



GÓVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS



AMAZONPREV

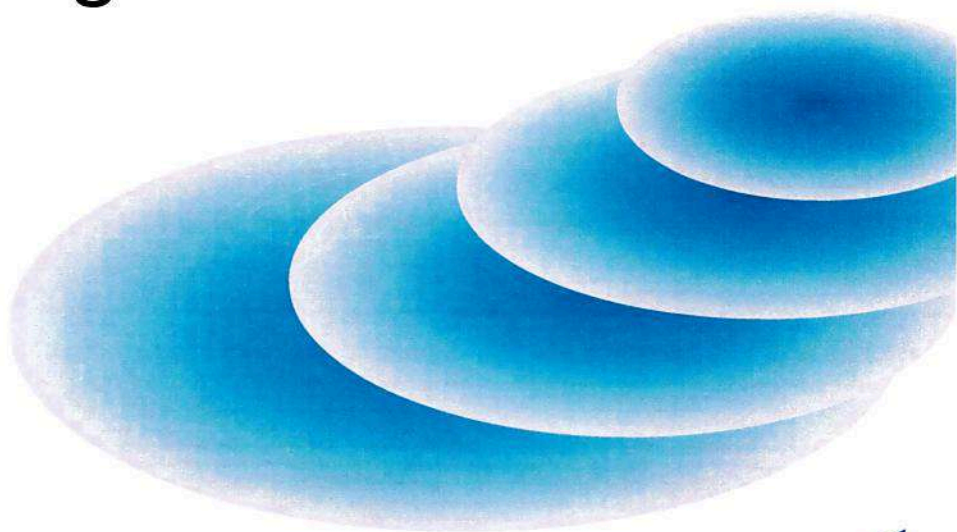
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2019

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

Agosto / 2019



Relatório de Investimentos agosto de 2019

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 16/09/2019

RELATÓRIO Nº 46/2019 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **Agosto/2019**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 04)
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 05 a 12)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 12 e 14)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 14)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 15)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 15)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (página 15)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 16)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro: Executivo, DPE, ALE e MPE – (página 17)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 18)
- 11) Outros Recursos Tribunal de Contas do Estado - TCE: Saldos e Composição (páginas 18)
- 12) Outros Recursos do Tribunal de Justiça – TJ/AM: Saldos e Composição (páginas 19)
- 13) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 20 a 23)
- 14) Total consolidado e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 24 e 25)
- 15) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 26)
- 16) Relatório de Risco dos Ativos (páginas 27 a 30).
- 17) Verificação de Lastro dos Fundos de Risco de Crédito (página 31)
- 18) Parecer do Comitê de Investimentos (página 32).
- 19) Aprovação do Conselho Fiscal (página 33).

Relatório de Investimentos agosto de 2019

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

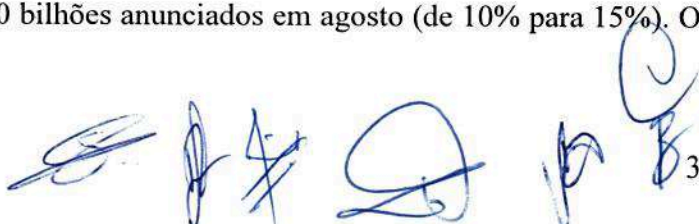
Conforme registra o Banco Bradesco, através do Relatório Síntese Mensal - Agosto/2019 – BRAM DTVM:

O PIB do 2º trimestre registrou alta acima do esperado, mantendo a perspectiva de recuperação gradual da atividade. A economia cresceu 0,4% com relação ao 1º trimestre, acima das expectativas do banco e do mercado, ambas de 0,2%. Pela ótica da demanda, o destaque foi o forte crescimento de 3,2% dos investimentos, surpreendendo a expectativa de alta de 2,6%. O consumo das famílias cresceu 0,3%, refletindo o cenário de lenta recuperação do mercado de trabalho formal, e os gastos do governo contraíram 1,0%. A partir da ótica da oferta, a indústria foi o destaque positivo, com alta de 0,7%. O resultado do 2º trimestre afasta o risco de crescimento mais baixo no ano, levando a um viés de alta para a projeção do banco de crescimento de 0,6%.

A prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) de agosto registrou alta abaixo do esperado e quadro segue benigno. No mês, a leitura do IPCA-15 foi de alta de 0,08%, abaixo da expectativa do banco (0,15%) e do mercado (0,16%). A maior surpresa em relação à projeção ocorreu no grupo Alimentação no Domicílio, que registrou deflação de 0,45%, ante expectativa de -0,02%. O grupo Habitação apresentou o resultado mais elevado, influenciado pelo aumento em energia elétrica (4,9%). Em 12 meses, o IPCA-15 atingiu 3,2% em agosto e a média dos núcleos segue em patamar confortável (3,1%). Com relação ao ano, projeta-se alta de 3,5%, abaixo da meta do Banco Central para 2019, de 4,25%.

A reforma da Previdência foi aprovada em 2º turno na Câmara dos Deputados. Após 1º turno aprovado com 379 votos, o 2º turno encerrou com 370 votos favoráveis e 124 contra. Nenhum destaque supressivo ao texto da reforma foi aprovado. Assim, a economia prevista em 10 anos com a reforma segue em R\$ 933 bilhões em 10 anos, segundo cálculo do governo. Esse valor é próximo da estimativa do banco de R\$ 865 bilhões, de acordo com o modelo do banco. A proposta segue em análise no Senado Federal e há a expectativa de que seja aprovada até meados de outubro.

No ambiente global, a tensão comercial teve nova escalada em agosto. No início do mês, Donald Trump anunciou novas tarifas de 10% sobre o restante das importações chinesas, cerca de US\$ 300 bilhões. Essa nova rodada, vale mencionar, abrange bens de consumo finais. No dia 23 de agosto, a tensão comercial ganhou novos contornos com o anúncio da China de novas tarifas de 10% sobre US\$ 75 bilhões de produtos americanos importados. Na sequência, Trump decidiu elevar novamente as tarifas sobre todas as exportações chinesas, tanto sobre os US\$ 250 bilhões anunciados em maio (de 25% para 30%), como sobre os US\$ 300 bilhões anunciados em agosto (de 10% para 15%). O

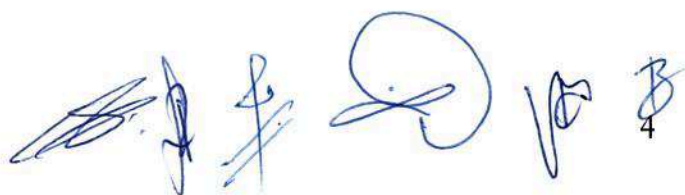


Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page, including a large signature on the left and several smaller initials and marks on the right, one of which includes the number '3'.

Relatório de Investimentos agosto de 2019

aumento da tensão comercial tem prejudicado a confiança dos investidores, com implicações diretas sobre os investimentos. Nesse cenário, o crescimento global para 2019 tem se aproximado de 3%, ante expectativa de 3,5% no início do ano.

Diante da piora do cenário global, o discurso do presidente do Fed sinalizou a continuidade do corte da taxa de juros. Em seu discurso, Jerome Powell, presidente do Fed, afirmou que os membros do comitê (FOMC) estão monitorando cuidadosamente as implicações da piora do ambiente global sobre a economia norte-americana, defendendo que agirão de modo a sustentar a expansão da economia doméstica. Vale mencionar que a ata da reunião, que precedeu a última rodada de aumento de tarifas, havia mostrado uma maior divisão entre os membros do comitê sobre a necessidade de estímulos. Ainda assim, o FOMC reconhecia os riscos e incertezas com relação ao cenário internacional, além de sinais de desaceleração dos investimentos e da produção industrial no país. Avalia-se que, a escalada da tensão comercial e a continuidade da fraqueza da indústria e investimento nos EUA permitirão nova redução da taxa de juros em 25 p.b. na reunião de setembro. As eleições primárias para presidente elevaram o grau de risco na Argentina, implicando postergação dos pagamentos da dívida junto a seus credores. Nas eleições primárias realizadas no dia 12 agosto, o candidato opositorista de esquerda, Alberto Fernandez (vice Cristina Kirchner) obteve 47% das intenções de votos, superando em mais de 15 pontos percentuais o 2º colocado, atual presidente Mauricio Macri. A probabilidade de retorno da coalizão kirchnerista ao poder em 27 de outubro (1º turno) se tornou amplamente majoritária. O aumento do risco derivado das dúvidas acerca da continuidade dos ajustes econômicos repercutiu negativamente sobre os ativos argentinos. Diante do cenário turbulento, o governo de Maurício Macri requisitou a renegociação dos pagamentos das dívidas de curto e longo prazo, incluindo o FMI. Nesse contexto de restrição externa, a recessão na Argentina deverá ter continuidade em 2020, impactando negativamente as exportações do Brasil.



Relatório de Investimentos agosto de 2019

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2019	30/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 387.876.187,04	R\$ 318.824.613,86	0,4695	0,5611	0,4974	1,5358%	4,1403%	6,2076%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 71.502.404,53	R\$ 71.509.543,86	1,7271	0,9566	0,0100	2,7105%	8,2231%	14,3170%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 1.221.990,60	R\$ 174.465,95	0,4488	0,5429	0,4791	1,4780%	3,5772%	NC
CAIXA FI BRASIL 2020 1 TP RF	R\$ 44.603.352,54	R\$ 43.527.428,14	0,6125	0,7341	0,2328	1,5870%	5,3527%	9,5689%
CAIXA FI BRASIL 2024 1 TP RF	R\$ 51.351.552,37	R\$ 50.143.897,89	2,9827	0,9545	0,0442	4,0117%	11,7724%	20,5562%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 276.488.191,04	R\$ 276.130.127,19	2,7348	1,1067	(0,1295)	3,7373%	12,0045%	16,6046%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 753.620.419,76	R\$ 753.883.552,10	1,6983	0,9472	0,0349	2,6974%	8,2208%	14,2335%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 84.292.564,97	R\$ 83.628.726,76	5,0037	1,5132	(0,7875)	5,7532%	21,6488%	NC
SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	R\$ 174.716.072,31	R\$ 174.770.297,84	1,7025	0,9516	0,0310	2,7022%	8,2177%	14,1990%
SANTANDER IMA B INST. TP	R\$ 22.707.280,45	R\$ 22.609.539,47	0,6154	1,2564	(0,4304)	1,4410%	1,4410%	NC
BB PREVID TP VII	R\$ 19.645.299,13	R\$ 19.155.286,57	1,0202	0,8272	0,1736	2,0327%	6,7012%	12,0181%
BB PREVID TP IX	R\$ 9.268.669,10	R\$ 9.313.380,68	0,4479	0,5440	0,4824	1,4816%	3,9982%	6,0024%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 797.019.690,30	R\$ 797.436.422,62	1,1055	0,9821	0,0523	2,1518%	6,8555%	11,8367%
BB PREVID RF IMA B5+	R\$ 251.184.358,91	R\$ 249.201.891,47	5,0403	1,4916	(0,7892)	5,7657%	21,6304%	NC
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 307.444.733,76	R\$ 308.418.915,49	2,5475	0,9473	0,3169	3,8470%	9,7372%	13,2486%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED PRIVADO	R\$ 12.332.719,52	R\$ 12.347.039,66	1,6753	0,8690	0,1161	2,6780%	4,8942%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 51.853.895,80	R\$ 51.863.073,56	1,7253	0,9244	0,0177	2,6838%	3,7261%	NC
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 55.597.298,71	R\$ 104.078.547,32	5,0431	1,4441	(0,8050)	5,7021%	10,2994%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 61.625.214,44	R\$ 61.332.426,84	-	1,0471	(0,4751)	0,5670%	0,5670%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.434.351.895,28	R\$ 3.408.349.177,27						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2019	30/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH	R\$ -	R\$ 20.142.367,31	-	-	0,7118	0,7118%	0,7118%	NC
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO	R\$ 5.551.453,67	R\$ 5.573.559,92	0,4844	0,5287	0,3982	1,4180%	3,5591%	7,9559%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 4.583.884,88	R\$ 4.784.761,24	3,9533	9,7987	4,3822	19,1412%	38,0139%	48,7949%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 67.117.343,63	R\$ 67.946.617,03	3,5247	1,3698	1,2356	6,2394%	16,9287%	39,0011%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 29.293.079,31	R\$ 29.357.711,52	0,2555	0,7532	0,2206	1,2335%	1,2335%	NC
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 60.002.085,23	R\$ 60.141.453,54	4,6799	2,2070	0,2323	7,2387%	17,3220%	37,8848%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 75.125.098,64	R\$ 76.310.454,70	4,8845	4,9465	1,5778	11,8094%	22,6767%	47,5627%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 87.109.897,29	R\$ 107.255.528,42	7,2232	3,7509	1,5655	12,9865%	17,0371%	NC
SAFRA S&P REAIS	R\$ 11.988.494,67	R\$ 11.814.372,96	7,0750	1,4545	(1,4524)	7,0546%	18,7667%	3,2515%
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.446.684,75	R\$ 5.766.180,25	0,0258	2,1560	5,8659	8,1763%	8,1763%	NC
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 128.485.898,96	R\$ 148.955.066,54	5,0561	2,3203	1,4665	9,0701%	26,2990%	NC
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 40.822.530,39	R\$ 60.383.291,70	4,8463	4,5977	1,9263	11,7794%	25,0437%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 515.526.451,42	R\$ 598.431.365,13						

