	2,01%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 4.900.102,52	R\$ 424.783.488,33	1,15%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	R\$ 5.148.743,68	R\$ 2.077.658.144,94	0,25%	

Quadro 39

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 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 Novembro 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 OUT/18) EM R\$ BI	TOTAL RECURSOS - AMAZONPREV	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Res. n°. 3.922/2010 atualizada pela Res. n° 4.604/2017
BB DTVM S.A	R\$ 928.492,02	R\$ 1.206.642.624,97	0,1300%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 656.601,73	R\$ 242.603.153,84	0,0369%	
BRADESCO	R\$ 614.811,35	R\$ 921.118.400,56	0,1498%	
CAIXA	R\$ 326.224,36	R\$ 1.222.880.742,26	0,3749%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	R\$ 260.854,26	R\$ 269.326.001,48	0,1032%	
BANCO SAFRA	R\$ 98.799,83	R\$ 10.048.846,20	0,0102%	
BANCO BTG	R\$ 92.237,64	R\$ 9.957.601,79	0,0108%	
ICATÚ	R\$ 18.650,40	R\$ 10.219.536,06	0,0548%	

Quadro 40

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

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

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

10. TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO	
DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.262.232.347,20
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 604.351.121,91
CVS	R\$ 14.075.913,60
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00
DEFENSORIA PÚBLICA - FPREV	R\$ 598.798,24
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 22.884,89
TOTAL	R\$ 3.943.341.065,84
ASSEMBLEIA LEGISLATIVA - ALE FPREV E ALE FFIN	
DESCRIÇÃO	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 7.158.871,13
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.039.942,38
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ -
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 46.323,43
TOTAL	R\$ 9.245.136,94
MPE FPREV	
DESCRIÇÃO	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 98.872.776,18
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
TOTAL	R\$ 98.872.776,18
TAXA DE ADM. FFIN EXECUTIVO, COMPREV, SAL. NÃO RECL. E DISP. FINANCEIRA	
DESCRIÇÃO	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	R\$ 39.474.873,70
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$ 41.782,85
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ 11.253.743,84
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 8.171.365,84
DEFENSORIA PÚBLICA - FFIN	R\$ 295.453,05
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM.	R\$ 1,00
DISP. FINANCEIRA - FFIN	R\$ 1.170.746,06
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ 440.884,82
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 115.436,98
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ 186,35
TOTAL	R\$ 60.964.474,49
OUTROS PODERES	
ORGÃOS	SALDO
TJ/AM	R\$ 377.562.473,85
TCE/AM	R\$ 154.664.370,64
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA/TCE	R\$ 32.917,76
TOTAL	R\$ 532.259.762,25
TOTAL GERAL	4.644.683.215,70

Quadro 41

Relatório de Investimentos Novembro de 2018

CONSOLIDADO DOS RECURSOS - NOVEMBRO/2018

DESCRIÇÃO	FPREV EXECUTIVO E DEFENSORIA	FPREV - ALE	TOTAL - FPREV
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 3.262.232.347,20	R\$ 7.158.871,13	R\$ 3.269.391.218,33
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 604.351.121,91	R\$ 2.039.942,38	R\$ 606.391.064,29
CVS	R\$ 14.075.913,60	R\$ -	R\$ 14.075.913,60
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00	R\$ -	R\$ 62.060.000,00
DEFENSORIA PÚBLICA	R\$ 598.798,24	R\$ -	R\$ 598.798,24
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 22.884,89	R\$ -	R\$ 22.884,89
TOTAL	R\$ 3.943.341.065,84	R\$ 9.198.813,51	R\$ 3.952.539.879,35

DESCRIÇÃO	FFIN - PODER EXECUTIVO	FFIN - ALE	TOTAL FFIN
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 11.549.196,89	R\$ -	R\$ 11.549.196,89
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.170.746,06	R\$ 46.323,43	R\$ 1.217.069,49
TOTAL	R\$ 12.719.942,95	R\$ 46.323,43	R\$ 12.766.266,38

DESCRIÇÃO	TAXA DE ADM EXEC. E ALE	SALARIOS NÃO RECLAMADOS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 39.516.656,55	R\$ -	R\$ 39.516.656,55
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 115.436,98	R\$ 115.437,98
TOTAL	R\$ 39.516.657,55	R\$ 115.436,98	R\$ 39.632.094,53

DESCRIÇÃO	COMPREV	DISP. COBERTURA DEFICIT E REPASSE PATRONAIS	TOTAL OUTROS RECURSOS
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 8.171.365,84	R\$ -	R\$ 8.171.365,84
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ -	R\$ 440.884,82	R\$ 440.884,82
DISP. REPASSES PATRONAIS	R\$ -	R\$ 186,35	R\$ 186,35
TOTAL	R\$ 8.171.365,84	R\$ 441.071,17	R\$ 8.612.437,01

DESCRIÇÃO	RECURSOS TJ/AM	RECURSOS TCE/AM	TOTAL RECURSOS TCE E TJ
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 377.562.473,85	R\$ 154.664.370,64	R\$ 532.226.844,49
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 14.642,76	R\$ 18.275,00	R\$ 32.917,76
TOTAL	R\$ 377.577.116,61	R\$ 154.682.645,64	R\$ 532.259.762,25

DESCRIÇÃO	RECURSOS MPE FPREV		TOTAL RECURSOS MPE FPREV
FUNDO DE INVESTIMENTO	R\$ 98.872.776,18	R\$ -	R\$ 98.872.776,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 98.872.776,18	R\$ -	R\$ 98.872.776,18

TOTAL DOS RECURSOS - AMAZONPREV			R\$ 4.644.683.215,70
--	--	--	-----------------------------

Quadro 42

Relatório de Investimentos Novembro 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