TOTAL GERAL	R\$ 3.949.878.346,70	R\$ 4.006.780.542,40
--------------------	-----------------------------	-----------------------------

Quadro 1

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

Nota 2: Os Recursos de Contribuição previdenciária recebidos no período foram direcionados para os fundos Icatu Vanguarda Dividendos FIA, Itáú Ações Dunamis, BTG Pactual FIQ FIA, conforme registrado na Ata 153/2019 COMIV e aprovado pela Diretoria em Despacho de 07/08/2019.

Nota 3: Efetuada a migração do valor de R\$ 50.000.000,00 (cinquenta milhões de reais) do fundo Bradesco DI Premium para o fundo Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF, conforme registrado na Ata 153/2019 COMIV e aprovado pela Diretoria em Despacho de 07/08/2019.

Nota 4: Efetuada a aplicação inicial do valor de R\$ 20.000.000,00 (vinte milhões de reais) no fundo Bradesco IBr-X Apha, utilizando os recursos aplicados no fundo do fundo Bradesco DI Premium.

Relatório de Investimentos agosto de 2019

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	jun/19	jul/19	ago/19
BRADESCO	R\$ 464.155.573,48	R\$ 460.600.582,17	R\$ 410.650.990,98
BANCO DO BRASIL	R\$ 1.126.402.234,73	R\$ 1.077.118.017,44	R\$ 1.075.106.981,34
CAIXA	R\$ 1.207.888.376,20	R\$ 1.220.491.419,23	R\$ 1.217.672.053,24
ITAÚ	R\$ 500.187.409,91	R\$ 529.681.814,92	R\$ 552.126.352,15
SANTANDER	R\$ 290.779.074,52	R\$ 293.833.775,70	R\$ 294.684.165,86
SAFRA	R\$ 17.435.179,42	R\$ 79.060.393,86	R\$ 78.912.980,05
ICATU/BEM DTVM	R\$ 218.579.826,45	R\$ 248.269.812,99	R\$ 317.243.727,08
BTG PACTUAL	R\$ 39.028.118,53	R\$ 40.822.530,39	R\$ 60.383.291,70
TOTAL	R\$ 3.864.455.793,24	R\$ 3.949.878.346,70	R\$ 4.006.780.542,40

Quadro 2

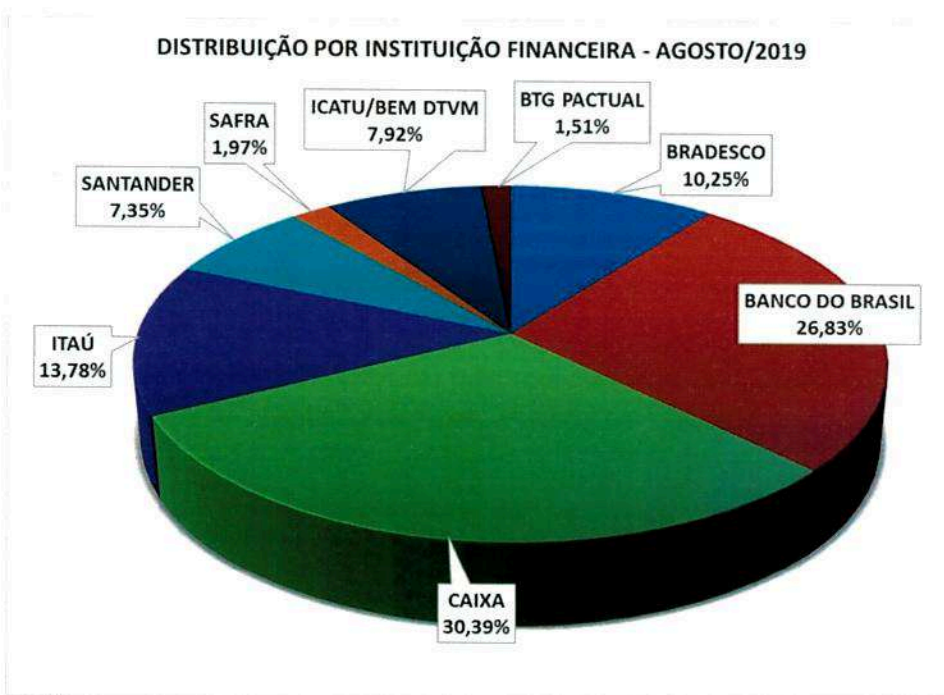


Gráfico 1

Relatório de Investimentos agosto 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	CDI	R\$ 318.999.079,81	7,96%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA SAFRA CONSUMO AMERICANO SAFRA S&P REAIS ICATU VANG. FIRF INFLA. CRED. PRIVADO ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA I RF FIC FI	CDI ATIVO	R\$ 614.476.635,55	15,34%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF SANTANDER IMA B INST. TP	IMA B	R\$ 83.941.966,31	2,09%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5 CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF SANTANDER FIC IMA B 5 TP RF	IMA B 5	R\$ 1.052.026.467,36	26,26%
BB PREVID IDKA 2 TP RF	IDKA 2	R\$ 797.436.422,62	19,90%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF BB PREVID RF IMA B5+	IMA B 5+	R\$ 436.909.165,55	10,90%
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\$ 122.139.993,28	3,05%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPH ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO CAIXA CONSUMO FI AÇÕES ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA BTG ABSOLUTO FIQ FIA ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	IBOVESPA	R\$ 580.850.811,92	14,50%
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 4.006.780.542,40	100%

Quadro 3

DISTRIBUIÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA -
AMAZONPREV

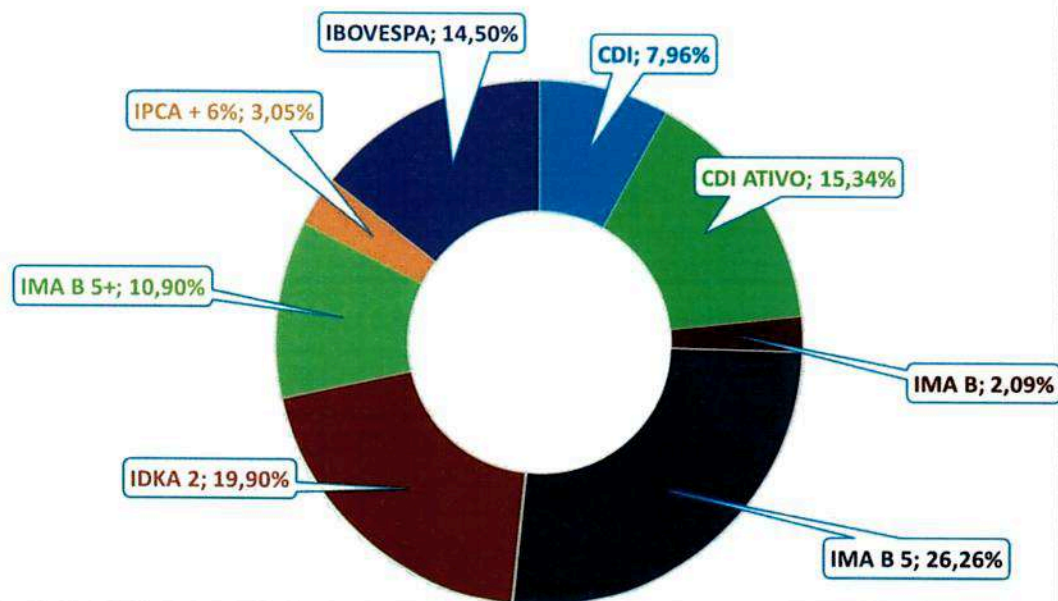


Gráfico 2

Relatório de Investimentos agosto de 2019

2.4 COMPARATIVO DA VALORIZAÇÃO DOS ÍNDICES DE REFERÊNCIA DE MERCADO

ÍNDICE	ago/19	ACUMULADO 2019	12 MESES
CDI	0,5000%	4,1800%	6,2800%
IMA-B 5	0,0498%	8,3829%	14,6387%
IMA-B	-0,4019%	16,2207%	27,7900%
IMA B 5+	-0,7689%	22,0024%	38,5152%
IRF M 1	0,5470%	4,6317%	7,4596%
IDKA 2	0,0849%	7,4208%	12,6870%
IBR X	-0,1600%	16,7500%	34,8600%
IBOVESPA	-0,6700%	15,0700%	31,9000%

Quadro 4

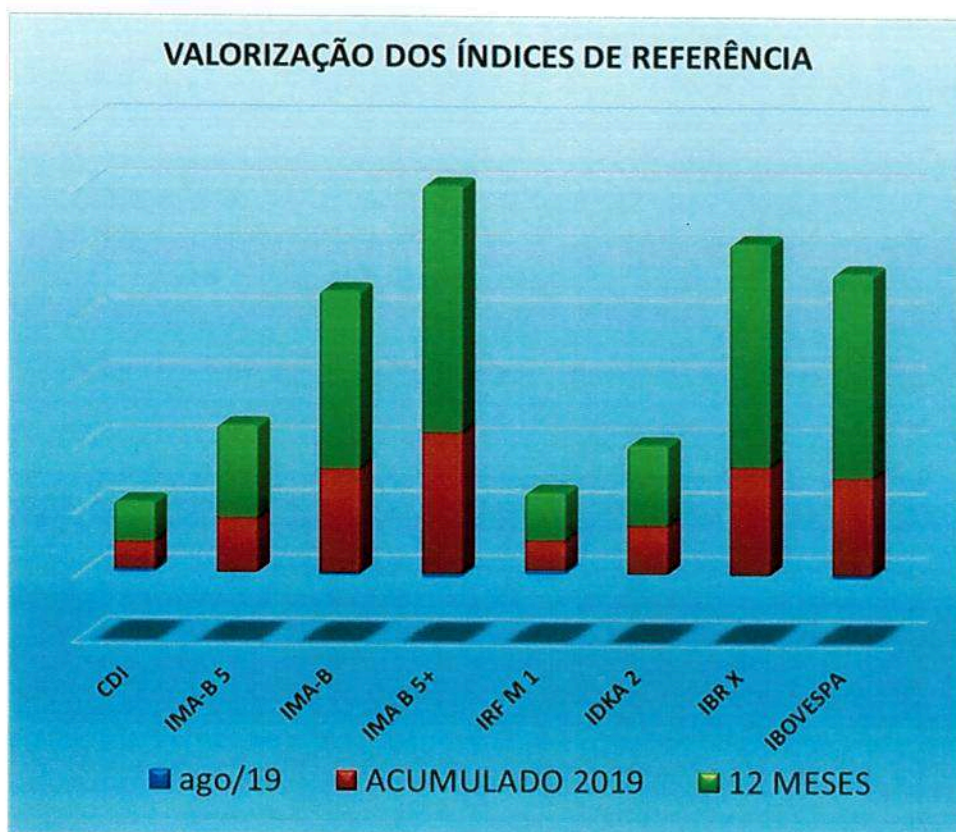


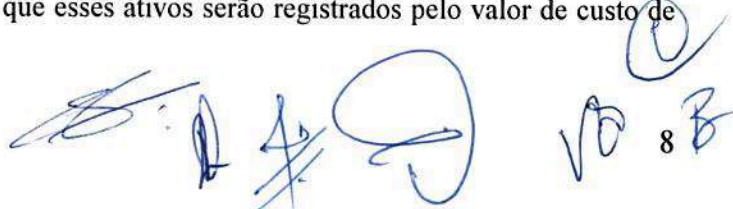
Gráfico 3

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2019	31/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 149.896.331,36	R\$ 150.848.432,64	0,534649	0,715593	0,635173	1,8972%	6,9185%	10,1310%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 155.744.380,52	R\$ 152.592.212,13	0,544070	0,725031	0,644604	1,9259%	6,9986%	10,2549%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 158.790.928,42	R\$ 155.632.437,25	0,567635	0,748638	0,668192	1,9975%	7,1994%	10,5654%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 161.284.725,69	R\$ 158.082.208,67	0,544085	0,725047	0,644619	1,9259%	6,9988%	10,2551%
TOTAL GERAL	R\$ 625.716.365,99	R\$ 617.155.290,69						

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



Relatório de Investimentos agosto de 2019

aquisição acrescidos dos rendimentos do período. Fica o registro de que a NTN – B remuneram IPCA + Tx de juros contratada no ato da aquisição do ativo (ver quadro 6).

Nota 2: Registrado em 15/08/2019 o pagamento de cupom de Títulos Públicos no total de R\$ 12.674.533,86, justificando a redução do total aplicado em NTN B (quaro 5). Os recursos foram direcionados para os fundos Icatu Vanguarda Dividendos FIA, Itaú Ações Dunamis, BTG Pactual FIQ FIA, conforme registrado na Ata 153/2019 COMIV e aprovado pela Diretoria em Despacho de 07/08/2019.

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRADERCO	BRADERCO	BRADERCO	BRADERCO
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\$ 150.848.432,64	R\$ 152.592.212,13	R\$ 155.632.437,25	R\$ 158.082.208,67
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 6

2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/07/2019	30/08/2019
CVS - A	R\$ 1.554.159,22	R\$ 1.536.705,90
CVS - B	R\$ 10.056.625,10	R\$ 9.943.647,30
CVS - C	R\$ 201.608,68	R\$ 199.344,60
CVS - D	R\$ 1.102.842,84	R\$ 1.090.453,32
TOTAL	R\$ 12.915.235,84	R\$ 12.770.151,12

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
fev/19	R\$ 39.906,45	R\$ 145.084,72	R\$ 184.991,17
mar/19	R\$ 39.486,47	R\$ 145.084,72	R\$ 184.571,19
abr/19	R\$ 39.066,51	R\$ 145.084,72	R\$ 184.151,23
mai/19	R\$ 38.646,54	R\$ 145.084,72	R\$ 183.731,26
jun/19	R\$ 38.226,55	R\$ 145.084,72	R\$ 183.311,27
jul/19	R\$ 37.806,59	R\$ 145.084,72	R\$ 182.891,31
ago/19	R\$ 37.386,62	R\$ 145.084,72	R\$ 182.471,34
TOTAL	R\$ 310.852,15	R\$ 1.160.677,76	R\$ 1.471.529,91

Quadro 8

9

Relatório de Investimentos agosto de 2019

2.9 CONTROLE DE RECEBIMENTO DE ALUGUEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2019 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/19	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/19	R\$ -	R\$ -	R\$ -
mar/19	R\$ 116.361,92	R\$ 267.638,40	R\$ 384.000,32
abr/19	R\$ 58.180,96	R\$ -	R\$ 58.180,96
mai/19	R\$ 58.180,96	R\$ -	R\$ 58.180,96
jun/19	R\$ 116.361,92	R\$ 267.638,40	R\$ 384.000,32
jul/19	R\$ -	R\$ 267.638,40	R\$ 267.638,40
ago/19	R\$ -	R\$ 58.180,96	R\$ 58.180,96
set/19	R\$ 133.819,20	R\$ -	R\$ 133.819,20
TOTAL	R\$ 482.904,96	R\$ 861.096,16	R\$ 1.344.001,12

Quadro 9.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

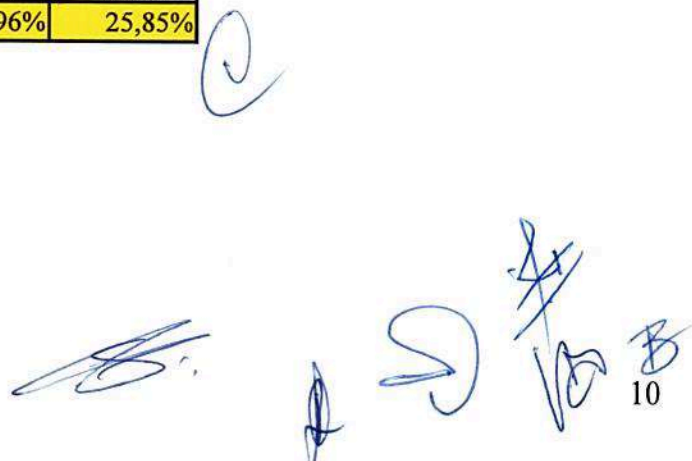
RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	31/07/2019	30/08/2019	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.949.878.346,70	R\$ 4.006.780.542,40	85,27%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 625.716.365,99	R\$ 617.155.290,69	13,13%
TÍTULOS CVS	R\$ 12.915.235,84	R\$ 12.770.151,12	0,27%
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00	R\$ 62.060.000,00	1,32%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 37.161,53	R\$ 1,00	0,00%
TOTAL	R\$ 4.650.607.110,06	R\$ 4.698.765.985,21	100%

Quadro 10.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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%
fev/19	R\$ 4.198.622.173,30	1,30%	3,61%	20,77%
mar/19	R\$ 4.270.610.204,33	1,71%	5,39%	20,79%
abr/19	R\$ 4.340.813.251,38	1,64%	7,12%	21,39%
mai/19	R\$ 4.441.433.234,67	2,32%	9,60%	24,70%
jun/19	R\$ 4.560.478.660,06	2,68%	12,54%	26,72%
jul/19	R\$ 4.650.607.110,06	1,98%	14,77%	25,75%
ago/19	R\$ 4.698.765.985,21	1,04%	15,96%	25,85%

Quadro 11



Relatório de Investimentos agosto de 2019

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	agosto/19	ACUMULADO 2019	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2005 - 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	0,2192%	8,7742%	13,0723%	468,7793%
META ATUARIAL	0,59729%	6,5969%	9,6345%	412,3253%
RESULTADO ATUARIAL	-0,3759%	2,0426%	3,1357%	11,0192%

Quadro 12.

Nota: O Resultado mensal da Rentabilidade reflete o Cenário comentado no Item 1 Cenário e Perspectivas (fls 3) do Relatório. Após análise, o Comitê entendeu que se trata de situação pontual, podendo ser revertida nos próximos períodos.

2.12 DADOS DE INFLAÇÃO - IPCA

PERÍODO	TAXA
setembro/18	0,48%
julho/19	0,19%
agosto/19	0,19%
Acumulado no ano de 2019	2,54%
Acumulado nos últimos 12 meses	3,43%
Meta Atuarial no mês	0,5973%

Quadro 13. Fonte: IBGE

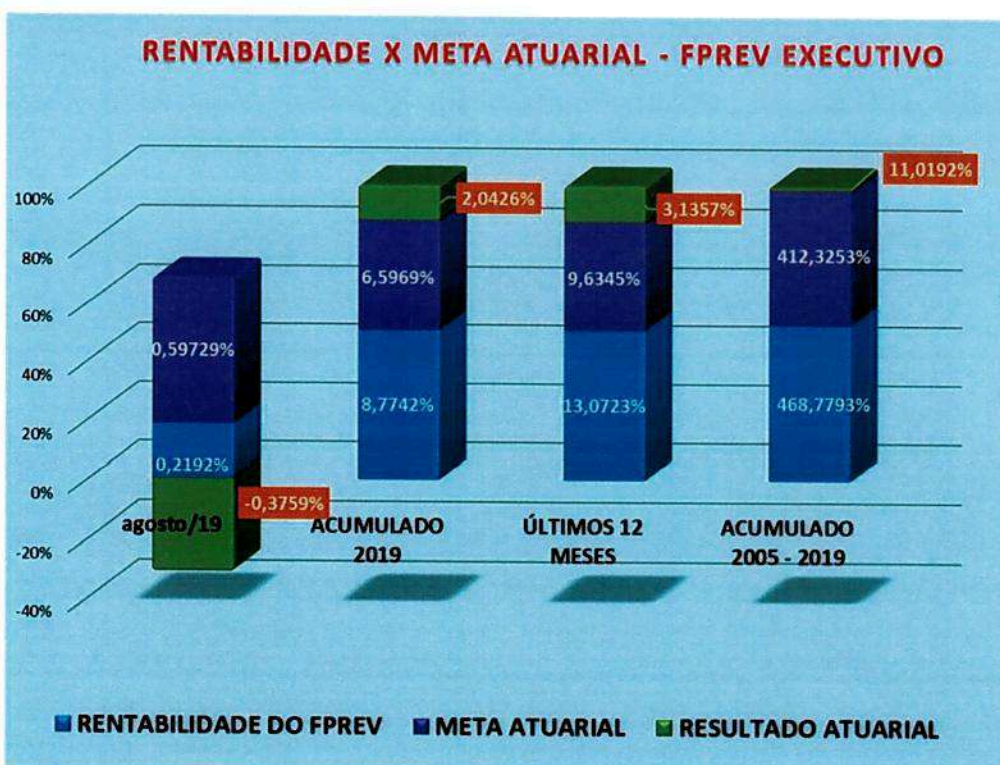
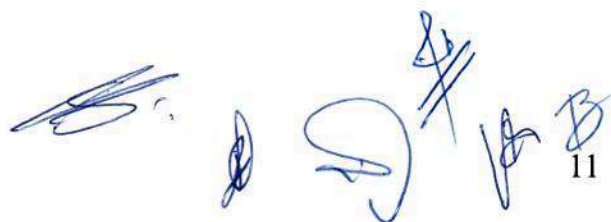


Gráfico 5


 11

Relatório de Investimentos agosto de 2019

2.13 QUADRO RESUMO DE RENTABILIDADE – FPREV EXECUTIVO



**FIUNDAÇÃO AMAZONPREV - ESTIMATIVA DE RENTABILIDADE PELA MOVIMENTAÇÃO FINANCEIRA
FPREV - Executivo - Agosto/2019**

Saldo dos Investimentos em 31/07/2019			3.733.589.594,73
Mês	Receitas	Despesas	Saldo
set/18	34.097.698,99	1.633.978,49	+32.463.720,50
out/18	34.007.799,95	1.507.817,02	+32.499.982,93
nov/18	33.737.821,09	1.464.475,87	+32.273.345,22
dez/18	75.239.795,82	2.413.960,02	+72.825.835,80
jan/19	25.741.140,15	1.624.312,33	+24.116.827,82
fev/19	36.105.221,68	1.577.166,50	+34.528.055,18
mar/19	48.780.707,02	1.653.421,67	+47.127.285,35
abr/19	27.254.847,98	1.484.969,43	+25.769.878,55
mai/19	37.682.513,87	1.872.658,21	+35.809.855,66
jun/19	41.150.382,45	1.842.441,88	+39.307.940,57
jul/19	38.725.793,39	2.036.530,69	+36.689.262,70
ago/19	39.885.991,44	1.920.723,93	+37.965.267,51
Saldo dos Investimentos em 31/08/2019			4.698.765.985,21

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Juros	6% ao ano	Índice de Inflação	IPCA-IBGE

Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	+3,4288%	+2,5354%	+0,1100%
Juros	+6,0000%	+3,9610%	+0,4868%
Meta	+9,6345%	+6,5969%	+0,5973%
Rentabilidade	+13,0517%	+8,7250%	+0,2192%
Resultado	+3,1168%	+1,9964%	-0,3759%

Fonte: ACTUARIAL - Assessoria e Consultoria Atuarial Ltda
Atuário Responsável: Luiz Claudio Kogut - MIBA 1.308

Quadro 14.

Nota: Receitas = Contribuições Previdenciárias (ativos, aposentados e pensionistas) / Despesas = Folha de Pagamento (aposentados e pensionistas).

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/07/2019	31/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 4.665.687,89	R\$ 4.717.400,34	2,7348	1,1067	(0,1295)	3,7372%	12,0045%	16,6046%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 4.582.271,04	R\$ 4.654.883,93	2,5474	0,9500	0,3169	3,8496%	4,8348%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 4,00	R\$ -						
TOTAL	R\$ 9.247.962,93	R\$ 9.372.284,27						

Quadro 15.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2019	31/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.125.579,23	R\$ 2.083.723,32	0,544070	0,725031	0,644604	1,9259%	6,9986%	10,2549%
TOTAL GERAL	R\$ 2.125.579,23	R\$ 2.083.723,32						

Quadro 16.

Nota 1: Registrado em 15/02/2019 o pagamento de cupom de Títulos Públicos no total de R\$ 56.721,95, justificando a redução do total aplicado em NTN B.

Relatório de Investimentos agosto de 2019

3.3 Composição dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS - ALE FPREV	jun/19	jul/19	ago/19
SALDO ANTERIOR	10.907.257,42	11.207.199,38	11.373.542,16
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	114.154,91	-	116.326,93
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS	185.827,65	166.342,78	(33.861,51)
SAÍDAS FINANCEIRAS	40,60	-	-
SALDO FINAL	11.207.199,38	11.373.542,16	11.456.007,59

Quadro 17.

3.4 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	31/07/2019	30/08/2019
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 9.247.958,93	R\$ 9.372.284,27
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.125.579,23	R\$ 2.083.723,32
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 4,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 11.373.542,16	R\$ 11.456.007,59

Quadro 18.

3.5 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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%
fev/19	R\$ 10.201.534,98	1,64%	5,71%	28,95%
mar/19	R\$ 10.372.018,29	1,67%	7,48%	28,87%
abr/19	R\$ 11.181.920,91	7,81%	15,87%	35,97%
mai/19	R\$ 10.907.257,42	-2,46%	13,02%	33,82%
jun/19	R\$ 11.207.199,38	2,75%	16,13%	35,83%
jul/19	R\$ 11.373.542,16	1,48%	17,85%	33,46%
ago/19	R\$ 11.456.007,59	0,73%	18,71%	32,37%

Quadro 19.

3.6 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

DESCRIÇÃO	agosto/19	ACUMULADO 2019	ÚLTIMOS 12 MESES	ACUMULADO 2012 - 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	-0,2977%	8,9605%	12,4544%	145,386342%
META ATUARIAL	0,5973%	6,5969%	9,4155%	135,947159%
RESULTADO ATUARIAL	-0,8897%	2,2173%	2,7774%	4,000549%

Quadro 20.

Nota: O Resultado mensal da Rentabilidade reflete o Cenário comentado no Item 1 Cenário e Perspectivas (fls 3) do Relatório. Após análise, o Comitê entendeu que se trata de situação pontual, podendo ser revertida nos próximos períodos.



Relatório de Investimentos agosto de 2019

3.7 QUADRO RESUMO DE RENTABILIDADE – ALE FPREV



FUNDAÇÃO AMAZONPREV - ESTIMATIVA DE RENTABILIDADE PELA MOVIMENTAÇÃO FINANCEIRA
FPREV - Assembléia - Agosto/2019

Saldo dos Investimentos em 31/07/2019			8.654.232,19
Mês	Receitas	Despesas	Saldo
set/18	101.797,94	0,00	+101.797,94
out/18	102.421,40	0,00	+102.421,40
nov/18	143.781,95	0,00	+143.781,95
dez/18	365.378,12	0,00	+365.378,12
jan/19	239.632,65	0,00	+239.632,65
fev/19	108.995,35	0,00	+108.995,35
mar/19	108.995,35	0,00	+108.995,35
abr/19	118.011,62	0,00	+118.011,62
mai/19	115.170,24	0,00	+115.170,24
jun/19	114.154,91	0,00	+114.154,91
jul/19	0,00	0,00	+0,00
ago/19	116.326,93	0,00	+116.326,93
Saldo dos Investimentos em 31/08/2019			11.456.007,59

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Juros	6% ao ano	Índice de Inflação	IPCA-IBGE
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	+3,4288%	+2,5354%	+0,1100%
Juros	+6,0000%	+3,9610%	+0,4868%
Meta	+9,6345%	+6,5969%	+0,5973%
Rentabilidade	+12,2939%	+8,7250%	-0,2977%
Resultado	+2,4256%	+1,9964%	-0,8897%

Fonte: ACTUARIAL - Assessoria e Consultoria Atuarial Ltda
Atuário Responsável: Luiz Claudio Kogut - MIBA 1.308

Quadro 21.

Nota 1: Receitas = Contribuições Previdenciárias (ativos, aposentados e pensionistas) / Despesas = Folha de Pagamento (aposentados e pensionistas).

Nota 2: No mês de julho/2019, as contribuições previdenciárias foram recolhidas no dia 10/08/2019, conforme estabelece a LC nº. 30/2001.

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2019	31/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 37.482.079,84	R\$ 37.117.014,07	2,0967	0,9258	0,1041	3,1491%	5,5657%	NC
BRABESCO FIC FI RF IMA B 5	R\$ 20.003.842,37	R\$ -	1,1314	0,9566	0,3194	2,4249%	2,4249%	NC
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+	R\$ -	R\$ 12.180.799,85			(0,7892)	-0,7892%	-0,7892%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 57.503.995,85	R\$ 74.576.462,34	-	-	0,0523	0,0523%	0,0523%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 4.668.958,40	R\$ 404.208,52						
TOTAL	R\$ 119.658.876,46	R\$ 124.278.484,78						

Quadro 22.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

DESCRIÇÃO	AGOSTO/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	-0,0347%	5,4234%
META ATUARIAL	0,5973%	6,5969%
RESULTADO ATUARIAL	-0,6283%	-1,1009%

Quadro 23.

Relatório de Investimentos agosto de 2019

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2019	31/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 6.490.808,31	R\$ 7.265.482,57	0,2190	0,9566	0,0100	1,1878%	1,1878%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 0,00	R\$ 0,00						
TOTAL	R\$ 6.490.808,31	R\$ 7.265.482,57						

Quadro 24.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

DESCRIÇÃO	AGOSTO/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	-0,0194%	4,3000%
META ATUARIAL	0,5973%	6,5969%
RESULTADO ATUARIAL	-0,6131%	-2,1548%

Quadro 25.

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2019	31/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 4.053.911,41	R\$ 10.397.633,05	0,8240	0,9566	0,0100	1,7987%	1,7987%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.571.512,61	R\$ -						
TOTAL	R\$ 6.625.424,02	R\$ 10.397.633,05						

Quadro 26.

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

DESCRIÇÃO	AGOSTO/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	-0,6634%	0,8563%
META ATUARIAL	0,5973%	3,9994%
RESULTADO ATUARIAL	-1,2532%	-3,0222%

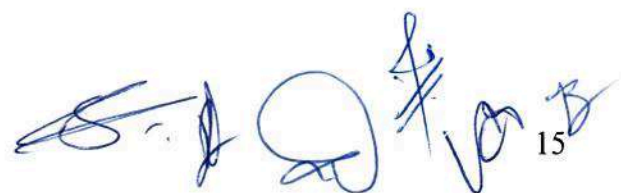
Quadro 27.

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2019	30/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ -	R\$ 901.761,86	-	-	(0,2259)	-0,2259%	-0,2259%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 896.478,81	R\$ 448.693,09						
TOTAL	R\$ 896.478,81	R\$ 1.350.454,95						

Quadro 28.



Relatório de Investimentos agosto de 2019

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

DESCRIÇÃO	agosto/2019	ACUMULADO 2019
RENTABILIDADE DO FPREV	-0,2271%	0,8563%
META ATUARIAL	0,5973%	3,9994%
RESULTADO ATUARIAL	-0,8195%	-3,0222%

Quadro 29.

8. CONSOLIDADO – FPREV

8.1 Evolução dos Recursos Consolidados – FPREV.

ANO	ALE FPREV	EXEC. FPREV	MPE FPREV	DPE FPREV	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	TCE	TOTAL FPREV
2004	R\$ -	R\$ 15.862.618,50	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 15.862.618,50
2005	R\$ -	R\$ 57.510.136,49	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 57.510.136,49
2006	R\$ -	R\$ 83.649.681,60	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 83.649.681,60
2007	R\$ -	R\$ 75.698.485,78	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 75.698.485,78
2008	R\$ -	R\$ 179.805.240,72	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 179.805.240,72
2009	R\$ -	R\$ 341.872.841,56	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 341.872.841,56
2010	R\$ -	R\$ 489.868.867,80	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 489.868.867,80
2011	R\$ -	R\$ 657.928.672,97	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 657.928.672,97
2012	R\$ 436.901,72	R\$ 936.612.579,50	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 937.049.481,22
2013	R\$ 1.239.708,12	R\$ 1.166.915.511,62	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 1.168.155.219,74
2014	R\$ 2.509.280,78	R\$ 1.571.464.403,45	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 1.573.973.684,23
2015	R\$ 3.643.310,21	R\$ 2.012.490.466,39	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 2.016.133.776,60
2016	R\$ 5.660.283,00	R\$ 2.700.997.719,11	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-	R\$ 2.706.658.002,11
2017	R\$ 7.574.592,78	R\$ 3.349.596.826,89	R\$ -	R\$ -	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\$ -	-	R\$ 4.163.667.673,17
2019	R\$ 11.456.007,59	R\$ 4.698.765.985,21	R\$ 124.278.484,78	R\$ 7.265.482,57	R\$ 10.397.633,05	R\$ 1.350.454,95	R\$ 4.853.514.048,15

Quadro 30.

8.2 Quadro Resumo da Rentabilidade 2019 – CONSOLIDADO FPREV AMAZONPREV



FUNDAÇÃO AMAZONPREV - ESTIMATIVA DE RENTABILIDADE PELA MOVIMENTAÇÃO FINANCEIRA FPREV - Consolidado - Agosto/2019

Saldo dos Investimentos em 31/07/2019			3.839.658.754,50
Mês	Receitas	Despesas	Saldo
set/18	34.199.496,93	1.633.978,49	+32.565.518,44
out/18	34.110.221,35	1.507.817,02	+32.602.404,33
nov/18	34.480.401,28	1.464.475,87	+33.015.925,41
dez/18	77.442.254,36	2.413.960,02	+75.028.294,34
jan/19	25.980.772,80	1.624.312,33	+24.356.460,47
fev/19	36.824.540,83	1.577.166,50	+35.247.374,33
mar/19	50.641.754,07	1.653.421,67	+48.988.332,40
abr/19	29.139.859,23	1.484.969,43	+27.654.889,80
mai/19	38.446.158,11	1.872.658,21	+36.573.499,90
jun/19	53.197.494,62	2.083.872,50	+51.113.622,12
jul/19	47.110.321,11	2.328.050,08	+44.782.271,03
ago/19	49.779.512,92	1.988.640,82	+47.790.872,10
Saldo dos Investimentos em 31/08/2019			4.853.514.048,15

Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos			
Juros	6% ao ano	Índice de Inflação	IPCA-IBGE
Item	Em 12 meses	No Ano	No Mês
IPCA	+3,4288%	+2,5354%	+0,1100%
Juros	+6,0000%	+3,9610%	+0,4868%
Meta	+9,6345%	+6,5969%	+0,5973%
Rentabilidade	+12,9434%	+8,7110%	-0,3850%
Resultado	+3,0181%	+1,9833%	-0,9764%

Fonte: ACTUARIAL - Assessoria e Consultoria Atuarial Ltda
Atuário Responsável: Luiz Claudio Kogut - MIBA 1.308

Quadro 31.

Relatório de Investimentos agosto de 2019

9. RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Investimentos – FFIN Executivo

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2019	30/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.777.478,58	-	0,4488	0,5429	-	0,9942%	3,4946%	5,4902%	
BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 11.368.830,15	R\$ 11.458.342,50	-	0,6743	0,1040	0,7790%	0,7790%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.203,05	R\$ 1.214.407,46							
TOTAL	R\$ 13.147.511,78	R\$ 12.672.749,96							

Quadro 32.

9.2 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Investimentos DPE - FFIN

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2019	30/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 775.252,48	R\$ 1.060.743,00	-	0,5429	0,4768	1,0223%	1,0223%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 0,00	R\$ 0,00							
TOTAL	R\$ 775.252,48	R\$ 1.060.743,00							

Quadro 33.

9.3 Saldos e Performance dos Fundos de Investimentos – ALE FFIN

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2019	30/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 213.737,55	R\$ 196.907,19	0,4488	0,5429	0,4768	1,4757%	2,9660%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00							
TOTAL	R\$ 213.738,55	R\$ 196.908,19							

Quadro 34.

9.4 Disponibilidade Financeira – FFIN EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/07/2019	30/08/2019
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 350.092,60	R\$ 350.658,65
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 4.719,34	R\$ 4.719,34
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 510.167,11	R\$ 1.137,63

Quadro 35.

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.

9.5 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit - FFIN ALE

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/07/2019	30/08/2019
COBERTURA DO DEFICIT - ALE	R\$ 477.033,13	R\$ 4.229,63

Quadro 36.

9.6 Composição do Recursos – ALE FFIN

DESCRIÇÃO	jun/19	jul/19	ago/19
SALDO ANTERIOR	R\$ 917.561,26	R\$ 1.151.717,59	R\$ 690.771,68
CONTRIBUIÇÃO PREVIDENCIÁRIA	R\$ 947.559,18	R\$ 184.733,01	R\$ 993.186,16
COBERTURA DO DEFICIT	R\$ 1.527.206,21	R\$ 1.422.723,60	R\$ 1.882.228,58
VARIAÇÃO FINANCEIRA	R\$ 3.277,48	R\$ 4.124,98	R\$ 1.783,56
SAIDAS FINANCEIRAS	-R\$ 2.243.886,54	-R\$ 2.072.527,50	-R\$ 3.366.832,16
SALDO FINAL	R\$ 1.151.717,59	R\$ 690.771,68	R\$ 201.137,82

Quadro 37.

Relatório de Investimentos agosto de 2019

9.7 Disponibilidade Financeira e Cobertura do Déficit - FFIN MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/07/2019	30/08/2019
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 903.624,41	R\$ 191.467,90
TOTAL	R\$ 903.624,41	R\$ 191.467,90

Quadro 38.

10. TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2019	30/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.325.393,95	R\$ 2.959.523,05	0,4488	0,5429	0,4791	1,4780%	3,9905%	5,9956%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 45.088.931,02	R\$ 40.030.088,61	0,4104	1,1067	(0,1295)	1,3902%	1,3902%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 46.414.325,97	R\$ 42.989.612,66						

Quadro 39.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2019	30/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 582.370,24	R\$ 651.100,18	0,4555	0,5516	0,4886	1,5032%	4,0408%	NC
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 0,00	R\$ 1.466,44						
TOTAL	R\$ 582.370,24	R\$ 651.100,18						

Quadro 40.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/07/2019	30/08/2019
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 0,00	R\$ 92.195,32
TOTAL	R\$ -	R\$ 92.195,32

Quadro 41.

11. OUTROS RECURSOS

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/07/2019	30/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO IRF MI - TJA	R\$ 97.342.951,26	R\$ 43.556.642,54	0,5607	0,6919	0,5248	1,7879%	4,4475%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TJA	R\$ 156.079.685,71	R\$ 179.759.857,42	0,5735	0,6999	0,5250	3,6407%	4,4994%	7,2364%
BB PREV. RF IRF MI - TJA	R\$ 147.010.063,67	R\$ 175.814.061,64	0,5725	0,6991	0,5169	1,7992%	4,4699%	7,1922%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.505.783,82	R\$ 10.093,05						
TOTAL	R\$ 403.938.484,46	R\$ 399.140.654,65						

Quadro 42

Relatório de Investimentos agosto de 2019

11.2 Composição dos Saldos - TJA

FUNDO DE INVESTIMENTO	jun/19	jul/19	ago/19
SALDO ANTERIOR	407.899.779,71	403.111.711,55	403.938.484,46
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	1.339.014,89	10.023.068,51	5.729.117,90
VARIAÇÃO FINANCEIRA	2.195.853,94	2.796.351,99	2.078.348,28
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(8.322.936,99)	(11.992.647,59)	(12.605.295,99)
SALDO FINAL	R\$ 403.111.711,55	R\$ 403.938.484,46	R\$ 399.140.654,65

Quadro 43

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

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/07/2019	30/08/2019	jun/19	jul/19	ago/19	TRIMESTRE	2019	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO IRF MI - TCE	R\$ 39.768.416,40	R\$ 17.338.525,32	0,5607	0,6919	0,5248	1,7879%	4,4475%	NC
CAIXA FI BRASIL IRF MI TP RF - TCE	R\$ 61.141.111,13	R\$ 70.521.375,86	0,5735	0,6999	0,5250	3,6407%	4,4994%	7,2364%
BB PREV. RF IRF MI - TCE	R\$ 59.470.775,85	R\$ 68.837.410,37	0,5725	0,6991	0,5169	1,7992%	4,4699%	7,1922%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 0,00	R\$ 86.478,99						
TOTAL	R\$ 160.380.303,38	R\$ 156.783.790,54						

Quadro 44.

11.4 Composição dos Saldos - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	jun/19	jul/19	ago/19
SALDO ANTERIOR	164.918.165,19	162.089.142,55	160.380.303,38
CONTRIB. PREVIDENCIÁRIA	1.285.439,60	1.708.648,97	2.416.406,61
VARIAÇÃO FINANCEIRA	926.465,31	1.121.728,46	830.389,73
(-) SAÍDAS FINANCEIRAS	(5.040.927,55)	(4.539.216,60)	(6.843.309,20)
SALDO FINAL	R\$ 162.089.142,55	R\$ 160.380.303,38	R\$ 156.783.790,52

Quadro 45.

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

Relatório de Investimentos agosto de 2019

12. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

12.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2019		LIMITE DA RESOLUÇÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR		
TÍTULOS DO TN	R\$ 619.239.014,01	11,46%	11%	100%	100%	art 7º, inciso I, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 244.651.472,01	56,70%	50%	100%	100%	art 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.155.286,57					
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 9.313.380,68					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 261.382.691,32					
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 872.012.884,96					
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 174.770.297,84					
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 22.609.539,47					
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 60.895.167,86					
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 250.281.233,28					
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 753.883.552,10					
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 83.628.726,76					
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.527.428,14					
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 50.143.897,89					
ICATÚ VANG INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 51.863.073,56					
ICATÚ VANG INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 104.078.547,32					
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 61.332.426,84					
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.391.639,19	20,29%	40%	40%	40%	art 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 651.100,18					
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 318.824.613,86					
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 90.074.421,34					
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.575.356,57					
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 313.073.799,42					
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 320.877.616,14					
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 12.347.039,66	0,23%	1%	2%	5%	art 7º, inciso VII, "b"
TÍTULOS CVS	R\$ 12.770.151,12	0,24%	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	ATIVO EM ENQUADRAMENTO	-	TÍTULO NÃO REGISTRADO NO SELIC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.804.354.358,09	88,92%				

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2019		LIMITE DA RESOLUÇÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR		
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 20.142.367,31	0,37%	8%	15%	30%	art 8º, inciso I, "a"
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 60.141.453,54	10,27%	8%	15%	20%	art 8º, inciso II, "a"
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.784.761,24					
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 76.310.454,70					
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 107.255.528,42					
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 148.955.066,54					
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 60.383.291,70					
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 29.357.711,52					
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 67.946.617,03	0,43%	3%	10%	10%	art 8º, inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 11.814.372,96					
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.766.180,25					
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.573.559,92					
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 598.431.365,13	11,08%				

TOTAL GERAL DA CARTEIRA	R\$ 5.402.785.723,22	100,00%
--------------------------------	-----------------------------	----------------

Quadro 46.

Relatório de Investimentos agosto de 2019

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM I FIC FI	R\$ 244.651.472,01	4,47%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 19.155.286,57	0,35%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ 9.313.380,68	0,17%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 261.382.691,32	4,78%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 872.012.884,96	15,95%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 174.770.297,84	3,20%	
BRADESCO FI RF IRFM I TP	R\$ 60.895.167,86	1,11%	
CAIXA FI BRASIL IRF M I TP RF	R\$ 250.281.233,28	4,58%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 753.883.552,10	13,79%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 83.628.726,76	1,53%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.527.428,14	0,80%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 50.143.897,89	0,92%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.391.639,19	0,08%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 651.100,18	0,01%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 318.824.613,86	5,83%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 90.074.421,34	1,65%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.575.356,57	0,89%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 20.142.367,31	0,37%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 313.073.799,42	5,73%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 320.877.616,14	5,87%	
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 22.609.539,47	0,41%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 60.141.453,54	1,10%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 107.255.528,42	1,96%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.784.761,24	0,09%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 76.310.454,70	1,40%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 148.955.066,54	2,72%	
ICATÚ VANG. FI RF INFAÇÃO CP LP	R\$ 12.347.039,66	0,23%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 51.863.073,56	0,95%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 104.078.547,32	1,90%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 60.383.291,70	1,10%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 67.946.617,03	1,24%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 29.357.711,52	0,54%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 11.814.372,96	0,22%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.766.180,25	0,11%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 61.332.426,84	1,12%	
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.573.559,92	0,10%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 4.770.776.558,09		
TÍTULOS DO TN	R\$ 619.239.014,01		
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00		
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 2.810.119,02		
FCVS	R\$ 12.915.235,84		
TOTAL DO RECURSOS	R\$ 5.467.800.926,96		
Base: 31/08/2019			
TOTAL DAS APLICAÇÕES DOS RECURSOS	R\$ 5.402.785.723,22		

Quadro 47.

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 agosto de 2019

12.3 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 DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ 244.651.472,01	8.046.457.805,40	3,04%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 19.155.286,57	667.232.332,00	2,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX - 15/08/2018	R\$ 9.313.380,68	94.352.571,44	9,87%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ 261.382.691,32	2.903.496.743,90	9,00%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 872.012.884,96	7.650.717.820,55	11,40%	
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ 60.895.167,86	837.976.119,28	7,27%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.391.639,19	336.419.185,93	1,31%	
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ 651.100,18	9.093.573.111,46	0,01%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 318.824.613,86	6.376.477.804,17	5,00%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 90.074.421,34	774.020.429,67	11,64%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.575.356,57	810.382.093,50	5,99%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 20.142.367,31	188.658.658,40	10,68%	
CAIXA FI BRASIL IRF M 1 TP RF	R\$ 250.281.233,28	11.397.966.980,21	2,20%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 753.883.552,10	9.951.491.659,11	7,58%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ 83.628.726,76	2.857.219.565,23	2,93%	
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ 43.527.428,14	254.852.724,83	17,08%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 50.143.897,89	204.636.299,13	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 320.877.616,14	7.692.574.586,28	4,17%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 4.784.761,24	185.100.431,00	2,58%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 313.073.799,42	5.084.742.954,71	6,16%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 60.141.453,54	828.711.835,60	7,26%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 76.310.454,70	1.936.669.944,57	3,94%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 107.255.528,42	2.860.793.399,75	3,75%	
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ 174.770.297,84	1.342.953.261,23	13,01%	
SANTANDER IMA B INST. TP RF LP	R\$ 22.609.539,47	1.252.135.158,53	1,81%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 67.946.617,03	752.486.009,87	9,03%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 29.357.711,52	621.465.830,00	4,72%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 148.955.066,54	1.271.943.146,67	11,71%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 51.863.073,56	564.201.336,25	9,19%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 104.078.547,32	1.044.148.579,71	9,97%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 61.332.426,84	1.498.753.877,21	4,09%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 60.383.291,70	1.439.217.477,51	4,20%	
TOTAL	R\$ 4.735.275.405,30			

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
CAIXA FIC CAPITAL PROT. BRASIL IBOVESPA II	R\$ 5.573.559,92	277.393.765,27	2,01%	5%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 11.814.372,96	338.186.042,03	3,49%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO	R\$ 5.766.180,25	349.163.456,74	1,65%	
ICATÚ VANG. FI RF INFAÇÃO CP LP	R\$ 12.347.039,66	453.400.882,55	2,72%	
TOTAL	R\$ 35.501.152,79			

Quadro 48.

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;



Relatório de Investimentos agosto de 2019

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.

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA JUNHO/19) EM R\$ MI	TOTAL RECURSOS - AMAZONPREV (AGOSTO/2019)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.042.993,08	R\$ 1.406.515.715,54	0,1349%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 724.214,15	R\$ 556.781.236,08	0,0769%	
BRADESCO	R\$ 591.332,71	R\$ 543.554.666,31	0,0919%	
CAIXA	R\$ 361.112,52	R\$ 1.512.700.775,47	0,4189%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 267.788,07	R\$ 294.684.165,86	0,1100%	
BANCO BTG	R\$ 105.220,19	R\$ 60.383.291,70	0,0574%	
BANCO SAFRA	R\$ 99.185,36	R\$ 78.912.980,05	0,0796%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 22.854,53	R\$ 317.243.727,08	1,3881%	

Quadro 49.

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

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

23

Relatório de Investimentos agosto de 2019

13. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

FPREV PODER EXECUTIVO	SALDO
FUNDO DE INVESTIMENTO FPREV - EXECUTIVO	R\$ 4.006.780.542,40
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 617.155.290,69
TÍTULOS PÚBLICOS - CVS	R\$ 12.770.151,12
IMÓVEIS	R\$ 62.060.000,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EXECUTIVO	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 4.698.765.985,21

ASSEMBLEIA LEGISLATIVA	SALDO
ALE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 9.372.284,27
ALE FPREV TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.083.723,32
ALE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
ALE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 196.907,19
ALE FFIN DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - ALE COBERTURA	R\$ 4.229,63
TOTAL	R\$ 11.657.145,41

PROCURADORIA GERAL DE JUSTIÇA - PGJ/MPE	SALDO
MPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 123.874.276,26
MPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 404.568,52
MPE FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - PGJ/MPE - FFIN	R\$ 191.467,90
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - MPE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 124.470.312,68

DEFENSORIA PÚBLICA - DPE/AM	SALDO
DPE FPREV FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 7.265.482,57
DPE FPREV DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -
DPE - FFIN FUNDOS DE INVESTIMENTOS	R\$ 1.060.743,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE - FFIN	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - DPE COBERTURA	R\$ -
TOTAL	R\$ 8.326.225,57

TRIBUNAL DE JUSTIÇA - TJ/AM	SALDO
TJ/AM	R\$ 399.130.561,60
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA	R\$ 10.093,05
TJ/AM - FPREV	R\$ 10.397.633,05
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TJA - FPREV	R\$ -
TOTAL	R\$ 409.538.287,70

TRIBUNAL DE CONTAS DO ESTADO - TCE/AM	SALDO
TCE/AM	R\$ 156.697.311,55
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE	R\$ 86.478,99
TCE/AM - FPREV	R\$ 901.761,86
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - TCE/FPREV	R\$ 448.693,09
TOTAL	R\$ 158.134.245,49

OUTROS RECURSOS	SALDO
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO EXECUTIVO	R\$ 42.989.611,66
DISP. FINANCEIRA - TAXA DE ADM. EXECUTIVO	R\$ 1,00
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO - ALE	R\$ 651.100,18
DISP. FINANCEIRA - TX DE ADM. ALE	R\$ 1.466,44
DISP. FINANCEIRA - TX DE ADM. TCE	R\$ 92.195,32
FUNDO FINANCEIRO - EXECUTIVO	R\$ -
FUNDO FINANCEIRO - COMPREV	R\$ 11.458.342,50
DISP. FINANCEIRA - FFIN EXECUTIVO	R\$ 1.214.407,46
DISP. FINANCEIRA - REP. COBERT. DEFICIT	R\$ 1.137,63
DISP. FINANCEIRA - SAL. NÃO RECLAMADOS	R\$ 350.658,65
DISP. REPASES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 4.719,34
TOTAL	R\$ 56.763.640,18
TOTAL GERAL	R\$ 5.467.655.842,24

Quadro 50.

Relatório de Investimentos agosto de 2019



Gráfico 6.

Nota: Conforme PPA 2019-2021 o valor projetado para 2019, equivale ao total de R\$ 5.271.918.303,00.

Handwritten signature

Handwritten signatures

Relatório de Investimentos agosto de 2019

15. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: deverão ser rateados entre os fundos Itaú Ações Dinâmicas FIC e Icatu Vanguarda Dividendos FIA	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2019
	b) Fundos de Curto Prazo. Manter, regularmente, saldo de aplicação no fundo Bradesco Maxi Poder Público no valor de R\$ 2.000.000,00 (dois milhões de reais), já que possui baixa automática otimizando o processo de pagamentos de rotina, incluindo folha de pagamento de aposentados e pensionistas do FPREV.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2019
FPREV ALE:	Novos Recursos: Direcionar 5% (cinco por cento) para o Fundo Icatu Dividendos FIA, rateando o restante entre os fundos Caixa Gestão Estratégica e Itaú Alocação Dinâmica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2019
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2019
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Alocação Dinâmica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2019
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2019
FPREV - TCE/AM:	Novos Recursos: Direcionar para o Fundo Bradesco Institucional FIC FI RF IMA-B 5	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2019
Outros Repasses – TCE e TJAM:	Novos recursos: devem ser direcionados para os fundos Caixa IRF Brasil M1 e BB Previdenciário IRF M1	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2019
FFIN - EXECUTIVO, ALE, DPE e MPE:	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público ou Bradesco Alocação Dinâmica ou Bradesco Federal Extra DI, conforme limites para aplicação	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2019
RECURSOS COMPREV:	Aplicar no fundo Bradesco Alocação Dinâmica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2019
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Aplicar no fundo Maxi poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2019
FATOS RELEVANTES 1.	Informado por email que o fundo Icatu Vanguarda Dividendos FIA deverá encerrar para captação ao atingir o Patrimônio Líquido de R\$ 1,5 bilhão. Atualmente, a Amazonprev possui o total de R\$ 165,792 milhões aplicados no fundo, e que de acordo com as análises de desempenho das aplicações, esse produto possui a melhor relação Risco x Retorno da Carteira. SUGESTÃO: direcionar para esse produto o recurso necessário para atingir o limite permitido pela Resolução 3.922/2010, de 15% do Patrimônio Líquido do fundo.	COMIV	Após aprovação pela Diretoria
FATOS RELEVANTES 2.	Banco BTG Pactual. No mês de agosto/2019 o banco BTG Pactual foi novamente citado como alvo de investigações da Lava Jato, pela participação de processos fraudulentos em governos anteriores. O Banco se manifestou em Nota Oficial, registrando que não cometeu qualquer irregularidade. Nesse período, as transferências de recursos para aplicação, conforme Deliberação anterior, foram suspensas até melhor análise pelo Comitê. Estão aplicados no fundo BTG Pactual Absoluto FIQ FIA o valor de R\$ 60 milhões, que entre o mês de agosto e até a data da reunião do Comitê houve aumento do Patrimônio Líquido do fundo com aumento de cotistas, conforme registra a CVM. Sugestão: manter suspensos os repasses para o fundo de investimentos até análise da Carteira do fundo que deve ser apresentada pelo banco, de forma a comprovar que os ativos do fundo não comprometem a qualidade do produto	COMIV	Após aprovação pela Diretoria
FATOS RELEVANTES 3.	Fundo BB PREV IX. Através de email, o Banco do Brasil informou que o fundo BB Previdenciário RF TP IX cumpriu sua carência e está disponível para resgate, sugerindo o fundo BB Previdenciário RF Alocação Ativa para direcionamento desse recurso. Sugestão: solicitar a baixa da aplicação, direcionando o saldo para o fundo apresentado pelo banco, haja vista que trata-se de produto com gestão ativa, que tem como objetivo superar o CDI no longo prazo, e a política permite ao gestor dinamismo na aplicação dos recursos do fundo, e que já tem Patrimônio Líquido superior a R\$ 8,5 bilhões.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	Após aprovação pela Diretoria

Quadro 51.

Nota: O Plano de Ação Mensal registra atividades a serem desenvolvidas no próximo período até reavaliação do Cenário econômico, com registro em Reunião Ordinária Mensal do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev e Aprovação da Diretoria.

As Estratégias de Alocação apresentadas estão aderentes à Política de Investimentos aprovada para o exercício, e os produtos de investimentos estão devidamente enquadrados aos termos da Legislação Vigente.

Relatório de Investimentos agosto de 2019

16. RELATÓRIO DE RISCO DOS ATIVOS

16.1 ACOMPANHAMENTO DOS RISCOS POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	VOL. ANUALIZADA (%)		VAR (95%)		DRAWDOWN		SHARPE
	MÊS	12 M	MÊS	12 M	MÊS	12 M	12 M
BB PREV RF IDKA 2	1,448%	1,574%	2,382%	2,633%	-0,396%	-0,673%	3,3549
BB PREVID IMA B 5+ TIT PUB RF	7,288%	7,828%	11,942%	13,001%	-3,068%	-4,199%	3,8867
BB PREVID RF IRFM 1 TP	0,380%	0,312%	0,648%	0,541%	-0,027%	-0,056%	2,8245
BB PREVID TIT PUB IX FI	0,012%	0,008%	0,042%	0,037%	0,000%	0,000%	33,2726
BB PREVID TIT PUB VII FI	1,139%	1,657%	1,878%	2,770%	-0,292%	-0,846%	3,2752
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	2,247%	2,450%	3,696%	4,087%	-0,667%	-1,087%	3,6491
BRADERCO FEDERAL EXTRA	0,008%	0,008%	0,036%	0,037%	0,000%	0,000%	21,8839
BRADERCO FI REFER DI PREMIUM	0,009%	0,012%	0,037%	0,044%	0,000%	0,000%	5,9106
BRADERCO FIC FIA INSTITUCIONAL	23,479%	20,501%	38,609%	33,857%	-7,389%	-8,043%	1,5211
BRADERCO INST. FIC FI RF IMA B5	2,168%	2,314%	3,562%	3,859%	-0,640%	-1,260%	3,3226
BRADERCO IRFM 1 TP	0,380%	0,301%	0,648%	0,524%	-0,027%	-0,027%	3,0251
BRADERCO MAXI PD PÚBLICO	0,008%	0,009%	0,036%	0,038%	0,000%	0,000%	37,4090
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	22,954%	19,441%	37,816%	32,151%	-6,485%	-9,618%	2,3346
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	8,391%	3,950%	13,696%	6,512%	-2,658%	-3,076%	0,6767
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	7,911%	5,591%	12,904%	9,250%	-3,542%	-5,252%	1,4173
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF	2,124%	2,230%	3,490%	3,720%	-0,617%	-1,175%	3,4101
CAIXA FI BRASIL IMA B5+	7,317%	7,714%	11,989%	12,814%	-3,081%	-4,166%	3,9164
CAIXA FI BRASIL IRFM 1	0,380%	0,301%	0,647%	0,524%	-0,027%	-0,055%	3,0773
CAIXA FIA CONSUMO	23,710%	19,730%	39,183%	32,612%	-6,937%	-12,449%	2,0082
CAIXA GESTÃO ESTRATEGICA	3,544%	3,622%	5,817%	6,019%	-1,170%	-2,733%	2,8078
FIC CAIXA CAPITAL PROTEGIDO	0,228%	1,022%	0,392%	1,710%	-0,009%	-0,737%	1,4111
ICATU DIVIDENDOS FIA	18,569%	16,750%	30,580%	27,729%	-5,527%	-6,993%	2,8419
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	1,995%	2,066%	3,283%	3,450%	-0,603%	-0,945%	3,7022
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	2,160%	2,273%	3,549%	3,792%	-0,634%	-1,160%	3,3769
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	7,351%	7,808%	12,044%	12,968%	-3,092%	-4,223%	3,9004
ITAU AÇÕES PHOENIX FIC FI	23,791%	20,431%	39,200%	33,764%	-0,265%	-10,289%	1,9297
ITAU DUNAMIS FIC	22,298%	19,479%	36,722%	32,197%	-6,702%	-9,594%	2,0242
ITAU FOF RPI AÇÕES	23,049%	19,279%	37,901%	31,842%	-7,274%	-9,880%	1,5598
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA RF FIC	1,102%	2,182%	1,824%	3,639%	-0,247%	-1,155%	3,1805
SAFRA CONSUMO AMERICANO	18,293%	16,013%	30,294%	26,394%	-3,343%	-18,759%	0,4363
SAFRA IMA INST. FI FIC RF	5,487%	5,682%	8,995%	9,437%	-2,134%	-3,333%	3,3840
SAFRA S&P REAIS PB MM	24,045%	15,385%	39,445%	25,328%	-6,493%	-16,777%	0,1202
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	23,367%	20,056%	38,456%	33,125%	-6,948%	-11,217%	1,5834
SANTANDER FIC FI IMA B	4,982%	5,238%	8,167%	8,710%	-1,976%	-2,731%	3,8698
SANTANDER FIC IMA-B 5 TIT PUB RF	2,100%	2,227%	3,450%	3,714%	-0,613%	-1,172%	3,4003
SANTANDER IBOVESPA AÇÕES	23,149%	20,569%	38,050%	33,952%	-7,998%	-9,762%	1,2602
CARTEIRA AMAZONPREV	6,3407%	7,4150%	10,5477%	12,2919%	10,5477%	-2,3022%	2,7556

Quadro 52.

Nota 1: VOLATILIDADE: Volatilidade é o nome que se dá ao Desvio Padrão dos retornos de um ativo. Dessa forma, a Volatilidade mede o quanto os retornos diários se afastam do retorno médio do período analisado. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio. Estima-se que os retornos diários da Carteira, em média, se afastam em 6,3407% do retorno diário médio dos últimos 12 meses. Como base para comparação, o IRF-M, que tende a ser menos volátil, apresentou um coeficiente de 2,66% no mesmo período. Já o IMA-B, que habitualmente manifesta alta volatilidade, ficou com 5,25% em 12 meses.

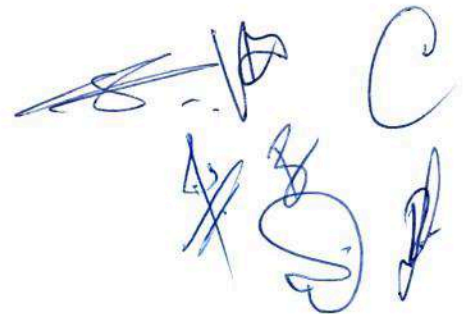
Nota 2: VALUE at RISK (95%): Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição normal. Dado o Desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma

Relatório de Investimentos agosto de 2019

perda de um dia para o outro, o prejuízo máximo será de 12,2919%. No mesmo período, o IRF-M detém um VaR de 4,38%, e o IMA-B de 8,63%.

Nota 3: DRAWDOWN: Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período. Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, conseqüentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado. Analisando os últimos 12 meses, percebe-se que a maior queda ocorrida na Carteira foi de 2,3022%. Já os índices IRFM e IMA-B sofreram quedas de 0,77% e 2,72%, respectivamente.

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

Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large signature on the left, a 'C' on the top right, and several smaller initials and scribbles below.

16.2 DETALHAMENTO POR FUNDO DE INVESTIMENTOS

FUNDOS DE INVESTIMENTOS	CNPJ	GESTOR	PROQUADRAMENTO	RISCOMARK	SALDO	PRAZO DE DURAÇÃO DO ATIVO	PRAZO DE RESGATE	LIQUIDZ	VOLATILIDADE ATRIBUÍDA PELO ADMINISTRADOR DO FUNDO	CONCEITO DA VOLATILIDADE REPRESENTADA	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO
BB PREV FID IMA 2	13.322.005/0001-35	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-IPCA 2A	872.012.884,98	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	1	RISCO MUITO BAIXO	1.000%
SANTANDER IBOVESPA INSTITUCIONAL AÇÕES (1)	01.699.688/0001-02	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	29.357.711,52	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	1	RISCO MUITO ALTO	0.750%
BB PREVID FID IRFIM 1 TP	11.328.882/0001-35	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IRF-M1	244.651.471,99	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	1	RISCO MUITO BAIXO	2.500%
BRADESCO FID REFER DI PREMIUM	03.399.411/0001-90	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	318.824.613,86	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	1	RISCO MUITO BAIXO	0.200%
BRADESCO FID MAXI PODER PUB	08.246.263/0001-97	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	4.485.405,06	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	1	RISCO MUITO BAIXO	0.200%
BRADESCO FID RENDA FIA REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	03.256.793/0001-00	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	CDI	651.100,18	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	1	RISCO MUITO BAIXO	0.150%
BRADESCO FID RENDA FIA IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	11.484.153/0001-06	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	IRF-M1	60.897.710,92	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	1	RISCO MUITO BAIXO	0.200%
NTM-B (15/08/2030)	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,48%	150.848.432,64	15/06/2030	D+1	LONGO PRAZO	1	RISCO MUITO BAIXO	0.000%
NTM-B (15/08/2030)	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,59%	154.717.791,36	15/08/2030	D+1	LONGO PRAZO	1	RISCO MUITO BAIXO	0.000%
NTM-B (15/08/2030)	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,96%	155.632.487,25	15/08/2030	D+1	LONGO PRAZO	1	RISCO MUITO BAIXO	0.000%
NTM-B (15/08/2040)	-	TESOURO NACIONAL	ART. 7.º, I, "a"	IPCA + 6,69%	158.082.208,67	15/08/2040	D+1	LONGO PRAZO	1	RISCO MUITO BAIXO	0.000%
BB PREVID TIT PUB IX FI	20.734.937/0001-06	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	9.313.380,68	INDETERMINADO	D+1	MÉDIO PRAZO	2	RISCO BAIXO	0.200%
BB PREVID TIT PUB VII FI	19.523.305/0001-06	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	19.155.286,57	INDETERMINADO	D+1	MÉDIO PRAZO	2	RISCO BAIXO	0.200%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA	10.922.432/0001-03	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B S	51.863.073,56	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	2	RISCO BAIXO	0.400%
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	10.746.670/0001-06	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	ART. 7.º, I, "b"	IRF-M1	290.281.232,28	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	2	RISCO BAIXO	0.200%
BRADESCO FID FID RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	28.515.874/0001-09	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	48.768.825,27	INDETERMINADO	D+2	CURTO PRAZO	2	RISCO BAIXO	0.400%
SAFRA S&P REALIS PB IMA	21.595.829/0001-54	SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA	ART. 8.º, III	CDI	11.814.372,96	INDETERMINADO	D+2	CURTO PRAZO	2	RISCO BAIXO	0.200%
BRADESCO FID RIMA BS	20.216.216/0001-04	BRAM - DTVM	ART. 7.º, IV, "a"	IMA-B S	90.074.421,34	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	3	RISCO MÉDIO	0.200%
CAIXA BR GESTÃO ESTRATÉGICA	23.215.097/0001-55	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	320.877.616,14	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	3	RISCO MÉDIO	1.600%
CAIXA FI BRASIL 2030 V TP RF	22.791.028/0001-27	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "a"	IMA-B	43.537.428,13	16/08/2030	-	MÉDIO PRAZO	3	RISCO MÉDIO	1.600%
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	22.791.074/0001-26	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	50.143.897,88	16/08/2024	-	LONGO PRAZO	3	RISCO MÉDIO	2.000%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL RF LP	14.504.578/0001-30	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	22.609.539,47	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	3	RISCO MÉDIO	0.200%
CAIXA FI BRASIL IMA BS TP RF	11.060.913/0001-10	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B S	753.883.552,10	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	3	RISCO MÉDIO	0.400%
CAIXA FI BRASIL IMA BS*	10.577.503/0001-88	CAIXA ECONÔMICA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B S*	83.628.726,76	INDETERMINADO	D+0	CURTO PRAZO	3	RISCO MÉDIO	0.250%
SANTANDER FID IMA-B 5 TP RF	13.455.117/0001-01	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B S	174.770.297,84	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	3	RISCO MÉDIO	0.250%
BTG ABSOLUTO FID FIA	11.977.794/0001-64	BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	60.266.171,90	INDETERMINADO	D+33	CURTO PRAZO	4	RISCO ALTO	3.000%
CAIXA FIA CONSUMO	10.577.512/0001-79	CAIXA ECONÔMICA	ART. 8.º, II, "a"	ICON	4.784.761,24	INDETERMINADO	D+3	CURTO PRAZO	4	RISCO ALTO	0,10% a 0,30%
FID CAIXA CAPITAL PROTEGIDO	14.386.860/0001-10	CAIXA ECONÔMICA	ART. 8.º, III	IBOVESPA	5.573.559,92	01/07/2030	-	CURTO PRAZO	4	RISCO ALTO	0.200%
ICATU DIVIDENDOS FIA	08.278.304/0001-41	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	148.955.066,54	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	4	RISCO ALTO	0.200%
ICATU INFLAÇÃO CRÉDITO PRIVADO	19.719.727/0001-51	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, VII, "a"	IMA-B S	12.347.039,66	INDETERMINADO	D+21	CURTO PRAZO	4	RISCO ALTO	0.200%
SAFRA CONSUMO AMERICANO FID EM AÇÕES BDR-NÍVEL I PB	19.436.818/0001-80	BANCO J. SAFRA S/A	ART. 8.º, III	BDR-1	5.766.180,26	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	4	RISCO ALTO	1.500%
Bradesco FID Ações Institucional IRIX Alpha	14.099.976/0001-78	BRAM - DTVM	ART. 8.º, I, "a"	IBOVESPA	20.142.367,31	INDETERMINADO	D+2	CURTO PRAZO	4	RISCO ALTO	0.900%
SAFRA IMA. INFLAÇÃO FID FID RENDA FIA	30.659.168/0001-74	BANCO J. SAFRA S/A	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B	61.332.426,84	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	4	RISCO ALTO	0.200%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA	10.756.541/0001-06	ICATU VANGUARDIA GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B S*	104.078.547,32	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	4	RISCO ALTO	0.200%
ITAU INSTIT ALOC DINÂMICA I	21.838.150/0001-49	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 7.º, IV, "a"	IPCA	313.073.799,42	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	4	RISCO ALTO	0.200%
BB PREVID TIT PUB IMA BS +	13.327.340/0001-73	BB DTVM	ART. 7.º, I, "b"	IMA-B S*	261.382.691,31	INDETERMINADO	D+1	CURTO PRAZO	5	RISCO MUITO ALTO	2.500%
ITAU AÇÕES PHOENIX FID FI	23.731.629/0001-07	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	76.310.454,70	INDETERMINADO	D+24	CURTO PRAZO	5	RISCO MUITO ALTO	1.900%
ITAU DUNAMIS FID FIA	24.571.992/0001-75	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	107.255.528,42	INDETERMINADO	D+24	CURTO PRAZO	5	RISCO MUITO ALTO	1.500%
ITAU FOF RPI AÇÕES	08.817.414/0001-10	ITAU UNIBANCO S/A	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	60.141.453,55	INDETERMINADO	D+5	CURTO PRAZO	5	RISCO MUITO ALTO	0.400%
SANTANDER AÇÕES TOP SELEÇÃO	02.436.763/0001-05	SANTANDER BRASIL GESTÃO DE RECURSOS LTDA	ART. 8.º, II, "a"	IBOVESPA	67.946.617,03	INDETERMINADO	D+4	CURTO PRAZO	5	RISCO MUITO ALTO	0.500%

Quadro 53.

Relatório de Investimentos agosto de 2019

VOLATILIDADE DA CARTEIRA COM BASE NA NOTA DE RISCO DO ADMINISTRADOR

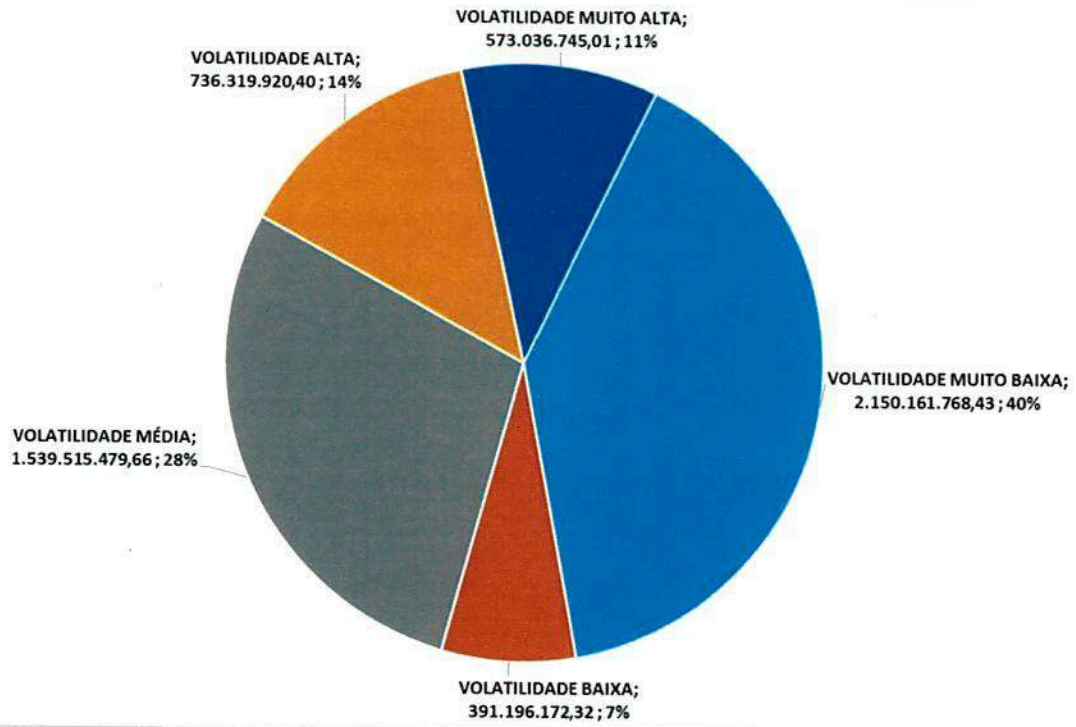


Gráfico 7.

Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large signature on the left and several smaller initials on the right.

Relatório de Investimentos agosto de 2019

17. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

ATUALIZADO EM 30.08.19				CRÉDITO INFLAÇÃO		
TABELA 1 - DURATION & YIELD POR CLASSE				TABELA 4 - SETOR		
Ativo	Duration	Spread	% PL	Setor	Financeiro	% PL
DEB	3,31	0,67%	41,8%	Bancos	75.866.145	16,7%
CRI	0,00	0,00%	0,0%	Elétrico	75.704.717	16,7%
LF	2,35	0,43%	15,7%	Saneamento	33.198.834	7,3%
CDB	1,35	0,26%	1,1%	Serviço	14.637.847	3,2%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%	Óleo e Gás	12.919.551	2,8%
NP	0,00	0,00%	0,0%	Shopping Center	11.559.775	2,5%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%	Varejo	10.431.763	2,3%
NTN-B	4,58	-	26,7%	Consumo	9.445.201	2,1%
Over	0,00	-	14,8%	Conc. Rodoviárias	5.800.121	1,3%
Carteira Crédito	3,02	0,60%	58,5%	Telecom	5.074.678	1,1%
Crédito - Contribuição Fundo	0,63	0,35%	58,5%	Infraestrutura	4.617.802	1,0%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	2,74	0,35%	100,0%	Holding	3.071.729	0,7%
				Logística	3.006.218	0,7%
				Over	188.091.690	41,5%
				Total	453.426.072	100,0%
TABELA 2 - RATING ICATU				TABELA 5 - EMISSOR		
Rating	Financeiro	% PL		Emissor	Financeiro	% PL
A+	20.487.705	4,5%		SANEPAR	15.642.215	3,4%
DPGE	0	0,0%		TAESA	15.080.425	3,3%
A	0	0,0%		RIO PARANAPANEMA ENERGIA	14.915.510	3,3%
A-	43.255.058	9,5%		Daycoval	12.345.058	2,7%
BBB+	65.075.012	14,4%		CEMIG D	12.020.203	2,7%
BBB	67.157.841	14,8%		LOCALIZA	11.006.784	2,4%
BBB-	35.183.282	7,8%		Banco FIDIS	10.608.836	2,3%
BB+	18.210.873	4,0%		LOJAS AMERICANAS	10.431.763	2,3%
BB	3.944.408	0,9%		NATURA	9.445.201	2,1%
BB-	12.020.203	2,7%		COPASA	9.040.682	2,0%
B+	0	0,0%		Bradesco	8.948.744	2,0%
B	0	0,0%		SABESP	8.515.937	1,9%
B-	0	0,0%		MULTIPLAN	7.427.783	1,6%
C	0	0,0%		COMGÁS	7.395.204	1,6%
Sem Limite	0	0,0%		Sofisa	6.778.598	1,5%
Tesouro / Over	188.091.690	41,5%		BNB	6.087.741	1,3%
Total	453.426.072	100,0%		Alfa	5.550.287	1,2%
				PETROBRAS	5.524.347	1,2%
				Safra	5.178.227	1,1%
				TELEFONICA BRASIL	5.074.678	1,1%
				Gerdau	4.617.802	1,0%
				Votorantim	4.151.572	0,9%
				COPEL	4.040.420	0,9%
				BBM	4.007.389	0,9%
				Dasa	3.631.063	0,8%
				CPFL GERAÇÃO	3.571.408	0,8%
				Celipa	3.309.065	0,7%
				Volkswagen	3.290.596	0,7%
				Eletropaulo	3.152.412	0,7%
				TERMOPERNAMBUCO	3.111.678	0,7%
				Itausa	3.071.729	0,7%
				AES TIETE	3.069.221	0,7%
				MRS LOGISTICA	3.006.218	0,7%
				ABC Brasil	2.877.231	0,6%
				ENEL RJ	2.830.916	0,6%
				ECORODOVIAS	2.624.396	0,6%
				ENEL CEARÁ	2.397.500	0,5%
				Itaú	2.379.492	0,5%
				ECOPISTAS	2.146.405	0,5%
				Banrisul	2.074.554	0,5%
				EDP SAO PAULO	1.881.095	0,4%
				BRMALLS	1.821.549	0,4%
				Industrial	1.587.822	0,4%
				EDP ESPIRITO SANTO	1.483.215	0,3%
				CPFL RGE	1.404.754	0,3%
				EQUATORIAL	1.397.845	0,3%
				CPFL Piratininga	1.206.320	0,3%
				CCR AUTOBAN	1.029.320	0,2%
				Allianse	994.211	0,2%
				IGUATEMI	978.353	0,2%
				COELBA	832.729	0,2%
				SONAE SIERRA	337.879	0,1%
				Over	188.091.690	41,5%
				Total	453.426.072	100,0%
TABELA 3 - RATING EXTERNO*						
Rating	Financeiro	% PL				
AAA	79.557.515	17,5%				
AA+	58.370.074	12,9%				
AA	60.712.613	13,4%				
AA-	15.919.795	3,5%				
A+	25.492.541	5,6%				
DPGE	0	0,0%				
A	2.074.554	0,5%				
A-	0	0,0%				
BBB+	11.187.087	2,5%				
BBB	0	0,0%				
BBB-	0	0,0%				
BB+	12.020.203	2,7%				
BB	0	0,0%				
BB-	0	0,0%				
B+	0	0,0%				
B	0	0,0%				
B-	0	0,0%				
CCC	0	0,0%				
CC	0	0,0%				
C	0	0,0%				
Sem Limite	0	0,0%				
Tesouro / Over	188.091.690	41,5%				
Total	453.426.072	100,0%				

Quadro 54.

Nota: Acompanhamento de Verificação de Lastro relativo ao Título ou papel incluídos em operações estruturadas adquiridas por meio de veículos de investimento.


PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 16 de setembro de 2019, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de agosto/2019, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

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

Todas as operações efetuadas foram analisadas pelo Controles Internos, e, posteriormente, aprovadas pela Diretoria dessa Fundação Amazonprev, e estão integralmente enquadradas aos limites estabelecidos pela Resolução CMN nº. 3.922/2010 e suas alterações.

Manaus – AM, 16 de agosto de 2019.


Alan Nascimento
Coordenador


Bruno Costa Novo
Secretário


Andreza de Souza Silva
Membro


Claudinei Soares
Membro


Leonardo Cavalcanti
Membro


Renizio Ferreira
Membro


Marcos Souza
Membro-ALE


Bruno Barroso
Membro-ALE

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - COFIS

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

APROVAÇÃO

REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho Fiscal: