

Relatório de Investimentos – janeiro/2024

Processo: 2024.A.01153

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: Relatório de Investimentos – janeiro/2024

Data: 15/01/2024

RELATÓRIO Nº. 004/2024/COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **janeiro/2024**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, **fornecido pela LDB CONSULTORIA**, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (**em anexo**);
- 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 03 a 09);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 10 a 12);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (páginas 13 a 15);
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (páginas 16 a 18);
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (páginas 19 a 22)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 23 a 25);
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (páginas 26 a 27);
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 28 a 29);
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 30);
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 31 a 38);
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 39);
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 40);
- 14) Parecer do Comitê de Investimentos (página 41).

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1. SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 200.003.445,34	R\$ 201.427.133,93	1,7852	1,4145	0,7118	3,9597%	0,7118%	10,9266%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 199.608.660,80	R\$ 200.217.245,70	1,7872	1,4385	0,6639	3,9369%	0,6639%	11,1792%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 99.148.829,82	R\$ 99.620.303,77	2,6000	1,6100	0,4800	4,7523%	0,4800%	15,8100%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 58.071.814,91	R\$ 58.713.030,57	0,7800	0,9200	1,1000	2,8260%	1,1000%	10,4300%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 115.087.811,33	R\$ 115.841.720,13	1,4349	1,2074	0,6551	3,3321%	0,6551%	13,1580%	
SAFRA SOBERANO REGIM PROP DI	R\$ 88.986.796,49	R\$ 89.832.918,56	0,8900	0,8800	0,9500	2,7447%	0,9500%	12,6700%	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 216.906,75	R\$ 211.199,33	0,8500	0,8400	0,9100	2,6226%	0,9100%	12,1600%	
ITAU SOBERANO SIMPLES	R\$ 53.760.809,24	R\$ 54.277.891,71	0,9000	0,8900	0,9600	2,7753%	0,9600%	12,7900%	
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 814.885.074,68	R\$ 820.141.443,70							
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 354.000.449,69	R\$ 360.420.835,49	0,9900	0,9400	1,0900	3,0504%	1,0900%	13,5800%	
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 12.064.705,75	R\$ 52.515.086,88	0,9667	0,9243	1,0031	2,9221%	1,0031%	13,2176%	
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 366.065.155,44	R\$ 412.935.922,37							
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 37.003.164,76	R\$ 37.482.862,31	1,2358	1,0262	1,2963	3,6005%	1,2963%	13,4700%	
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 101.376.703,29	R\$ 102.422.469,59	1,0600	0,9800	1,0300	3,1015%	1,0300%	13,7300%	
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 101.836.771,59	R\$ 103.226.266,43	1,1200	1,1100	1,3600	3,6329%	1,3600%	15,1600%	
PORTO SEGURO FI REFER DI CRED PRIV	R\$ 102.182.940,09	R\$ 103.328.980,12	1,1623	1,0518	1,1216	3,3729%	1,1216%	14,4358%	
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REF CP	R\$ 107.124.586,03	R\$ 108.189.470,82	0,9432	0,9248	0,9940	2,8894%	0,9940%	13,2000%	
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 135.706.819,91	R\$ 137.027.225,42	0,9600	0,9300	0,9700	2,8873%	0,9700%	13,4800%	
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 585.230.985,67	R\$ 591.677.274,69							
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.766.181.215,79	R\$ 1.824.754.640,76							

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 (aplicação e resgate) no período.

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião do COMIV nº. 206/2023, devidamente autorizadas pela Diretoria, através do Despacho de 27/12/2023, constante do processo nº 2023.A.11914: Item 3.1. FPREV Executivo: a)

Recursos Novos: Aplicar no Fundo BRADESCO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90). A opção por esse produto justifica-se pela estratégia adotada pelo Comitê no controle do risco de concentração para os fundos nesse segmento, além dos limites estabelecidos pela legislação. Também foram analisadas o risco/retorno, histórico, consistência, correlação ao CDI e demais bases para validação da escolha do produto. Registra-se que o referido fundo está rendendo 104% do CDI no ano corrente e sua rentabilidade é superior aos seus pares comparáveis b) **Recursos Atuais:** Zerar o Fundo ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC (24.571.992/0001-75), destinando os recursos para o Fundo ITAÚ SOBERANO RF SIMPLES LP FICFI (06.175.696/0001-73); Zerar o Fundo TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC FIA (36.671.926/0001-56), destinando os recursos para o Fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90); Resgatar R\$ 30 milhões do Fundo AZ QUEST SMALL MID CAPS RPPS FIC DE FIA (34.791.108/0001-61), destinando os recursos para o Fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90); Resgatar R\$ 30 milhões do Fundo BB AÇÕES VALOR FIC FIA (29.258.294/0001-38), destinando os recursos para o Fundo CAIXA FI BRASIL REF DI LP (03.737.206/0001-97) e Resgatar R\$ 40 milhões do Fundo ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA (38.027.169/0001-08) destinando os recurso para o Fundo CAIXA FI BRASIL REF DI LP (03.737.206/0001-97). Destaca-se que os referidos fundos se encontram com variação de cota positiva.



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 93.369.983,99	R\$ 87.621.334,17	8,0663	9,8471	(9,1546)	7,8405%	-9,1546%	39,0871%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 83.678.439,03	R\$ 82.431.941,66	13,1474	2,6900	(1,4896)	14,4603%	-1,4896%	39,7700%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 114.636.052,12	R\$ 109.401.689,32	12,1024	6,0376	(4,5660)	13,4431%	-4,5660%	7,7502%
FUNDOS RENDA VARIÁVEL- AÇÕES VALOR	R\$ 291.684.475,14	R\$ 279.454.965,15						
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 38.017.106,21	R\$ 35.805.109,67	12,2300	5,3000	(5,8200)	11,3002%	-5,8200%	18,8400%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 47.882.818,57	R\$ 46.241.199,42	10,2500	6,5000	(3,4300)	13,3889%	-3,4300%	11,2300%
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 115.441.916,75	R\$ 110.925.393,16	12,8200	5,2500	(3,9100)	14,1002%	-3,9100%	15,2600%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 41.783.111,29	R\$ 39.808.824,84	11,6121	5,9200	(4,2100)	13,2425%	-4,2100%	10,3205%
OCCAM FIC FIA	R\$ 103.990.021,42	R\$ 100.045.798,56	10,6500	4,8900	(3,8600)	11,5808%	-3,8600%	8,2900%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 57.931.366,07	R\$ -	13,2000	7,3500	-	21,5202%	0,0000%	6,2800%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 59.191.641,58	R\$ 55.367.036,46	11,4773	5,2198	(0,6461)	16,5383%	-0,6461%	6,5044%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT	R\$ 15.725.118,81	R\$ 15.295.739,88	13,7910	6,6564	(2,7305)	18,0515%	-2,7305%	20,4325%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 16.413.871,65	R\$ 15.887.622,41	11,2800	5,3500	(3,2100)	13,4703%	-3,2100%	7,4200%
FUNDOS RENDA VARIÁVEL- AÇÕES VALOR	R\$ 496.376.972,35	R\$ 419.376.724,40						
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 94.251.309,53	R\$ 90.236.875,29	9,1300	5,8000	(4,2600)	10,5410%	-4,2600%	8,0100%
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.546.807,14	R\$ 5.163.718,92	1,4000	4,7700	(6,9100)	-1,1042%	-6,9100%	3,2500%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 78.180.715,30	R\$ 35.623.426,32	14,7200	5,0100	(4,5900)	14,9380%	-4,5900%	9,3300%
FUNDOS RENDA VARIÁVEL- DIVIDENDOS	R\$ 177.978.831,97	R\$ 131.024.020,53						
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 80.436.363,26	R\$ 47.888.512,37	10,4500	4,6100	(3,0800)	11,9831%	-3,0800%	7,9600%
BRANDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 116.200.396,89	R\$ 108.201.486,58	12,9400	5,7600	(6,8800)	11,2275%	-6,8800%	-6,7500%
ITAÚ SMALL CAPS VALUATION	R\$ 79.576.991,78	R\$ 74.990.503,97	11,7800	7,4500	(5,7600)	13,1894%	-5,7600%	6,0100%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 45.972.580,68	R\$ 42.384.024,06	0,4000	4,5800	(7,8100)	-3,2020%	-7,8100%	-1,0300%
FUNDOS RENDA VARIÁVEL- SMALL CAPS	R\$ 322.186.332,61	R\$ 273.464.526,98						
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 21.251.092,63	R\$ 20.265.961,71	12,4202	4,9712	(4,6357)	12,5383%	-4,6357%	6,3593%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 213.963.481,83	R\$ 206.755.865,77	11,9400	4,8300	(3,3600)	13,4039%	-3,3600%	6,9400%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 235.214.574,46	R\$ 227.021.827,48						
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.523.441.186,53	R\$ 1.330.342.064,54						

Quadro 2.

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 (aplicação e resgate) no período.

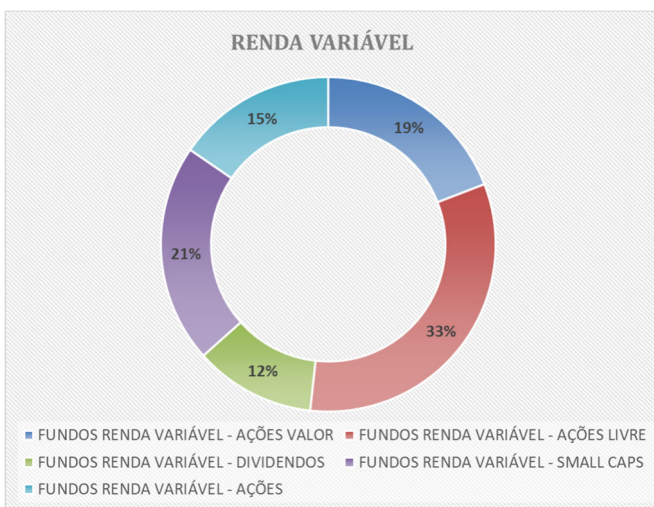


Gráfico 1. Estratégia de Alocação em Fundos de Ações – FPREV Executivo.



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.452.022,68	R\$ 36.091.694,97	5,2415	2,0924	4,7593	12,5571%	4,7593%	11,6200%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 17.415.583,10	R\$ 16.674.886,24	14,6455	11,6508	(4,2531)	22,5586%	-4,2531%	16,6000%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 48.984.837,96	R\$ 50.495.858,96	6,5331	4,0285	3,0847	14,2434%	3,0847%	13,4700%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 28.057.896,57	R\$ 28.841.750,67	8,8000	4,0800	2,7900	16,3984%	2,7900%	13,1200%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exte	R\$ 128.910.340,31	R\$ 132.104.190,84	0,0000%					
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 66.754.995,87	R\$ 69.651.261,97	6,1126	3,0329	4,3386	14,0743%	4,3386%	20,5092%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 30.309.712,28	R\$ 31.138.408,20	6,2400	2,5100	2,7300	11,8798%	2,7300%	17,6100%
ITAU BDR NIVEL I AÇÕES FIC	R\$ 33.792.094,90	R\$ 35.469.946,88	5,3100	2,0600	4,9700	12,8211%	4,9700%	15,2000%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nivel I	R\$ 130.856.803,05	R\$ 136.259.617,05						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 259.767.143,36	R\$ 268.363.807,89						

Quadro 3.

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 (aplicação e resgate) no período.

2.4 SALDOS E PERFORMANCE – FUNDOS ESTRUTURADOS

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 20.040.508,45	R\$ 20.385.759,37	9,3400	5,2300	1,7200	17,0375%	1,7200%	27,9200%
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV FIM	R\$ 17.994.039,86	R\$ 17.929.540,43	7,5103	5,2765	(0,3584)	12,7774%	-0,3584%	14,5712%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 21.430.206,35	R\$ 20.928.907,15	8,4318	3,2638	(2,3392)	9,3516%	-2,3392%	20,6134%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MM	R\$ 17.729.236,91	R\$ 16.869.963,12	6,5200	4,4900	(4,8500)	5,9046%	-4,8500%	8,2700%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 34.449.505,52	R\$ 34.851.930,68	2,6400	1,0000	1,1700	4,8793%	1,1700%	14,9100%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MM	R\$ 11.733.921,62	R\$ 11.385.597,75	6,9500	3,5300	(2,9700)	7,4368%	-2,9700%	10,4300%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 123.377.418,71	R\$ 122.351.698,50						
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.751.339,99	R\$ 40.677.422,01	(0,1700)	(0,1700)	(0,1800)	-0,5191%	-0,1800%	16,2100%
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 22.704.603,77	R\$ 22.652.862,93	(0,1900)	(0,1900)	(0,2300)	-0,6088%	-0,2300%	8,6000%
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA R II FIP MULT	R\$ 6.257.563,28	R\$ 6.103.529,00	(2,1200)	(3,1900)	(2,4600)	-7,5734%	-2,4600%	-18,7000%
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 2.110.461,07	R\$ 2.097.466,70	(4,5200)	4,4900	(0,6200)	-0,8515%	-0,6200%	-6,0900%
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 26.962.579,28	R\$ 26.743.224,16	(0,6791)	(0,5067)	(0,8136)	-1,9863%	-0,8136%	-5,8630%
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP	R\$ -	R\$ 149.614,50	-	-	(79,0600)	-79,0600%	-79,0600%	NC
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R\$ 29.971.356,30	R\$ 29.538.603,28	(0,5300)	1,0100	(1,4439)	-0,9761%	-1,4439%	NC
TOTAL art. 10º, inciso II	R\$ 128.757.903,69	R\$ 127.962.722,58						
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 252.135.322,40	R\$ 250.314.421,08						

Quadro 4.

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 (aplicação e resgate) no período.

Nota 2: Em 08/01/2024 foi formalizada a primeira chamada de capital do Pátria Infraestrutura V Advisory FIP-M (em conjunto com os demais veículos investidores, “Fundo”, ou “Fundo V”) para realização de investimentos na Plataforma de Mobilidade Elétrica, e para o pagamento de encargos relativos aos prestadores de serviços essenciais do Fundo.

Dessa forma, nesta data, foram contabilizados e apropriados no Fundo os referidos encargos e as despesas, que se referem principalmente às taxas de administração e gestão. Considerando-se que o Fundo se encontra em início do período de investimento, é natural que os encargos e despesas relacionados aos prestadores de serviços essenciais e à constituição do Fundo sejam percentualmente maiores do que os investimentos realizados até o momento, ocasionando, conseqüentemente, um momentâneo impacto negativo na cota. Ressalta-se que, com as próximas chamadas de capital, este valor será diluído e tende a representar percentual menos expressivo, sem impacto material aos cotistas. Este fenômeno é comum e conhecido no mercado como “Curva-J” em que os retornos iniciais são menores e/ou negativos em fundos de private equity no estágio



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

inicial (sobre um capital investido pequeno) e tendem a migrar para a média de longo prazo ao longo do tempo, a medida em que o capital é integralizado.

2.5 CONTROLE DE EVOLUÇÃO DOS FIP's – FUNDO DE INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÕES

APORTES/FUNDOS	VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP	KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP	BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP	Pátria PE VII Advisory FIP Multi - Classe C	Pátria Infraestrutura V Advsoy	TOTAL DE RECURSOS
1ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 268.453,31	R\$ 2.875.000,00	R\$ 5.671.011,85	R\$ 5.840.901,39	R\$ 9.515.813,90	R\$ -	R\$ 23.416.702,50	R\$ 714.406,80	R\$ 48.302.289,75
2ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 334.844,05	R\$ 9.278.448,35	R\$ 2.063.666,86	R\$ 1.666.666,72	R\$ 1.702.633,54	R\$ -	R\$ 8.250.000,00	R\$ -	R\$ 23.296.259,52
3ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 264.358,56	R\$ 6.329.310,18	R\$ 3.331.898,77	R\$ -	R\$ 690.979,79	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 10.616.547,30
4ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 87.385,16	R\$ 1.013.353,25	R\$ 1.325.970,49	R\$ -	R\$ 6.779.214,99	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 9.205.923,89
5ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 117.214,27	R\$ 8.673.587,50	R\$ 1.579.015,44	R\$ -	R\$ 1.635.358,51	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 12.005.175,72
6ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 139.146,78	R\$ 4.983.567,55	R\$ 6.028.436,59	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 11.151.150,92
7ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 153.285,87	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 153.285,87
8ª CHAMADA DE CAPITAL	R\$ 669.283,52	R\$ -	FINALIZADO	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ 669.283,52
TOTAL INTEGRALIZADO	R\$ 2.033.971,52	R\$ 33.153.266,83	R\$ 20.000.000,00	R\$ 7.507.568,11	R\$ 20.324.000,73	R\$ -	R\$ 31.666.702,50	R\$ 714.406,80	R\$ 115.399.916,49
TOTAL SUBSCRITO	R\$ 25.000.000,00	R\$ 150.000.000,00	R\$ 20.000.000,00	R\$ 100.000.000,00	R\$ 50.000.000,00	R\$ 100.000.000,00	R\$ 150.000.000,00	R\$ 50.000.000,00	R\$ 645.000.000,00
TOTAL BASE JAN/2024	R\$ 2.097.466,70	R\$ 26.743.224,16	R\$ 40.677.422,01	R\$ 6.103.529,00	R\$ 22.652.862,93	R\$ -	R\$ 29.538.603,28	R\$ 149.614,50	R\$ 127.962.722,58
ATA/PARECER-COMIV	182/2021 ; Item 5.2	182/2021 ; Item 5.1	Parecer nº 2251/2020	187/2022 ; Item 6.1	Parecer nº 899/2021	Ata nº 198/2023 e Parecer nº 074/2023	Ata nº 198/2023 e Parecer nº 074/2023	Ata nº 205/2023	
PROCESSO SISPREV	2022.A.00051	2022.A.00051	2021.A.22978	2022.A.03010	2021.A.21245	2023.A.03295	2023.A.03295	2023.A.11091	
DESPACHO DIRETORIA	07.01.2022	07.01.2022	04.09.2020	25.05.2022	18.05.2021	10.05.2023	10.05.2023	27.11.2023	
PERÍODO INVEST/DESINVEST	4/6		3/4	4/4	3/4	5/5	6/4	6/4	
RETORNO PREVISTO	IPCA + 16% a.a.		IPCA + 20% a.a.	IPCA + 20% a.a.	20% Bruto a.a.	IPCA + 15% a.a.	35% bruto a.a.	IPCA + 21% bruto a.a.	
ADMINISTRADOR	BTG PACTUAL	INTRAG DTVM	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	XP INVEST	XP INVEST	
GESTOR	VINCI PARTNERS	KINEA	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	PATRIA INVEST	PATRIA INVEST	
TOTAL A INTEGRALIZAR (R\$)	R\$ 22.966.028,48	R\$ 116.846.733,17	R\$ -	R\$ 92.492.431,89	R\$ 29.675.999,27	R\$ 100.000.000,00	R\$ 118.333.297,50	R\$ 49.285.593,20	R\$ 529.600.083,51
TOTAL A INTEGRALIZAR (%)	91,86%	77,90%	0,00%	92,49%	59,35%	100,00%	78,89%	98,57%	82,11%

NOTA 1: Total subscrito refere-se ao valor Comprometido e aprovado pela diretoria para ser aplicado no fundo, no entanto, não significa que os recursos serão utilizados na sua totalidade.

Quadro 5.

2.6 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	nov/23	dez/23	jan/24
BRADESCO	R\$ 578.415.935,91	R\$ 470.417.753,33	R\$ 468.833.521,40
BTG	R\$ 393.897.901,95	R\$ 405.554.268,91	R\$ 399.801.705,51
ITAÚ	R\$ 412.387.426,87	R\$ 425.586.795,10	R\$ 366.781.115,92
BANCO DO BRASIL	R\$ 426.363.756,19	R\$ 440.586.134,91	R\$ 435.847.121,68
CAIXA	R\$ 432.577.823,86	R\$ 439.982.357,81	R\$ 481.441.270,74
ICATU	R\$ 89.086.470,60	R\$ 94.251.309,53	R\$ 90.236.875,29
SANTANDER	R\$ 83.715.199,59	R\$ 85.988.002,72	R\$ 87.978.721,27
PORTO	R\$ 101.119.346,20	R\$ 102.182.940,09	R\$ 103.328.980,12
VINCI	R\$ 151.319.944,50	R\$ 159.335.489,11	R\$ 152.831.684,70
SAFRA	R\$ 252.234.677,17	R\$ 255.003.328,68	R\$ 257.998.552,18
OCCAM	R\$ 99.141.620,32	R\$ 103.990.021,42	R\$ 100.045.798,56
BNP	R\$ 106.142.933,26	R\$ 107.124.586,03	R\$ 108.189.470,82
AZ QUEST	R\$ 76.891.828,01	R\$ 80.436.363,26	R\$ 47.888.512,37
RIO BRAVO	R\$ 62.410.388,73	R\$ 63.912.664,05	R\$ 63.107.491,55
ARX	R\$ 74.448.437,62	R\$ 78.180.715,30	R\$ 35.623.426,32
TARPON	R\$ 84.999.915,13	R\$ 93.369.983,99	R\$ 87.621.334,17
GUEPARDO	R\$ 81.486.424,45	R\$ 83.678.439,03	R\$ 82.431.941,66
TRÍGONO	R\$ 49.252.221,81	R\$ 51.519.387,82	R\$ 47.547.742,98
GENIAL/PLURAL	R\$ 49.344.161,26	R\$ 51.867.605,78	R\$ 52.766.581,21
CONSTANCIA	R\$ 44.962.035,17	R\$ 47.882.818,57	R\$ 46.241.199,42
BRASIL CAPITAL	R\$ 36.104.245,62	R\$ 38.017.106,21	R\$ 35.805.109,67
SCHRODER	R\$ 26.958.138,54	R\$ 28.057.896,57	R\$ 28.841.750,67
DAYCOVAL	R\$ 20.244.685,51	R\$ 21.251.092,63	R\$ 20.265.961,71
INTRAG/KINEA	R\$ 27.099.885,01	R\$ 26.962.579,28	R\$ 26.743.224,16
CLARITAS	R\$ 15.579.899,24	R\$ 16.413.871,65	R\$ 15.887.622,41
XP/PATRIA	R\$ 29.672.216,29	R\$ 29.971.356,30	R\$ 29.688.217,78
TOTAL	R\$ 3.805.857.518,81	R\$ 3.801.524.868,08	R\$ 3.673.774.934,27

Quadro 6

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQZ



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

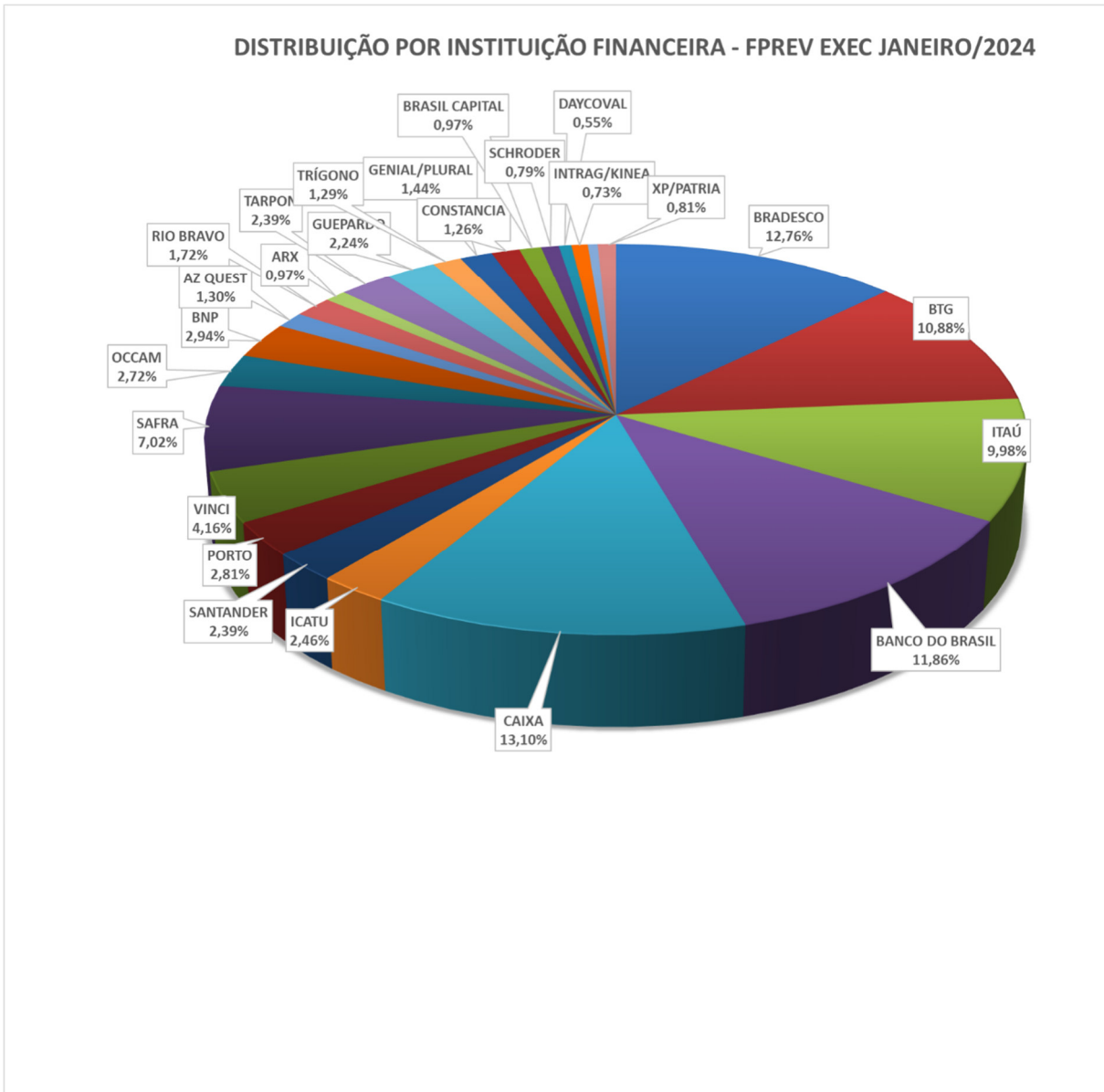


Gráfico 2

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

2.7 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

Ativo	Compra	Vencimento	Taxa	PU de Compra	QTD	Valor Aplicado	PU Atual	Valor Líquido
NTN-B - AGO/2030	15/01/2014	15/08/2030	IPC-A +6,60%	2.230,820000	42.857	R\$ 95.606.285,78	4.198,581838	R\$ 179.938.621,83
NTN-B - AGO/2040	15/01/2014	15/08/2040	IPC-A +6,60%	2.196,620000	44.350	R\$ 97.420.337,06	4.086,564554	R\$ 181.239.137,97
NTN-B - AGO/2030	29/01/2014	15/08/2030	IPC-A +6,90%	2.172,470000	44.706	R\$ 97.122.602,48	4.136,370100	R\$ 184.920.561,69
NTN-B - AGO/2024	26/05/2022	15/08/2024	IPC-A +5,91%	3.970,870000	8.177	R\$ 32.469.836,01	4.320,348346	R\$ 35.327.488,43
NTN-B - MAI/2025	26/05/2022	15/05/2025	IPC-A +5,77%	3.987,810000	8.259	R\$ 32.935.402,78	4.270,109782	R\$ 35.266.836,69
NTN-B - AGO/2032	26/05/2022	15/08/2032	IPC-A +5,76%	4.037,020000	8.046	R\$ 32.481.874,79	4.392,246247	R\$ 35.340.013,30
NTN-B - AGO/2024	27/05/2022	15/08/2024	IPC-A +5,85%	3.976,900000	24.738	R\$ 98.380.719,23	4.321,697851	R\$ 106.910.161,44
NTN-B - AGO/2024	30/05/2022	15/08/2024	IPC-A +5,83%	3.979,050000	24.719	R\$ 98.358.348,17	4.322,000543	R\$ 106.835.531,42
NTN-B - AGO/2024	31/05/2022	15/08/2024	IPC-A +6,02%	3.965,220000	24.798	R\$ 98.329.761,28	4.317,952030	R\$ 107.076.574,44
NTN-B - AGO/2024	31/05/2022	15/08/2024	IPC-A +6,04%	3.964,050000	15.000	R\$ 59.460.779,31	4.317,628317	R\$ 64.764.424,76
NTN-B - MAI/2035	07/07/2022	15/05/2035	IPC-A +6,03%	3.988,810000	12.427	R\$ 49.569.052,03	4.258,414076	R\$ 52.919.311,72
NTN-B - AGO/2040	07/07/2022	15/08/2040	IPC-A +6,04%	3.985,550000	12.262	R\$ 48.870.893,91	4.317,313012	R\$ 52.938.892,15
NTN-B - AGO/2024	18/11/2022	15/08/2024	IPC-A +6,70%	3.928,690000	25.070	R\$ 98.492.411,10	4.303,477437	R\$ 107.888.179,35
NTN-B - AGO/2024	24/11/2022	15/08/2024	IPC-A +7,01%	3.913,540000	25.142	R\$ 98.394.451,49	4.296,923302	R\$ 108.033.245,66
LTN - JAN/2025	24/11/2022	01/01/2025	+14,08%	758,010000	13.200	R\$ 10.005.811,96	885,790309	R\$ 11.692.432,08
NTN-B - AGO/2028	24/11/2022	15/08/2028	IPC-A +6,31%	3.920,110000	11.295	R\$ 44.277.685,33	4.273,246014	R\$ 48.266.313,73
NTN-B - AGO/2032	24/11/2022	15/08/2032	IPC-A +6,31%	3.892,070000	11.375	R\$ 44.272.350,37	4.244,149687	R\$ 48.277.202,69
NTN-B - AGO/2032	15/12/2022	15/08/2032	IPC-A +6,44%	3.869,500000	7.600	R\$ 29.408.241,99	4.211,425253	R\$ 32.006.831,92
NTN-B - AGO/2026	20/12/2022	15/08/2026	IPC-A +6,58%	3.916,740000	10.956	R\$ 42.911.901,02	4.264,383847	R\$ 46.720.589,43
NTN-B - MAI/2025	03/01/2023	15/05/2025	IPC-A +6,33%	3.966,330000	12.492	R\$ 49.547.513,81	4.242,329327	R\$ 52.995.177,95
NTN-B - AGO/2026	04/01/2023	15/08/2026	IPC-A +6,37%	3.860,260000	12.368	R\$ 47.743.782,08	4.284,285886	R\$ 52.988.047,84
NTN-B - AGO/2032	02/02/2023	15/08/2032	IPC-A +6,32%	3.939,370000	12.345	R\$ 48.631.638,52	4.240,731783	R\$ 52.351.833,86
NTN-B - MAI/2033	02/02/2023	15/05/2033	IPC-A +6,39%	3.910,270000	12.602	R\$ 49.277.257,97	4.155,641529	R\$ 52.369.394,55
NTN-B - AGO/2040	07/02/2023	15/08/2040	IPC-A +6,50%	3.831,760000	25.346	R\$ 97.119.873,06	4.126,494754	R\$ 104.590.136,03
NTN-B - AGO/2040	10/02/2023	15/08/2040	IPC-A +6,39%	3.876,310000	12.522	R\$ 48.539.211,05	4.169,409838	R\$ 52.209.349,99
NTN-B - AGO/2040	10/02/2023	15/08/2040	IPC-A +6,40%	3.873,120000	12.533	R\$ 48.541.867,90	4.166,176913	R\$ 52.214.695,25
NTN-B - MAI/2035	13/02/2023	15/05/2035	IPC-A +6,38%	3.906,200000	12.592	R\$ 49.186.986,64	4.144,597453	R\$ 52.188.771,13
NTN-B - MAI/2033	27/02/2023	15/05/2033	IPC-A +6,29%	3.957,620000	12.408	R\$ 49.106.218,74	4.183,304270	R\$ 51.906.439,38
NTN-B - AGO/2040	27/02/2023	15/08/2040	IPC-A +6,38%	3.891,500000	12.819	R\$ 49.885.178,13	4.174,261328	R\$ 53.509.855,96
NTN-B - AGO/2040	28/02/2023	15/08/2040	IPC-A +6,35%	3.904,680000	11.496	R\$ 44.888.278,72	4.186,427889	R\$ 48.127.175,01
NTN-B - AGO/2040	01/03/2023	15/08/2040	IPC-A +6,45%	3.865,920000	12.897	R\$ 49.858.856,39	4.145,665285	R\$ 53.466.645,18
NTN-B - AGO/2040	03/03/2023	15/08/2040	IPC-A +6,48%	3.857,300000	8.599	R\$ 33.168.964,23	4.133,666887	R\$ 35.545.401,56
NTN-B - AGO/2040	28/03/2023	15/08/2040	IPC-A +6,19%	4.003,380000	19.937	R\$ 79.815.545,35	4.252,187857	R\$ 84.775.869,31
NTN-B - MAI/2035	29/03/2023	15/05/2035	IPC-A +6,12%	4.040,930000	3.629	R\$ 14.664.551,91	4.227,766450	R\$ 15.342.564,45
NTN-B - AGO/2040	29/03/2023	15/08/2040	IPC-A +6,21%	3.995,230000	6.210	R\$ 24.810.405,46	4.242,644632	R\$ 26.346.823,16
NTN-B - MAI/2035	30/03/2023	15/05/2035	IPC-A +6,11%	4.046,720000	6.038	R\$ 24.434.144,24	4.232,033575	R\$ 25.553.018,73
NTN-B - AGO/2040	30/03/2023	15/08/2040	IPC-A +6,17%	4.016,530000	3.707	R\$ 14.889.278,69	4.262,597120	R\$ 15.801.447,52
NTN-B - MAI/2035	31/03/2023	15/05/2035	IPC-A +6,13%	4.040,470000	2.437	R\$ 9.846.632,56	4.224,491484	R\$ 10.295.085,75
NTN-B - AGO/2040	31/03/2023	15/08/2040	IPC-A +6,21%	4.003,320000	4.956	R\$ 19.840.472,25	4.243,889035	R\$ 21.032.714,06
NTN-B - MAI/2045	20/04/2023	15/05/2045	IPC-A +6,11%	4.051,720000	19.235	R\$ 77.934.981,74	4.221,166070	R\$ 81.194.129,36
NTN-B - MAI/2045	24/04/2023	15/05/2045	IPC-A +6,10%	4.056,340000	4.800	R\$ 19.470.472,13	4.224,592382	R\$ 20.278.043,43
NTN-B - AGO/2024	15/05/2023	15/08/2024	IPC-A +6,99%	4.071,730000	15.976	R\$ 65.050.072,22	4.297,343708	R\$ 68.654.363,08
NTN-B - AGO/2024	15/05/2023	15/08/2024	IPC-A +6,99%	4.071,740000	3.429	R\$ 13.962.028,95	4.297,347912	R\$ 14.735.605,99
NTN-B - MAI/2025	18/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,05%	4.120,040000	20.513	R\$ 84.514.556,69	4.256,030372	R\$ 87.303.951,02
NTN-B - MAI/2025	19/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,22%	4.109,010000	18.665	R\$ 76.694.808,58	4.248,009018	R\$ 79.289.088,32
NTN-B - MAI/2025	24/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,28%	4.107,220000	4.300	R\$ 17.661.056,14	4.244,944255	R\$ 18.253.260,30
NTN-B - MAI/2025	04/12/2023	15/05/2025	IPC-A +5,87%	4.188,480000	23.875	R\$ 100.000.154,79	4.265,022865	R\$ 101.827.420,90
NTN-B - MAI/2025	06/12/2023	15/05/2025	IPC-A +5,85%	4.192,730000	23.850	R\$ 99.996.815,32	4.266,069677	R\$ 101.745.761,80
TOTAL								R\$ 3.033.254.421,57

Quadro 7.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos (anexos).



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	29/12/2023	31/01/2024
CVS - A	R\$ 650.739,46	R\$ 633.215,99
CVS - B	R\$ 4.210.481,35	R\$ 4.097.160,50
CVS - C	R\$ 84.415,24	R\$ 82.142,06
CVS - D	R\$ 461.735,34	R\$ 449.308,20
TOTAL	R\$ 5.407.371,39	R\$ 5.261.826,75

Quadro 8.

Nota: Os Títulos CVS realizam amortização mensal dos Juros e antecipação de parte do Principal (quadro a seguir), justificando a redução mensal dos valores em carteira.

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
fev/23	R\$ 20.137,49	R\$ 147.891,88	R\$ 168.029,37
mar/23	R\$ 19.756,14	R\$ 148.193,21	R\$ 167.949,35
abr/23	R\$ 19.342,87	R\$ 148.335,95	R\$ 167.678,82
mai/23	R\$ 18.953,86	R\$ 148.637,28	R\$ 167.591,14
jun/23	R\$ 18.556,69	R\$ 148.922,76	R\$ 167.479,45
jul/23	R\$ 18.154,01	R\$ 149.208,24	R\$ 167.362,25
ago/23	R\$ 17.760,31	R\$ 149.509,57	R\$ 167.269,88
set/23	R\$ 17.347,06	R\$ 149.652,31	R\$ 166.999,37
out/23	R\$ 16.931,61	R\$ 149.795,05	R\$ 166.726,66
nov/23	R\$ 16.510,66	R\$ 149.937,79	R\$ 166.448,45
dez/23	R\$ 16.087,63	R\$ 150.080,53	R\$ 166.168,16
jan/24	R\$ 15.666,77	R\$ 150.239,12	R\$ 165.905,89
TOTAL	R\$ 235.753,73	R\$ 1.938.152,83	R\$ 2.173.906,56

Quadro 9.

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2024			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/24	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 349.085,76	R\$ 602.186,33	R\$ 951.272,09

Quadro 10.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	29/12/2023	31/01/2024	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.801.524.868,08	R\$ 3.673.774.934,27	53,9251%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 3.000.819.006,40	R\$ 3.033.254.421,56	44,5233%
TÍTULOS CVS	R\$ 5.407.371,39	R\$ 5.261.826,75	0,0772%
IMÓVEIS	R\$ 69.752.789,32	R\$ 69.752.789,32	1,0239%
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -	0,0000%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 30.696.171,47	0,4506%
TOTAL	R\$ 6.877.504.035,19	R\$ 6.812.740.143,37	100,00%

Quadro 11.

Nota: Os valores para os Títulos Públicos são atualizados com base em Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
fev/23	R\$ 5.742.296.217,39	-0,51%	-0,66%	10,78%
mar/23	R\$ 5.791.959.003,03	0,86%	0,20%	8,86%
abr/23	R\$ 5.880.428.580,01	1,53%	1,73%	12,49%
mai/23	R\$ 6.042.794.420,25	2,76%	4,54%	14,26%
jun/23	R\$ 6.221.758.620,80	2,96%	7,64%	19,64%
jul/23	R\$ 6.349.177.301,02	2,05%	9,84%	18,78%
ago/23	R\$ 6.350.604.433,59	0,02%	9,87%	15,88%
set/23	R\$ 6.414.928.360,40	1,01%	10,98%	16,39%
out/23	R\$ 6.401.119.777,67	-0,22%	10,91%	12,19%
nov/23	R\$ 6.649.507.551,15	3,88%	15,21%	15,04%
dez/23	R\$ 6.877.504.035,19	3,88%	19,16%	19,16%
jan/24	R\$ 6.778.801.584,73	-1,44%	-1,44%	18,05%

Quadro 12.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 01/2023		R\$ 5.771.604.745,47	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2023	R\$ 48.396.223,00	R\$ 19.336.309,60	R\$ 29.059.913,40
03/2023	R\$ 47.844.489,27	R\$ 13.501.061,49	R\$ 34.343.427,78
04/2023	R\$ 48.529.359,82	R\$ 12.897.196,53	R\$ 35.632.163,29
05/2023	R\$ 49.523.530,80	R\$ 17.943.389,07	R\$ 31.580.141,73
06/2023	R\$ 48.501.155,60	R\$ 14.660.037,39	R\$ 33.841.118,21
07/2023	R\$ 54.934.340,93	R\$ 13.180.680,80	R\$ 41.753.660,13
08/2023	R\$ 51.193.351,70	R\$ 14.114.289,57	R\$ 37.079.062,13
09/2023	R\$ 51.455.681,82	R\$ 13.840.342,71	R\$ 37.615.339,11
10/2023	R\$ 52.036.725,22	R\$ 19.901.437,80	R\$ 32.135.287,42
11/2023	R\$ 53.367.789,90	R\$ 19.829.408,61	R\$ 33.538.381,29
12/2023	R\$ 129.261.279,80	R\$ 33.285.938,84	R\$ 95.975.340,96
01/2024	R\$ 53.931,34	R\$ 16.310.261,57	R\$ -16.256.330,23
Saldo dos Investimentos em 01/2024		R\$ 6.812.740.143,37	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Executivo

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5066 %	0,4200 %	0,4200 %
Juros	5,1200 %	0,4170 %	0,4170 %
Meta	9,8574 %	0,8387 %	0,8387 %
Rentabilidade em %	10,3140 %	-0,7053 %	-0,7053 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 614.837.892,68	R\$ -48.507.561,59	R\$ -48.507.561,59
Resultado em %	+0,4156 %	-1,5312 %	-1,5312 %
Resultado em R\$	R\$ +27.204.374,34	R\$ -106.190.649,93	R\$ -106.190.649,93

Quadro 13.

Nota 1: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se aos valores pagos de previdência e taxa de administração do Executivo FPREV, registrados sob Regime de Caixa.



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 648.022,30	R\$ 652.267,32	1,4300	1,2100	0,6551	3,3298%	0,6551%	13,1500%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 522.402,67	R\$ 524.886,82	2,6000	1,6100	0,4800	4,7523%	0,0475%	15,8100%
SAFRA SOBERANO RP FIC DE FI RF REF DI	R\$ 64.248,86	R\$ 64.859,77	0,8900	0,8800	0,9500	2,7447%	0,0274%	12,6700%
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 4.083,13	R\$ 4.122,41	0,9000	0,8900	0,9620	2,7773%	0,0278%	12,7900%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.238.756,96	R\$ 1.246.136,32						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.129.200,94	R\$ 1.573.854,10	-	-	1,0900	NC	1,0900%	N/C
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 1.129.200,94	R\$ 1.573.854,10						
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 1.185.860,72	R\$ 1.202.040,99	1,1200	1,1100	1,3644	3,6375%	1,3644%	15,1600
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 1.185.860,72	R\$ 1.202.040,99						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.553.818,62	R\$ 4.022.031,41						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 542.587,89	R\$ 519.477,51	9,1300	5,8000	(4,2593)	10,5418%	-4,2593%	8,0100%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.211.877,86	R\$ 1.171.054,30	11,9400	4,8300	(3,3686)	13,3937%	-3,3686%	6,9400%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 627.354,11	R\$ 610.224,02	13,7910	6,6564	(2,7305)	18,0515%	-2,7305%	20,4325%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.090.860,86	R\$ 1.049.485,73	10,6500	4,8900	(3,7929)	11,6587%	-3,7929%	8,2900%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 131.351,86	R\$ 123.709,25	12,2300	5,3000	(5,8184)	11,3021%	-5,8184%	18,8400%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 3.604.032,58	R\$ 3.473.950,81						
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 3.604.032,58	R\$ 3.473.950,81						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.081.221,42	R\$ 1.110.783,01	6,2400	2,5100	2,7341	11,8842%	2,7341%	17,6100%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 1.081.221,42	R\$ 1.110.783,01						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.081.221,42	R\$ 1.110.783,01						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 552.927,36	R\$ 561.928,60	9,3200	5,1600	1,6279	16,8324%	1,6279%	26,8100%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 552.927,36	R\$ 561.928,60						
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 552.927,36	R\$ 561.928,60						
TOTAL GERAL	R\$ 8.791.999,98	R\$ 9.168.693,83						

Quadro 14.

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 (aplicação e resgate) no período.

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base as Ata de reunião do COMIV nº. 206/2023, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 27/12/2023, constante do processo nº 2023.A.11914: **Item 3.2. a) Novos Recursos:** Aplicar no Fundo BRADESCO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), considerando o exposto no item 3.1. **b) Recursos Atuais:** Manter os recursos nas aplicações atuais, considerando o cenário econômico favorável.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

3.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

Ativo	Compra	Vencimento	Taxa	PU de Compra	QTD	Valor Aplicado	PU Atual	Valor Bruto em
								31/01/2024
NTN-B - AGO/2030	15/01/2014	15/08/2030	IPC-A +6,60%	2.230,820000	593	R\$ 1.322.876,71	R\$ 4.198,581838	R\$ 2.489.759,03
NTN-B - AGO/2026	20/12/2022	15/08/2026	IPC-A +6,58%	3.916,740000	300	R\$ 1.175.024,67	R\$ 4.264,383847	R\$ 1.279.315,15
NTN-B - MAI/2033	28/02/2023	15/05/2033	IPC-A +6,25%	3.970,410000	741	R\$ 2.942.078,47	R\$ 4.194,550141	R\$ 3.108.161,65
NTN-B - MAI/2033	28/02/2023	15/05/2033	IPC-A +6,25%	3.970,410000	1	R\$ 3.970,41	R\$ 4.194,550141	R\$ 4.194,55
NTN-B - AGO/2040	28/03/2023	15/08/2040	IPC-A +6,19%	4.003,380000	645	R\$ 2.582.185,22	R\$ 4.252,187857	R\$ 2.742.661,17
NTN-B - MAI/2035	12/07/2022	15/05/2035	IPC-A +6,27%	3.909,500000	1394	R\$ 5.449.846,72	R\$ 4.179,924202	R\$ 5.826.814,34
NTN-B - MAI/2025	18/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,05%	4.120,040000	66	R\$ 271.923,20	R\$ 4.256,030372	R\$ 280.898,00
NTN-B - MAI/2025	19/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,22%	4.109,010000	72	R\$ 295.849,24	R\$ 4.248,009018	R\$ 305.856,65
NTN-B - MAI/2045	24/04/2023	15/05/2045	IPC-A +6,10%	4.056,340000	119	R\$ 482.705,45	R\$ 4.224,592382	R\$ 502.726,49
TOTAL								R\$ 16.540.387,03

Quadro 15.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, Valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	29/12/2023	31/01/2024
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 3.553.818,62	R\$ 4.022.031,41
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 3.604.032,58	R\$ 3.473.950,81
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.081.221,42	R\$ 1.110.783,01
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 552.927,36	R\$ 561.928,60
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 16.363.748,34	R\$ 16.540.387,03
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 25.155.748,32	R\$ 25.709.081,86

Quadro 16.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

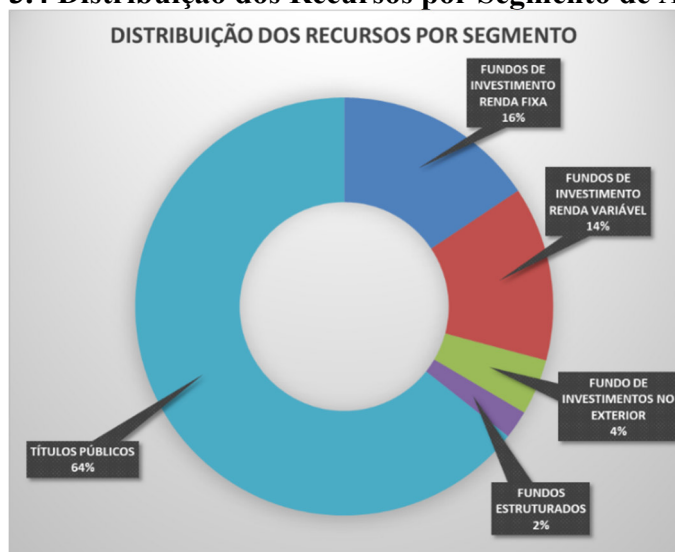


Gráfico 3.



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 01/2023		R\$ 20.515.086,87	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2023	R\$ 206.662,34	R\$ 10.022,51	R\$ 196.639,83
03/2023	R\$ 205.889,22	R\$ 10.391,50	R\$ 195.497,72
04/2023	R\$ 206.002,88	R\$ 12.482,71	R\$ 193.520,17
05/2023	R\$ 228.539,50	R\$ 11.441,00	R\$ 217.098,50
06/2023	R\$ 217.377,92	R\$ 11.524,07	R\$ 205.853,85
07/2023	R\$ 217.377,92	R\$ 10.805,73	R\$ 206.572,19
08/2023	R\$ 216.019,28	R\$ 11.691,42	R\$ 204.327,86
09/2023	R\$ 214.375,56	R\$ 11.596,40	R\$ 202.779,16
10/2023	R\$ 213.182,16	R\$ 11.534,70	R\$ 201.647,46
11/2023	R\$ 213.182,16	R\$ 11.921,08	R\$ 201.261,08
12/2023	R\$ 213.182,16	R\$ 11.506,37	R\$ 201.675,79
01/2024	R\$ 429.264,56	R\$ 0,00	R\$ 429.264,56
Saldo dos Investimentos em 01/2024		R\$ 25.709.081,86	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Assembléia

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5066 %	0,4200 %	0,4200 %
Juros	5,1200 %	0,4170 %	0,4170 %
Meta	9,8574 %	0,8387 %	0,8387 %
Rentabilidade em %	11,7480 %	0,4932 %	0,4932 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 2.537.856,82	R\$ 124.068,98	R\$ 124.068,98
Resultado em %	+1,7209 %	-0,3426 %	-0,3426 %
Resultado em R\$	R\$ +408.073,27	R\$ -86.917,63	R\$ -86.917,63

Quadro 17.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.419.189,85	R\$ 7.467.790,93	1,4349	1,2074	0,6600	3,3372%	0,6600%	13,1600%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 4.321.912,03	R\$ 4.361.075,88	0,8500	0,8400	0,9100	2,6226%	0,9100%	12,1600%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 11.741.101,88	R\$ 11.828.866,81						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 12.075.611,98	R\$ 12.206.836,17	0,9900	0,9400	1,0900	3,0504%	1,0900%	13,5800%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 12.075.611,98	R\$ 12.206.836,17						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 23.816.713,86	R\$ 24.035.702,98						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.549.996,01	R\$ 1.459.810,67	12,2300	5,3000	(5,8184)	11,3021%	-5,8184%	18,8400%
BB AÇÕES VALOR	R\$ 17.569.633,91	R\$ 16.767.392,06	12,1000	6,0400	(4,5700)	13,4384%	-4,5700%	7,7502%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 9.671.822,17	R\$ 9.527.748,01	13,1474	2,6900	(1,4896)	14,4603%	-1,4896%	39,7700%
OCCAM FIC FIA	R\$ 6.977.761,59	R\$ 6.713.103,06	10,6500	4,8900	(3,7929)	11,6587%	-3,7929%	8,2900%
TARPON GT INST FIC FIA	R\$ 10.569.137,98	R\$ 9.918.412,01	8,0663	9,8471	(6,1600)	11,3953%	-6,1600%	39,0871%
TRIGONO FLAGSHIP INST FI FIA	R\$ 6.514.035,64	R\$ 6.005.558,95	0,4000	4,5800	(7,8059)	-3,1977%	-7,8059%	-1,0300%
TOTAL art. 8º, inciso I - RENDA VARIÁVEL	R\$ 52.852.387,30	R\$ 50.392.024,76						
FUNDO DE INVESTIMENTO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 8.820.872,67	R\$ 8.964.469,65	9,3200	5,1600	1,6279	16,8324%	1,6279%	26,8100%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 8.820.872,67	R\$ 8.964.469,65						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 812.910,23						
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL RECURSOS	R\$ 85.489.973,83	R\$ 84.205.107,62						

Quadro 18.

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 (aplicação e resgate) no período.

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base as **Ata de reunião do COMIV nº. 206/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 27/12/2023, constante do processo nº 2023.A.11914: **Item. 3.3 OUTROS PODERES: MPE/DPE/ TJ/TCE FPREV.** a) Novos Recursos: Aplicar no Fundo BRADESCO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), considerando o exposto no item 3.1. b) Recursos Atuais: Manter os recursos já aplicados, considerando o cenário econômico favorável.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

4.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

Ativo	COMPRA	Vencimento	Taxa	PU de Compra	QTD	Valor Aplicado	PU Atual	Valor Bruto em
								31/01/2024
NTN-B - AGO/2024	09/06/2022	15/08/2024	IPC-A +5,81%	3.985,180000	12318	R\$ 49.089.496,45	4.322,471398	R\$ 53.244.202,68
NTN-B - MAI/2035	12/07/2022	15/05/2035	IPC-A +6,27%	3.909,500000	5068	R\$ 19.813.359,54	4.179,924202	R\$ 21.183.855,86
NTN-B - MAI/2025	13/12/2022	15/05/2025	IPC-A +6,39%	3.949,390000	3022	R\$ 11.935.069,08	4.239,277177	R\$ 12.811.095,63
NTN-B - AGO/2028	15/12/2022	15/08/2028	IPC-A +6,46%	3.904,800000	5021	R\$ 19.606.022,50	4.249,694847	R\$ 21.337.717,83
NTN-B - AGO/2026	04/01/2023	15/08/2026	IPC-A +6,37%	3.951,490000	12368	R\$ 48.872.083,61	4.284,285886	R\$ 52.988.047,84
NTN-B - MAI/2033	28/02/2023	15/05/2033	IPC-A +6,25%	3.970,410000	2967	R\$ 11.780.225,15	4.194,550141	R\$ 12.445.230,27
NTN-B - MAI/2033	28/02/2023	15/05/2033	IPC-A +6,25%	3.970,410000	1	R\$ 3.970,41	4.194,550141	R\$ 4.194,55
NTN-B - AGO/2040	03/03/2023	15/08/2040	IPC-A +6,48%	3.857,300000	4320	R\$ 16.663.556,86	4.133,666887	R\$ 17.857.440,95
NTN-B - MAI/2025	18/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,05%	4.120,040000	350	R\$ 1.442.017,00	4.256,030372	R\$ 1.489.610,63
NTN-B - MAI/2025	19/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,22%	4.109,010000	729	R\$ 2.995.473,63	4.248,009018	R\$ 3.096.798,57
NTN-B - MAI/2045	24/04/2023	15/05/2045	IPC-A +6,10%	4.056,340000	845	R\$ 3.427.614,36	4.224,592382	R\$ 3.569.780,56
TOTAL								R\$ 200.027.975,37

Quadro 19.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, Valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

4.3 Total dos Recursos – MPE/FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	SALDO	
	29/12/2023	31/01/2024
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 23.816.713,86	R\$ 24.035.702,98
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 52.852.387,30	R\$ 50.392.024,76
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 8.820.872,67	R\$ 8.964.469,65
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 197.908.606,58	R\$ 200.027.975,37
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 812.910,23
TOTAL	R\$ 283.398.580,41	R\$ 284.233.082,99

Quadro 20.

Nota: Os valores para os Títulos Públicos são atualizados com base em Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

4.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação



Gráfico 4.

4.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 01/2023		R\$ 231.306.914,29	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2023	R\$ 1.613.129,15	R\$ 145.358,74	R\$ 1.467.770,41
03/2023	R\$ 1.623.976,36	R\$ 160.693,65	R\$ 1.463.282,71
04/2023	R\$ 2.424.596,60	R\$ 178.605,05	R\$ 2.245.991,55
05/2023	R\$ 2.448.819,76	R\$ 170.907,83	R\$ 2.277.911,93
06/2023	R\$ 2.450.779,10	R\$ 152.787,06	R\$ 2.297.992,04
07/2023	R\$ 1.803.152,02	R\$ 144.209,32	R\$ 1.658.942,70
08/2023	R\$ 1.789.593,08	R\$ 190.978,30	R\$ 1.598.614,78
09/2023	R\$ 1.799.649,08	R\$ 156.703,67	R\$ 1.642.945,41
10/2023	R\$ 1.843.142,32	R\$ 192.262,07	R\$ 1.650.880,25
11/2023	R\$ 2.689.324,32	R\$ 203.346,52	R\$ 2.485.977,80
12/2023	R\$ 2.767.769,15	R\$ 294.310,84	R\$ 2.473.458,31
01/2024	R\$ 889.302,04	R\$ 81.798,61	R\$ 807.503,43
Saldo dos Investimentos em 01/2024		R\$ 284.233.082,99	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Ministério Público

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5066 %	0,4200 %	0,4200 %
Juros	5,1200 %	0,4170 %	0,4170 %
Meta	9,8574 %	0,8387 %	0,8387 %
Rentabilidade em %	12,7889 %	0,0095 %	0,0095 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 30.854.897,38	R\$ 26.999,15	R\$ 26.999,15
Resultado em %	+2,6685 %	-0,8223 %	-0,8223 %
Resultado em R\$	R\$ +7.067.809,49	R\$ -2.349.924,99	R\$ -2.349.924,99

Quadro 21.



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 5.674.376,69	R\$ 5.711.547,98	1,4349	1,2074	0,6551	3,3321%	0,6551%	13,1600%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 5.674.376,69	R\$ 5.711.547,98						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 10.028.454,90	R\$ 10.077.008,33	0,9900	0,9400	1,0900	3,0504%	1,0900%	13,5800%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 10.028.454,90	R\$ 10.077.008,33						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 15.702.831,59	R\$ 15.788.556,31						
FUNDOS DE AÇÕES	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.042.229,94	R\$ 981.588,58	12,2300	5,3000	(5,8200)	11,3002%	-5,8200%	18,8400%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 19.319,64	R\$ 18.792,11	13,7910	6,6564	(2,7300)	18,0521%	-2,7300%	20,4325%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.902.480,70	R\$ 3.844.348,26	13,1474	2,6900	(1,4900)	14,4598%	-1,4900%	39,7700%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 4.964.030,28	R\$ 4.844.728,95						
FUNDO ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 4.399.203,15	R\$ 4.470.818,78	9,3200	5,1600	1,6300	16,8348%	1,6300%	26,8100%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 4.399.203,15	R\$ 4.470.818,78						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 20.842,11						
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL RECURSOS	R\$ 25.066.065,02	R\$ 25.124.946,15						

Quadro 22.

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 (aplicação e resgate) no período.

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base as **Ata de reunião do COMIV nº. 206/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 27/12/2023, constante do processo nº 2023.A.11914: **Item 3.3 OUTROS PODERES: MPE/DPE/ TJ/TCE FPREV.** a) Novos Recursos: Aplicar no Fundo BRADESCO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), considerando o exposto no item 3.1. b) Recursos Atuais: Manter os recursos já aplicados, considerando o cenário econômico favorável.

5.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

Ativo	COMPRA	Vencimento	Taxa	QTD	PU de Compra	Valor Aplicado	PU Atual	Valor Líquido
NTN-B - MAI/2025	13/12/2022	15/05/2025	IPC-A +6,39%	8814	3.949,39	R\$ 34.809.959,94	4.239,277177	R\$ 37.364.989,04
NTN-B - MAI/2025	18/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,05%	349	4.120,04	R\$ 1.437.896,95	4.256,030372	R\$ 1.485.354,60
NTN-B - MAI/2025	19/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,22%	1216	4.109,01	R\$ 4.996.565,08	4.248,009018	R\$ 5.165.578,97
NTN-B - MAI/2033	28/02/2023	15/05/2033	IPC-A +6,25%	493	3.970,41	R\$ 1.957.415,23	4.194,550141	R\$ 2.067.913,22
NTN-B - MAI/2033	28/02/2023	15/05/2033	IPC-A +6,25%	1	3.970,41	R\$ 3.970,41	4.194,550141	R\$ 4.194,55
NTN-B - MAI/2035	12/07/2022	15/05/2035	IPC-A +6,27%	2534	3.909,50	R\$ 9.906.679,77	4.179,924202	R\$ 10.591.927,93
NTN-B - AGO/2040	28/03/2023	15/08/2040	IPC-A +6,19%	744	4.003,38	R\$ 2.978.520,62	4.252,187857	R\$ 3.163.627,77
							TOTAL	R\$ 59.843.586,08

Quadro 23.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, Valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

5.3 Total dos Recursos – DPE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	29/12/2023	31/01/2024
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 15.702.831,59	R\$ 15.788.556,31
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.964.030,28	R\$ 4.844.728,95
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 4.399.203,15	R\$ 4.470.818,78
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 59.203.799,03	R\$ 59.843.586,08
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 20.842,11
TOTAL	R\$ 84.269.864,05	R\$ 84.968.532,23

Quadro 24.

Nota: Os valores para os Títulos Públicos são atualizados com base em Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

5.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

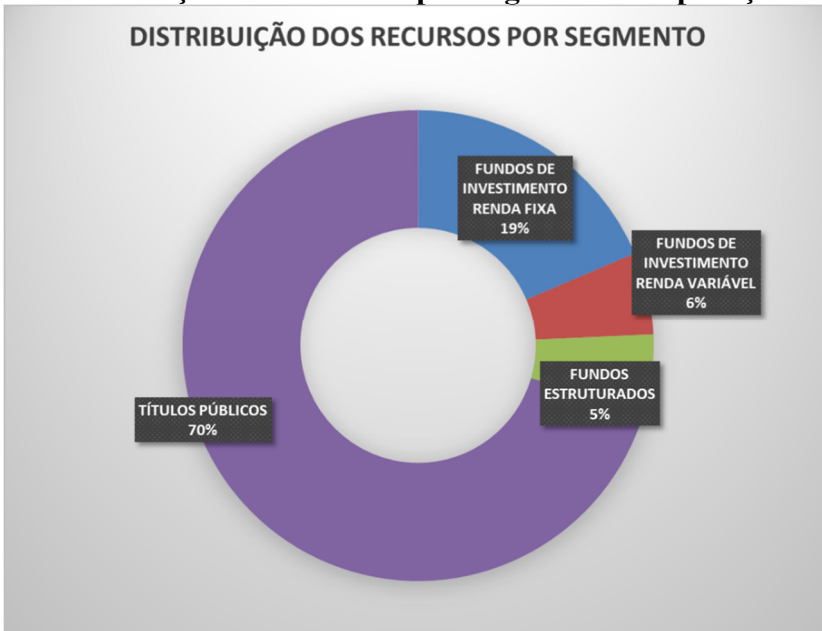


Gráfico 5.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

5.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

Saldo dos Investimentos em 01/2023		R\$ 60.070.784,64	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2023	R\$ 1.363.583,62	R\$ 191.804,69	R\$ 1.171.778,93
03/2023	R\$ 1.361.693,00	R\$ 121.514,16	R\$ 1.240.178,84
04/2023	R\$ 1.353.367,86	R\$ 107.760,38	R\$ 1.245.607,48
05/2023	R\$ 1.366.665,90	R\$ 172.454,63	R\$ 1.194.211,27
06/2023	R\$ 1.360.589,35	R\$ 122.825,00	R\$ 1.237.764,35
07/2023	R\$ 1.361.041,17	R\$ 106.111,80	R\$ 1.254.929,37
08/2023	R\$ 1.355.445,23	R\$ 119.560,47	R\$ 1.235.884,76
09/2023	R\$ 1.340.191,95	R\$ 108.101,04	R\$ 1.232.090,91
10/2023	R\$ 1.341.254,81	R\$ 135.537,65	R\$ 1.205.717,16
11/2023	R\$ 1.336.714,11	R\$ 121.330,59	R\$ 1.215.383,52
12/2023	R\$ 4.013.536,44	R\$ 152.543,98	R\$ 3.860.992,46
01/2024	R\$ 6.969,22	R\$ 46.524,35	R\$ -39.555,13
Saldo dos Investimentos em 01/2024		R\$ 84.968.532,23	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Defensoria

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5066 %	0,4200 %	0,4200 %
Juros	5,1200 %	0,4170 %	0,4170 %
Meta	9,8574 %	0,8387 %	0,8387 %
Rentabilidade em %	13,2286 %	0,8760 %	0,8760 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 8.842.763,67	R\$ 738.223,31	R\$ 738.223,31
Resultado em %	+3,0687 %	+0,0370 %	+0,0370 %
Resultado em R\$	R\$ +2.249.587,06	R\$ +31.434,05	R\$ +31.434,05

Quadro 25.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.501.705,20	R\$ 2.129.203,41	0,8500	0,8400	0,9100	2,6226%	0,9100%	12,1600%
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 14.852.474,09	R\$ 14.949.768,59	1,4349	1,2074	0,6600	3,3372%	0,6600%	13,1580%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 17.354.179,29	R\$ 17.078.972,00						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 50.788.693,36	R\$ 51.340.607,82	0,9900	0,9400	1,0109	2,9698%	1,0109%	13,5800%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 50.788.693,36	R\$ 51.340.607,82						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 68.142.872,65	R\$ 68.419.579,82						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.383.175,00	R\$ 3.186.327,52	12,2300	5,3000	(5,8184)	11,3021%	-5,8184%	18,8400%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 12.171.144,12	R\$ 11.838.807,51	13,7910	6,6564	(2,7305)	18,0515%	-2,7305%	20,4325%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.244.944,58	R\$ 1.197.725,25	10,6500	4,8900	(3,7929)	11,6587%	-3,7929%	8,2900%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 1.358.406,24	R\$ 1.252.370,91	0,4000	4,5800	(7,8059)	-3,1977%	-7,8059%	-1,0300%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.895.932,95	R\$ 1.779.203,20	8,0663	9,8471	(6,1600)	11,3953%	-6,1600%	39,0871%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 8.501.754,77	R\$ 8.375.110,27	13,1474	2,6900	(1,4896)	14,4603%	-1,4896%	39,7700%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 5.481.154,76	R\$ 5.222.165,68	11,6100	5,9200	(4,7251)	12,6314%	-4,7251%	10,3205%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 34.036.512,42	R\$ 32.851.710,34						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 29.653.224,67	R\$ 30.894.154,72	6,1900	3,6622	4,1848	14,6855%	4,1848%	17,8400%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 29.653.224,67	R\$ 30.894.154,72						

FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 23.468.199,16	R\$ 23.850.243,32	9,3200	5,1600	1,6279	16,8324%	1,6279%	26,8100%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 23.468.199,16	R\$ 23.850.243,32						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE		R\$ 31.946,64						
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 155.300.808,90	R\$ 156.047.634,84						

Quadro 26.

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 (aplicação e resgate) no período.

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base as **Ata de reunião do COMIV nº. 206/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 27/12/2023, constante do processo nº 2023.A.11914: **Item 3.3 OUTROS PODERES:** MPE/DPE/ TJ/TCE FPREV. a) Novos Recursos: Aplicar no Fundo BRADESCO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), considerando o exposto no item 3.1. b) Recursos Atuais: Manter os recursos já aplicados, considerando o cenário econômico favorável.



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

6.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

ATIVO	Data da Compra	Vencimento	Taxa	PU de Compra	QTD	Valor Aplicado	PU Atual	Valor Atual
NTN-B - AGO/2024	15/12/2022	15/08/2024	IPC-A +6,95%	3.930,240000	12.474	R\$ 49.025.817,96	4.298,188725	R\$ 53.615.606,16
NTN-B - MAI/2035	12/07/2022	15/05/2035	IPC-A +6,27%	3.909,500000	12.036	R\$ 47.054.774,16	4.179,924202	R\$ 50.309.567,70
NTN-B - MAI/2025	13/12/2022	15/05/2025	IPC-A +6,39%	3.949,390000	755	R\$ 2.981.792,57	4.239,277177	R\$ 3.200.654,27
NTN-B - MAI/2027	13/12/2022	15/05/2027	IPC-A +6,31%	3.937,020000	10.105	R\$ 39.783.684,45	4.223,192428	R\$ 42.675.359,48
NTN-B - MAI/2035	31/01/2023	15/05/2035	IPC-A +6,13%	4.040,470000	2.400	R\$ 9.697.135,06	4.224,491484	R\$ 10.138.779,56
NTN-B - MAI/2033	28/02/2023	15/05/2033	IPC-A +6,25%	3.970,410000	179	R\$ 710.704,51	4.194,550141	R\$ 750.824,48
NTN-B - MAI/2033	28/02/2023	15/05/2033	IPC-A +6,25%	3.970,410000	3.283	R\$ 13.034.876,70	4.194,550141	R\$ 13.770.708,11
NTN-B - AGO/2040	28/02/2023	15/08/2040	IPC-A +6,35%	3.904,680000	1.277	R\$ 4.986.284,96	4.186,427889	R\$ 5.346.068,41
NTN-B - MAI/2033	01/03/2023	15/05/2033	IPC-A +6,35%	3.944,390000	12.443	R\$ 49.080.080,43	4.167,627315	R\$ 51.857.786,68
NTN-B - AGO/2040	28/03/2023	15/08/2040	IPC-A +6,19%	4.003,380000	2.479	R\$ 9.924.398,70	4.252,187857	R\$ 10.541.173,70
NTN-B - MAI/2035	29/03/2023	15/05/2035	IPC-A +6,12%	4.040,930000	2.418	R\$ 9.770.980,03	4.227,766450	R\$ 10.222.739,28
NTN-B - AGO/2040	30/03/2023	15/08/2040	IPC-A +6,17%	4.016,530000	2.470	R\$ 9.920.830,42	4.262,597120	R\$ 10.528.614,89
NTN-B - MAI/2045	20/04/2023	15/05/2045	IPC-A +6,11%	4.051,720000	2.404	R\$ 9.740.353,31	4.221,166070	R\$ 10.147.683,23
NTN-B - MAI/2045	24/04/2023	15/05/2045	IPC-A +6,10%	4.056,340000	2.400	R\$ 9.735.236,06	4.224,592382	R\$ 10.139.021,72
NTN-B - AGO/2024	15/05/2023	15/08/2024	IPC-A +7,07%	4.068,000000	24.227	R\$ 98.555.672,88	4.295,662083	R\$ 104.071.005,28
NTN-B - AGO/2024	15/05/2023	15/08/2024	IPC-A +6,99%	4.071,740000	4.800	R\$ 19.544.397,48	4.297,347912	R\$ 20.627.269,98
NTN-B - MAI/2025	18/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,05%	4.120,040000	2.426	R\$ 9.995.237,87	4.256,030372	R\$ 10.325.129,68
NTN-B - MAI/2025	19/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,22%	4.109,010000	2.426	R\$ 9.968.476,05	4.248,009018	R\$ 10.305.669,88
NTN-B - MAI/2025	24/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,28%	4.107,220000	20.018	R\$ 82.218.377,17	4.244,944255	R\$ 84.975.294,10
NTN-B - AGO/2024	26/06/2023	15/08/2024	IPC-A +7,38%	4.069,140000	14.916	R\$ 60.695.366,99	4.289,103743	R\$ 63.976.271,43
TOTAL								R\$ 577.525.228,02

Quadro 27.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, Valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

6.3 Total dos Recursos – TJ/AM-FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	SALDO	
	29/12/2023	31/01/2024
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 68.142.872,65	R\$ 68.419.579,82
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 34.036.512,42	R\$ 32.851.710,34
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 29.653.224,67	R\$ 30.894.154,72
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 23.468.199,16	R\$ 23.850.243,32
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 571.216.611,61	R\$ 577.525.228,02
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 31.946,64
TOTAL	R\$ 726.517.420,51	R\$ 733.572.862,86

Quadro 28.

Nota: Os valores para os Títulos Públicos são atualizados com base em Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

6.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

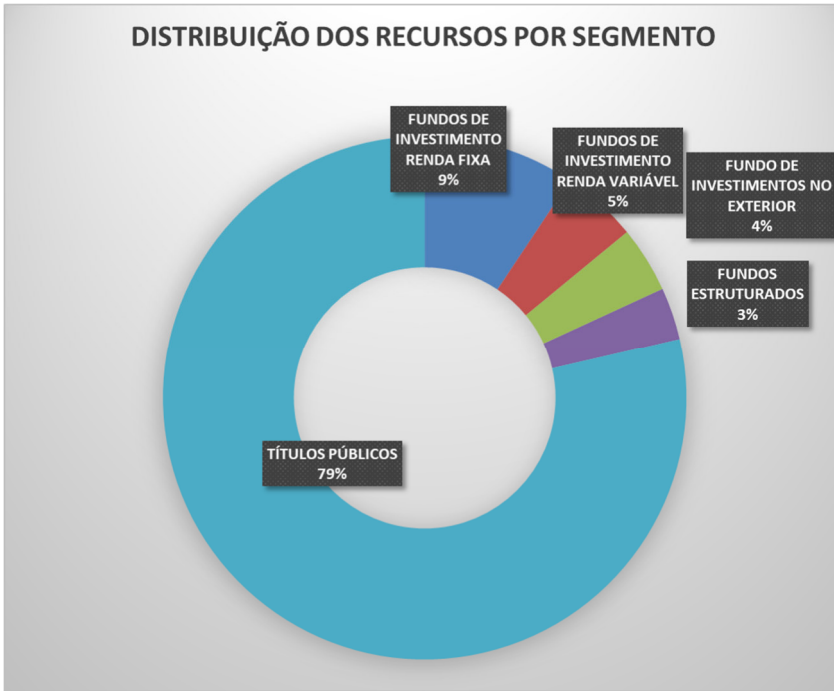


Gráfico 6

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

6.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 01/2023		R\$ 604.681.942,95	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2023	R\$ 4.452.062,90	R\$ 386.831,46	R\$ 4.065.231,44
03/2023	R\$ 4.682.824,72	R\$ 954.025,73	R\$ 3.728.798,99
04/2023	R\$ 37.853,98	R\$ 416.120,94	R\$ -378.266,96
05/2023	R\$ 9.514.313,12	R\$ 826.562,19	R\$ 8.687.750,93
06/2023	R\$ 4.768.915,92	R\$ 398.809,96	R\$ 4.370.105,96
07/2023	R\$ 4.785.265,87	R\$ 584.156,10	R\$ 4.201.109,77
08/2023	R\$ 33.609,27	R\$ 678.500,13	R\$ -644.890,86
09/2023	R\$ 9.554.818,39	R\$ 572.787,56	R\$ 8.982.030,83
10/2023	R\$ 4.778.352,07	R\$ 665.888,73	R\$ 4.112.463,34
11/2023	R\$ 4.848.237,81	R\$ 817.855,72	R\$ 4.030.382,09
12/2023	R\$ 10.103.321,49	R\$ 1.033.865,02	R\$ 9.069.456,47
01/2024	R\$ 31.946,64	R\$ 394.393,86	R\$ -362.447,22
Saldo dos Investimentos em 01/2024		R\$ 733.572.862,86	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Tribunal de Justiça

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5066 %	0,4200 %	0,4200 %
Juros	5,1200 %	0,4170 %	0,4170 %
Meta	9,8574 %	0,8387 %	0,8387 %
Rentabilidade em %	12,6176 %	1,0210 %	1,0210 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 79.029.195,13	R\$ 7.417.889,57	R\$ 7.417.889,57
Resultado em %	+2,5126 %	+0,1808 %	+0,1808 %
Resultado em R\$	R\$ +17.277.867,59	R\$ +1.324.433,52	R\$ +1.324.433,52

Quadro 29.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 3.854.347,63	R\$ 3.879.596,41	1,4349	1,2074	0,6600	3,3372%	0,6600%	13,1600%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 3.929.784,29	R\$ 3.911.214,25	0,8500	0,8400	0,9100	2,6226%	0,9100%	12,1600%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 7.784.131,92	R\$ 7.790.810,66						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 6.162.326,16	R\$ 6.229.291,40	-	0,9400	1,0900	NC	1,0900%	N/C
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 6.162.326,16	R\$ 6.229.291,40						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 13.946.458,08	R\$ 14.020.102,06						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 914.006,02	R\$ 860.825,27	12,2300	5,3000	(5,8200)	11,3002%	-5,8200%	18,8400%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 12.171.144,12	R\$ 11.838.807,51	13,7910	6,6564	(2,7300)	18,0521%	-2,7300%	20,4325%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.969.243,25	R\$ 1.939.908,87	13,1474	2,6900	(1,4900)	14,4598%	-1,4900%	39,7700%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 1.021.430,93	R\$ 973.167,47	11,6100	5,9200	(4,7300)	12,6256%	-4,7300%	10,3205%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 16.075.824,32	R\$ 15.612.709,12						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/23	jan/24	TRIMESTRE	2024	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 567.136,03	R\$ 590.869,57	6,1913	3,6622	4,1800	14,6816%	4,1800%	17,8400%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 567.136,03	R\$ 590.869,57						

FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/12/2023	31/01/2024	nov/23	dez/22	jan/24	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 4.378.554,32	R\$ 4.449.833,80	9,3200	5,1600	1,6300	16,8348%	1,6300%	26,8100%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 4.378.554,32	R\$ 4.449.833,80						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 4.441,32						
VALORES EM TRANSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 34.967.972,75	R\$ 34.677.955,87						

Quadro 30.

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 (aplicação e resgate) no período.

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base as **Ata de reunião do COMIV nº. 206/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 27/12/2023, constante do processo nº 2023.A.11914: **Item 3.3 OUTROS PODERES: MPE/DPE/ TJ/TCE FPREV.** a) Novos Recursos: Aplicar no Fundo BRADESCO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), considerando o exposto no item 3.1. b) Recursos Atuais: Manter os recursos já aplicados, considerando o cenário econômico favorável.



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

7.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

Ativo	COMPRA	Vencimento	Taxa	PU de Compra	QTD	Valor Aplicado	PU Atual	Valor Líquido
NTN-B - AGO/2024	15/12/2022	15/08/2024	IPC-A +6,95%	3.930,240000	12.474	R\$ 49.025.817,96	4.298,188725	R\$ 53.615.606,16
NTN-B - MAI/2035	12/07/2022	15/05/2035	IPC-A +6,27%	3.909,500000	4.308	R\$ 16.842.137,51	4.179,924202	R\$ 18.007.113,46
NTN-B - MAI/2027	13/12/2022	15/05/2027	IPC-A +6,31%	3.937,020000	2.526	R\$ 9.944.936,85	4.223,192428	R\$ 10.667.784,07
NTN-B - MAI/2033	28/02/2023	15/05/2033	IPC-A +6,25%	3.970,410000	4.699	R\$ 18.656.986,18	4.194,550141	R\$ 19.710.191,11
NTN-B - MAI/2025	18/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,05%	4.120,040000	562	R\$ 2.315.467,30	4.256,030372	R\$ 2.391.889,07
NTN-B - MAI/2035	06/03/2023	15/05/2035	IPC-A +6,43%	3.911,490000	7.522	R\$ 29.422.250,04	4.129,307273	R\$ 31.060.649,31
NTN-B - MAI/2025	19/05/2023	15/05/2025	IPC-A +6,22%	4.109,010000	1.216	R\$ 4.996.565,08	4.248,009018	R\$ 5.165.578,97
TOTAL								R\$ 140.618.812,15

Quadro 31.

Nota: Dados referentes as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, Valor do ativo na compra, quantidade de papéis adquiridos. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos que emite Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

7.3 Total dos Recursos – TCE/AM-FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	SALDO	
	29/12/2023	31/01/2024
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 13.946.458,08	R\$ 14.020.102,06
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 16.075.824,32	R\$ 15.612.709,12
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 567.136,03	R\$ 590.869,57
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 139.089.574,95	R\$ 140.618.812,15
FUNDO DE INVESTIMENTOS - FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 4.378.554,32	R\$ 4.449.833,80
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA		R\$ 4.441,32
TOTAL	R\$ 174.057.547,70	R\$ 175.296.768,02

Quadro 32.

Nota: Os valores para os Títulos Públicos são atualizados com base em Relatório com a Posição Atualizada dos Títulos.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

7.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

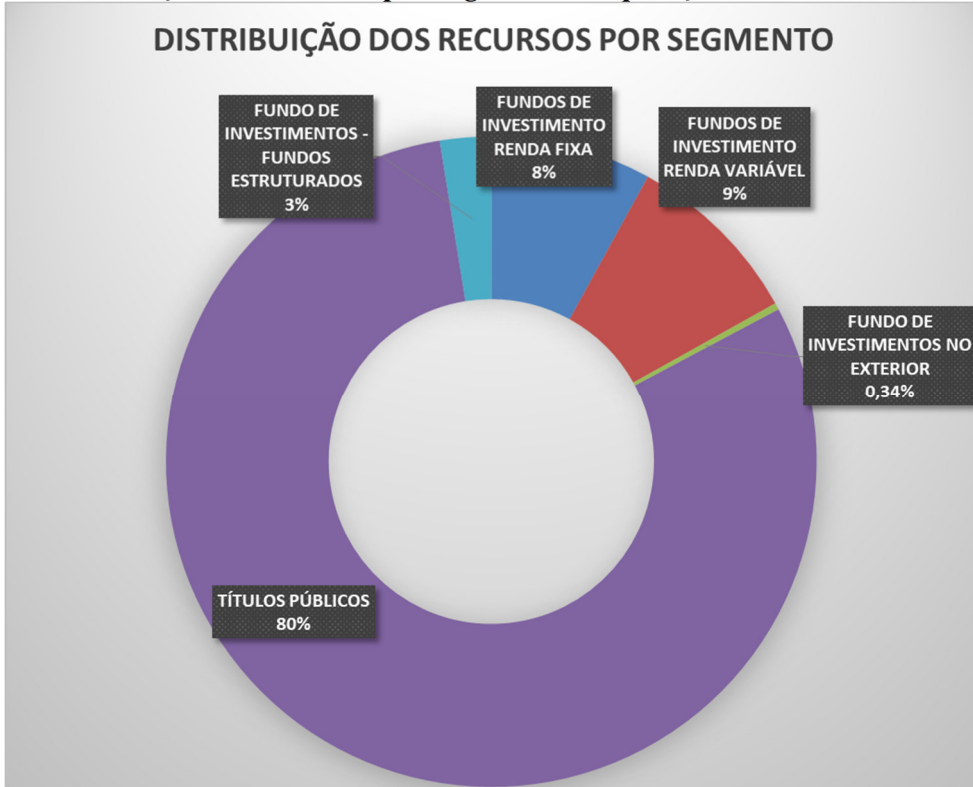


Gráfico 7.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 01/2023		R\$ 145.689.895,83	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2023	R\$ 840.406,80	R\$ 57.209,33	R\$ 783.197,47
03/2023	R\$ 868.020,15	R\$ 119.035,88	R\$ 748.984,27
04/2023	R\$ 884.821,56	R\$ 81.955,68	R\$ 802.865,88
05/2023	R\$ 893.485,01	R\$ 93.218,22	R\$ 800.266,79
06/2023	R\$ 906.009,82	R\$ 92.481,20	R\$ 813.528,62
07/2023	R\$ 1.039.877,59	R\$ 83.329,25	R\$ 956.548,34
08/2023	R\$ 542.924,76	R\$ 85.771,35	R\$ 457.153,41
09/2023	R\$ 1.698.028,43	R\$ 145.941,45	R\$ 1.552.086,98
10/2023	R\$ 605.784,29	R\$ 108.651,95	R\$ 497.132,34
11/2023	R\$ 2.636.610,67	R\$ 220.791,68	R\$ 2.415.818,99
12/2023	R\$ 1.128.314,27	R\$ 187.161,55	R\$ 941.152,72
01/2024	R\$ 4.441,32	R\$ 54.073,92	R\$ -49.632,60
Saldo dos Investimentos em 01/2024		R\$ 175.296.768,02	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - Tribunal de Contas

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5066 %	0,4200 %	0,4200 %
Juros	5,1200 %	0,4170 %	0,4170 %
Meta	9,8574 %	0,8387 %	0,8387 %
Rentabilidade em %	12,5649 %	0,7405 %	0,7405 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 18.887.768,98	R\$ 1.288.852,92	R\$ 1.288.852,92
Resultado em %	+2,4645 %	-0,0974 %	-0,0974 %
Resultado em R\$	R\$ +4.067.678,77	R\$ -171.004,73	R\$ -171.004,73

Quadro 33.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 01/2023		R\$ 6.833.869.370,05	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2023	R\$ 56.872.067,81	R\$ 20.127.536,33	R\$ 36.744.531,48
03/2023	R\$ 56.586.892,72	R\$ 14.866.722,41	R\$ 41.720.170,31
04/2023	R\$ 53.436.002,70	R\$ 13.694.121,29	R\$ 39.741.881,41
05/2023	R\$ 63.975.354,09	R\$ 19.217.972,94	R\$ 44.757.381,15
06/2023	R\$ 58.204.827,71	R\$ 15.438.464,68	R\$ 42.766.363,03
07/2023	R\$ 64.141.055,50	R\$ 14.109.293,00	R\$ 50.031.762,50
08/2023	R\$ 55.130.943,32	R\$ 15.200.791,24	R\$ 39.930.152,08
09/2023	R\$ 66.062.745,23	R\$ 14.835.472,83	R\$ 51.227.272,40
10/2023	R\$ 60.818.440,87	R\$ 21.015.312,90	R\$ 39.803.127,97
11/2023	R\$ 65.091.858,97	R\$ 21.204.654,20	R\$ 43.887.204,77
12/2023	R\$ 147.487.403,31	R\$ 34.965.326,60	R\$ 112.522.076,71
01/2024	R\$ 1.415.855,12	R\$ 16.887.052,31	R\$ -15.471.197,19
Saldo dos Investimentos em 01/2024		R\$ 8.116.520.471,33	

2. Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos - CONSOLIDADO

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5066 %	0,4200 %	0,4200 %
Juros	5,1200 %	0,4170 %	0,4170 %
Meta	9,8574 %	0,8387 %	0,8387 %
Rentabilidade em %	10,6824 %	-0,4762 %	-0,4762 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 754.990.374,66	R\$ -38.911.527,66	R\$ -38.911.527,66
Resultado em %	+0,7510 %	-1,3040 %	-1,3040 %
Resultado em R\$	R\$ +58.275.390,51	R\$ -107.442.629,71	R\$ -107.442.629,71

Quadro 34.

Nota 1: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se ao pagamento de inativos e pensionistas.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

3. Rentabilidade Mensal x Meta Atuarial - Últimos 12 meses - CONSOLIDADO



Gráfico 8.

4. Rentabilidade Acumulada x Meta Atuarial - Últimos 12 meses - CONSOLIDADO

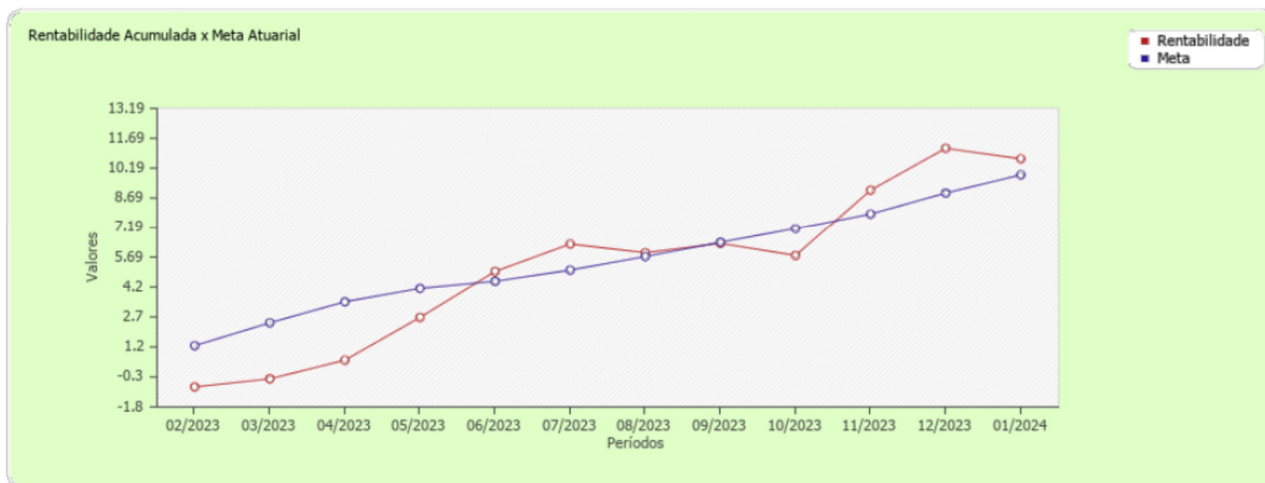


Gráfico 9.

Atenciosamente,

Luiz Cláudio Kogut
Atuário - Miba 1.308

Sócio-Gerente da ACTUARIAL Assessoria e Consultoria Atuarial Ltda-Epp.

Observação: Os resultados deste relatório foram gerados automaticamente por software, portanto, algumas vezes problemas podem ocorrer com os resultados. Se notar alguma diferença nos mesmos, entre em contato com a empresa para que os mesmos sejam corrigidos. Este relatório pode conter informações confidenciais e/ou privilegiadas. Se você não for a pessoa autorizada a obtê-la, não pode usar, copiar ou divulgar as informações nela contidas ou tomar qualquer ação baseada nelas. Comunicações pela Internet não podem ser garantidas quanto à segurança ou inexistência de erros ou de vírus. O remetente, por esta razão, não aceita responsabilidade por qualquer erro ou omissão no contexto da mensagem decorrente da transmissão via internet.

ACTUARIAL Assessoria e Consultoria Atuarial Ltda-Epp
R. Comendador Araújo, 143 - Cjto 101 - 10º andar CEP 80420-900 Curitiba PR Telefone (41) 3322-2110
actuarial.com.br
CNPJ 00.767.919/0001-05

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	29/12/2023	31/01/2024
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.815.612,71	R\$ 1.006.225,79
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 16.054.205,87	R\$ 17.176.138,10
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 8.526,03	R\$ 10.859,36
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 188.206,66	R\$ 17.001.036,47
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 237.972,51	R\$ 237.972,51
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 48.481,80
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ 12.400,14	R\$ 1.333,88
TOTAL	R\$ 21.316.923,92	R\$ 35.482.047,91

Quadro 35.

Nota: Os valores recebidos de Contribuição no FFIN são utilizados no pagamento das folhas de aposentados e pensionistas dessa massa previdenciária.

9.2 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/12/2023	31/01/2024
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 19.976.429,43	R\$ 252.653,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ -	R\$ 13.590,37
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.263,78	R\$ 24.232,43
TOTAL	R\$ 20.000.693,21	R\$ 290.476,42

Quadro 36.

Nota: Com base nos termos da LC 206/2020 que, dentre outros, cria o Fundo Temporário - FTEMP a partir dos recursos de contribuição dos servidores militares do FPREV, com finalidade de pagamento dos inativos e pensionistas do FFIN e do FPPM.

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	29/12/2023	31/01/2024
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 537.952,67	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 419,70
TOTAL	R\$ 537.952,67	R\$ 419,70

Quadro 37.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/12/2023	31/01/2024
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 79.473,22
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 2.075,62	R\$ 75.939,78
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 4.166,74	R\$ 218.685,46
TOTAL	R\$ 6.242,36	R\$ 374.098,46

Quadro 39.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/12/2023	31/01/2024
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.698.661,65	R\$ 927.395,39
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 961.278,43
TOTAL	R\$ 4.698.661,65	R\$ 1.888.673,82

Quadro 40.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/12/2023	31/01/2024
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 11.773.996,65	R\$ 280.049,41
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 2.420.006,21
TOTAL	R\$ 11.773.996,65	R\$ 2.700.055,62

Quadro 41.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/12/2023	31/01/2024
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.033.046,10	R\$ -
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ -	R\$ 1.546.990,09
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 854,45
TOTAL	R\$ 1.033.046,10	R\$ 1.547.844,54
TOTAL GERAL FFIN	R\$ 59.367.516,56	R\$ 42.283.616,47

Quadro 42

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Evolução do Saldo de Taxa de Administração

DESCRIÇÃO	SALDOS		
	30/11/2023	29/12/2023	31/01/2024
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 426.668,15	R\$ 3.652.977,79	R\$ 859.095,51
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 16.234.732,00	R\$ 10.352.365,27	R\$ 10.456.210,60
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 24.116,34	R\$ 3.513,91
TOTAL PODER EXECUTIVO	R\$ 16.661.400,15	R\$ 14.029.459,40	R\$ 11.318.820,02
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	30/11/2023	29/12/2023	31/01/2024
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL - ALE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	30/11/2023	29/12/2023	31/01/2024
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL - TCE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	30/11/2023	29/12/2023	31/01/2024
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL TJ/AM	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	30/11/2023	29/12/2023	31/01/2024
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL PGJ/AM	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL GERAL	R\$ 16.661.400,15	R\$ 14.029.459,40	R\$ 11.318.820,02

Quadro 43.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2024		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL	R\$ 4.027.810.410,21	50,09%	59,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 4.027.810.410,21				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 200.217.245,70	10,90%	10,00%	100,00%	art. 7º, Inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 201.427.133,93				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 58.713.030,57				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 148.502.691,37				
SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 89.897.778,33				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 100.145.190,57				
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 54.282.014,11				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 23.672.364,09				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 876.857.448,67				
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 449.369.793,07	6,37%	2,00%	75,00%	art. 7º, inciso III, "a"
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 62.971.297,48				
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 512.341.090,55				
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 37.482.862,36	7,37%	7,00%	15,00%	art 7º, inciso V, "b"
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 102.422.469,61				
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 104.428.307,43				
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 103.328.980,12				
BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 108.189.470,82				
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 137.027.225,40				
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 592.879.315,74				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 6.009.888.265,17	74,74%			

Quadro 44.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2024		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 35.623.426,32	17,88%	10,00%	45,00%	art. 8º, inciso I
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 47.888.512,38				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 126.169.081,38				
BB SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 55.367.036,46				
BRABESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 108.201.486,58				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 42.417.370,95				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 207.926.920,07				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 39.602.371,02				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 20.265.961,71				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 90.756.352,82				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ -				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 74.990.503,98				
OCCAM FIC FIA	R\$ 109.006.112,60				
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 110.925.393,17				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 106.119.057,07				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 46.004.157,98				
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 49.641.953,92				
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 99.318.949,38				
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.163.718,92				
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 46.241.199,42				
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 15.887.622,41				
TOTAL art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 1.437.517.188,54				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.437.517.188,54	17,88%			

Quadro 45.

11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2024		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 31.485.024,29	2,03%	1,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 36.091.694,97				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 16.674.886,24				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 50.495.858,96				
SCHRÖDER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 28.841.750,67				
TOTAL art 9º, inciso II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 163.589.215,13				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NÍVEL I	R\$ 69.651.261,97	1,71%	1,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NÍVEL I	R\$ 32.249.191,22				
ITAÚ BDR NÍVEL I AÇÕES	R\$ 35.469.946,88				
TOTAL art 9º, inciso III - BDR Nível I	R\$ 137.370.400,07				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 300.959.615,20	3,74%			

Quadro 46.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

11.4 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Fundos Estruturados

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2024		Resolução CMN nº 4.963/21				
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR					
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 42.297.294,15	2,05%	3,00%	15,00%	art. 10º, inciso I, a				
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 20.385.759,36								
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 17.929.540,43								
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 20.928.907,15								
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM	R\$ 11.385.597,75								
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 34.851.930,68								
RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 16.869.963,12								
TOTAL art. 10º, inciso I, "a"	R\$ 164.648.992,64								
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.677.422,01	1,59%	4,00%	10,00%	art. 10º, inciso I, b				
BTG PACTUAL INV DE IMPACTO CL A FIP MULT	R\$ 22.652.862,93								
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$ 6.103.529,00								
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 2.097.466,70								
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 26.743.224,16								
PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP	R\$ 149.614,50								
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R\$ 29.538.603,28								
TOTAL art. 10º, inciso I, "b"	R\$ 127.962.722,58								
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 292.611.715,22					3,64%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 8.040.976.784,13	100,00%							

Quadro 47.

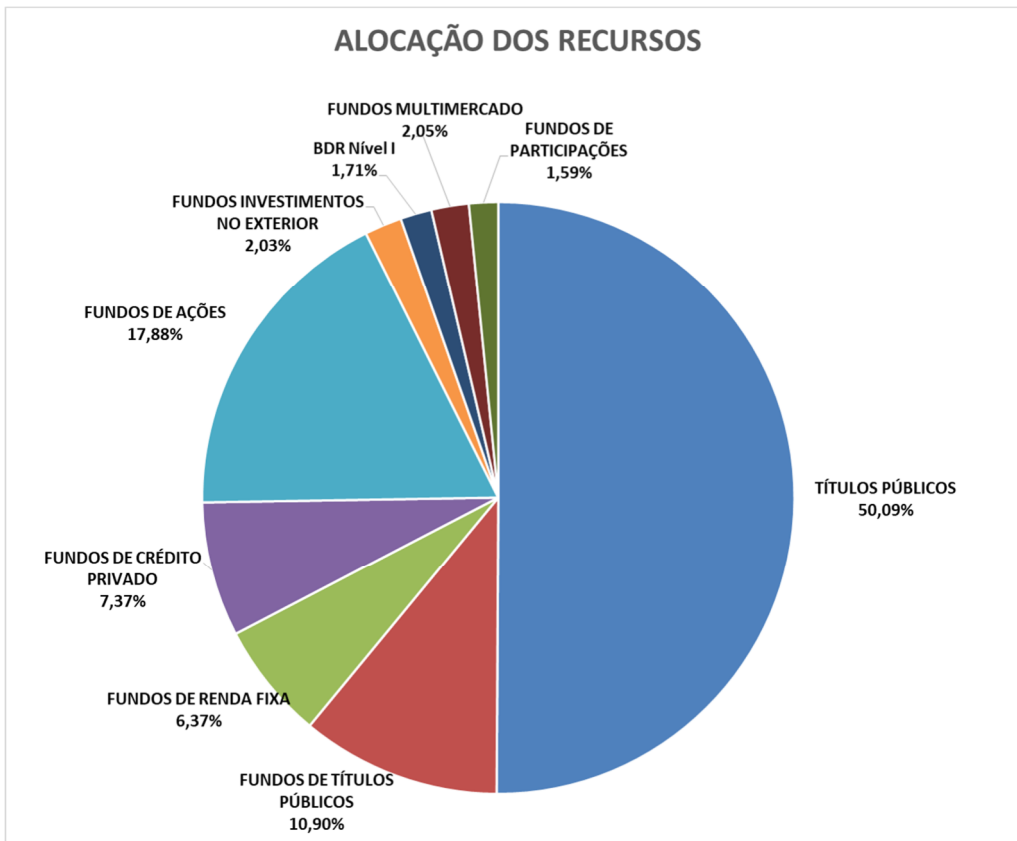


Gráfico 10.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

11.5 Enquadramento II – Limites Gerais – art. 18º - Res. CMN 4.963/2021

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	% CARTEIRA	LIMITE NO PL DO RPPS POR FUNDO
FI RF - 100% TPF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 58.713.030,57	0,72%	100%
	BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 23.672.364,09	0,29%	
FI RENDA FIXA	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC - FUNDO NOVO	R\$ 54.282.014,11	0,66%	100%
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 148.502.691,37	1,82%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 201.427.133,93	2,47%	
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 100.145.190,57	1,23%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 89.897.778,33	1,10%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 200.217.245,70	2,45%	
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 62.971.297,48	0,77%	20%
	BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 449.369.793,07	5,50%	
	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 37.482.862,36	0,46%	
FI RF CREDITO PRIVADO	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 102.422.469,61	1,25%	20%
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 104.428.307,43	1,28%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 103.328.980,12	1,26%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 108.189.470,82	1,32%	
	SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 137.027.225,40	1,68%	
	CDB	CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE	R\$ -	
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 35.623.426,32	0,44%	20%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 47.888.512,38	0,59%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 126.169.081,38	1,54%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 55.367.036,46	0,68%	
	BRANCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 108.201.486,58	1,32%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 42.417.370,95	0,52%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 207.926.920,07	2,55%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 39.602.371,02	0,48%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 20.265.961,71	0,25%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 90.756.352,82	1,11%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ -	0,00%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 74.990.503,98	0,92%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 109.006.112,60	1,33%	
	VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 110.925.393,17	1,36%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 106.119.057,07	1,30%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 46.004.157,98	0,56%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 49.641.953,92	0,61%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 99.318.949,38	1,22%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.163.718,92	0,06%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 46.241.199,42	0,57%	
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 15.887.622,41	0,19%		
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIO	R\$ 31.485.024,29	0,39%	20%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 36.091.694,97	0,44%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 16.674.886,24	0,20%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 50.495.858,96	0,62%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 28.841.750,67	0,35%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 69.651.261,97	0,85%	20%
	ITAU BDR NIVE I AÇÕES	R\$ 35.469.946,88	0,43%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 32.249.191,22	0,39%	

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27
Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$	42.297.294,15	0,52%	20%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$	20.385.759,36	0,25%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$	17.929.540,43	0,22%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$	20.928.907,15	0,26%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$	11.385.597,75	0,14%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$	34.851.930,68	0,43%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$	16.869.963,12	0,21%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$	40.677.422,01	0,50%	20%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$	26.743.224,16	0,33%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$	6.103.529,00	0,07%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$	2.097.466,70	0,03%	
	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R\$	29.538.603,28	0,36%	
	PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP	R\$	149.614,50	0,00%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$	22.652.862,93	0,28%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$	4.013.016.759,42		

Quadro 48.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

11.6 Enquadramento III – Limites Gerais – art. 19º - Res. CMN 4.963/2021

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	LIMITE RESOL. CMN 4.963/21
FI RF - 100% TPF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 58.713.030,57	R\$ 239.606.704,78	24,50%	100%
	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 23.672.364,09	R\$ 447.052.438,74	5,30%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 200.217.245,70	R\$ 7.718.818.121,25	2,59%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 201.427.133,93	R\$ 5.834.557.206,92	3,45%	
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 148.502.691,37	R\$ 5.336.760.703,29	2,78%	
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 54.282.014,11	R\$ 58.144.656.489,34	0,09%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 89.897.778,33	R\$ 7.243.275.571,31	1,24%	
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 100.145.190,57	R\$ 2.305.821.252,36	4,34%	
FI RENDA FIXA	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 449.369.793,07	R\$ 9.205.921.475,18	4,88%	15%
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 62.971.297,48	R\$ 15.073.540.268,85	0,42%	
FI RF CREDITO PRIVADO	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 37.482.862,36	R\$ 1.246.053.747,09	3,01%	5%
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 102.422.469,61	R\$ 11.236.039.057,73	0,91%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 104.428.307,43	R\$ 2.920.752.125,20	3,58%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 103.328.980,12	R\$ 4.611.599.592,77	2,24%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 108.189.470,82	R\$ 13.909.965.101,92	0,78%	
	SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 137.027.225,40	R\$ 5.146.249.928,84	2,66%	
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 35.623.426,32	R\$ 408.597.769,58	8,72%	15%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 47.888.512,38	R\$ 1.226.260.171,90	3,91%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 126.169.081,38	R\$ 880.339.279,73	14,33%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 55.367.036,46	R\$ 1.410.836.437,11	3,92%	
	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 108.201.486,58	R\$ 671.967.360,08	16,10%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 42.417.370,95	R\$ 290.497.049,26	14,60%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 207.926.920,07	R\$ 1.385.717.145,06	15,01%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 39.602.371,02	R\$ 809.318.751,37	4,89%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 20.265.961,71	R\$ 127.122.281,88	15,94%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 90.756.352,82	R\$ 683.926.822,34	13,27%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 74.990.503,98	R\$ 524.370.578,42	14,30%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 109.006.112,60	R\$ 897.850.630,50	12,14%	
	VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 110.925.393,17	R\$ 743.003.932,93	14,93%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 106.119.057,07	R\$ 2.242.724.877,46	4,73%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 46.004.157,98	R\$ 527.518.089,73	8,72%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 49.641.953,92	R\$ 955.761.755,90	5,19%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 99.318.949,38	R\$ 1.947.027.020,73	5,10%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.163.718,92	R\$ 849.894.612,40	0,61%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 46.241.199,42	R\$ 1.467.717.616,36	3,15%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 15.887.622,41	R\$ 830.562.882,06	1,91%	
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 31.485.024,29	R\$ 1.218.292.314,33	2,58%	15%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 36.091.694,97	R\$ 113.804.903.771,92	0,03%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 16.674.886,24	R\$ 15.859.533.797,70	0,11%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 50.495.858,96	R\$ 603.179.457,55	8,37%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 28.841.750,67	R\$ 390.708.412,68	7,38%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 69.651.261,97	R\$ 1.344.395.244,91	5,18%	15%
	ITAU BDR NIVEL 1 AÇÕES	R\$ 35.469.946,88	R\$ 253.032.763,85	14,02%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 32.249.191,22	R\$ 670.212.192,72	4,81%	

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

		R\$	R\$		
FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	42.297.294,15	587.696.679,90	7,20%	15%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	20.385.759,36	542.323.947,05	3,76%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	17.929.540,43	50.830.452,46	35,27%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	20.928.907,15	240.578.047,92	8,70%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	11.385.597,75	178.534.803,41	6,38%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	34.851.930,68	239.430.217,89	14,56%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	16.869.963,12	142.000.741,84	11,88%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	40.677.422,01	3.043.627.274,13	1,34%	15%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	26.743.224,16	545.069.287,34	4,91%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	6.103.529,00	121.486.735,82	5,02%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	2.097.466,70	42.853.641,23	4,89%	
	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	29.538.603,28	240.578.047,92	12,28%	
	PÁTRIA INFRAESTRUTURA V ADVISORY FIP	149.614,50	1.585.913,65	9,43%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	22.652.862,93	476.519.229,23	4,75%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 4.013.166.373,92			

Quadro 49.

Nota 1: Para os fundos de investimentos que compram cotas de fundos de investimentos deve ser considerado, para fins de cumprimento deste artigo, o Patrimônio Líquido do fundo máster, conforme Art. 118 da Portaria MTP 1467/2022.

Nota 2: Observa-se desenquadramento passivo em alguns fundos da Carteira, com resgate de cotas por outros cotistas dos fundos. Considerando o disposto na RESOLUÇÃO CMN Nº 4.963, DE 25 DE NOVEMBRO DE 2021, art. 27, os RPPS poderão manter em carteira, por até 180 (cento e oitenta) dias, as aplicações que passem a ficar desenquadradas em relação a esta Resolução, desde que seja comprovado que o desenquadramento foi decorrente de situações involuntárias, para as quais não tenha dado causa, e que o seu desinvestimento ocasionaria, comparativamente à sua manutenção, maiores riscos para o atendimento aos princípios previstos no art. 1º desta Resolução parag. 1º. Para fins do disposto no caput, são consideradas situações involuntárias: inciso II - resgate de cotas de fundos de investimento por um outro cotista, nos quais o regime próprio de previdência social não efetue novos aportes. Assim sendo, o Comitê deverá manter acompanhando sistemático desses registros de forma a encaminhar à Diretoria as sugestões de movimentações adequadas.

FUNDO DE INVESTIMENTO	DT. DESENQ.	EM 31/01/2024	PRAZO (180 DIAS)	MEDIDA TOMADA
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	26/01/2024	06 dias	23/07/2024	ANALISE EVOLUÇÃO DE APORTES
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	05/12/2023	58 dias	01/06/2024	ANALISE EVOLUÇÃO DE APORTES
DAYCOVAL IBOVSPA ATIVO FI AÇÕES	30/10/2023	94 dias	26/04/2024	ANALISE EVOLUÇÃO DE APORTES

Quadro 50.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

11.7 Enquadramento IV – Limites Gerais – art. 20º - A - Res. CMN 4.963/2021

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA DEZEMBRO/2023 EM R\$ MI)	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (JANEIRO/2024)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 4.963/21
BB DTVM S.A	R\$ 1.497.980,57	R\$ 484.099.538,03	0,0323%	5%
CAIXA	R\$ 502.158,62	R\$ 548.865.083,72	0,1093%	
ITAU	R\$ 878.644,29	R\$ 367.310.125,15	0,0418%	
SAFRA	R\$ 128.764,84	R\$ 301.471.489,10	0,2341%	
BRADESCO	R\$ 659.218,03	R\$ 581.243.643,74	0,0882%	
ICATÚ	R\$ 44.788,66	R\$ 90.756.352,82	0,2026%	
BTG PACTUAL	R\$ 366.881,08	R\$ 402.174.800,80	0,1096%	
SANTANDER	R\$ 326.434,62	R\$ 87.978.721,32	0,0270%	
VINCI	R\$ 51.903,17	R\$ 159.027.017,85	0,3064%	
OCCAM	R\$ 4.857,36	R\$ 109.006.112,60	2,2441%	
PLURAL INVEST	R\$ 62.241,48	R\$ 52.766.581,21	0,0848%	
AZ QUEST	R\$ 22.538,42	R\$ 47.888.512,38	0,2125%	
BC GESTAO	R\$ 3.584,83	R\$ 42.417.370,95	1,1832%	
ARX	R\$ 26.539,85	R\$ 35.623.426,32	0,1342%	
SCHRODER	R\$ 25.789,21	R\$ 28.841.750,67	0,1118%	
DAYCOVAL	R\$ 10.465,83	R\$ 20.265.961,71	0,1936%	
GUEPARDO	R\$ 3.268,87	R\$ 106.119.057,07	3,2463%	
TRIGONO	R\$ 3.382,49	R\$ 54.805.672,84	1,6203%	
TARPON	R\$ 3.673,01	R\$ 99.318.949,38	2,7040%	
RIO BRAVO	R\$ 9.552,78	R\$ 63.107.491,55	0,6606%	
PORTO SEGURO	R\$ 24.941,27	R\$ 103.328.980,12	0,4143%	
CONSTANCIA	R\$ 2.009,99	R\$ 46.241.199,42	2,3006%	
BNP PARIBAS	R\$ 70.006,33	R\$ 108.189.470,82	0,1545%	
KINEA	R\$ 139.434,58	R\$ 26.743.224,16	0,0192%	
PATRIA INVEST	R\$ 46.172,32	R\$ 29.688.217,78	0,0643%	
CLARITAS	R\$ 6.532,26	R\$ 15.887.622,41	0,2432%	

Quadro 51.

Nota 1: Para fins desse enquadramento, é aplicado o Ranking ANBIMA, atualizado bimestralmente, para o Gestores de Recursos de Terceiros.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

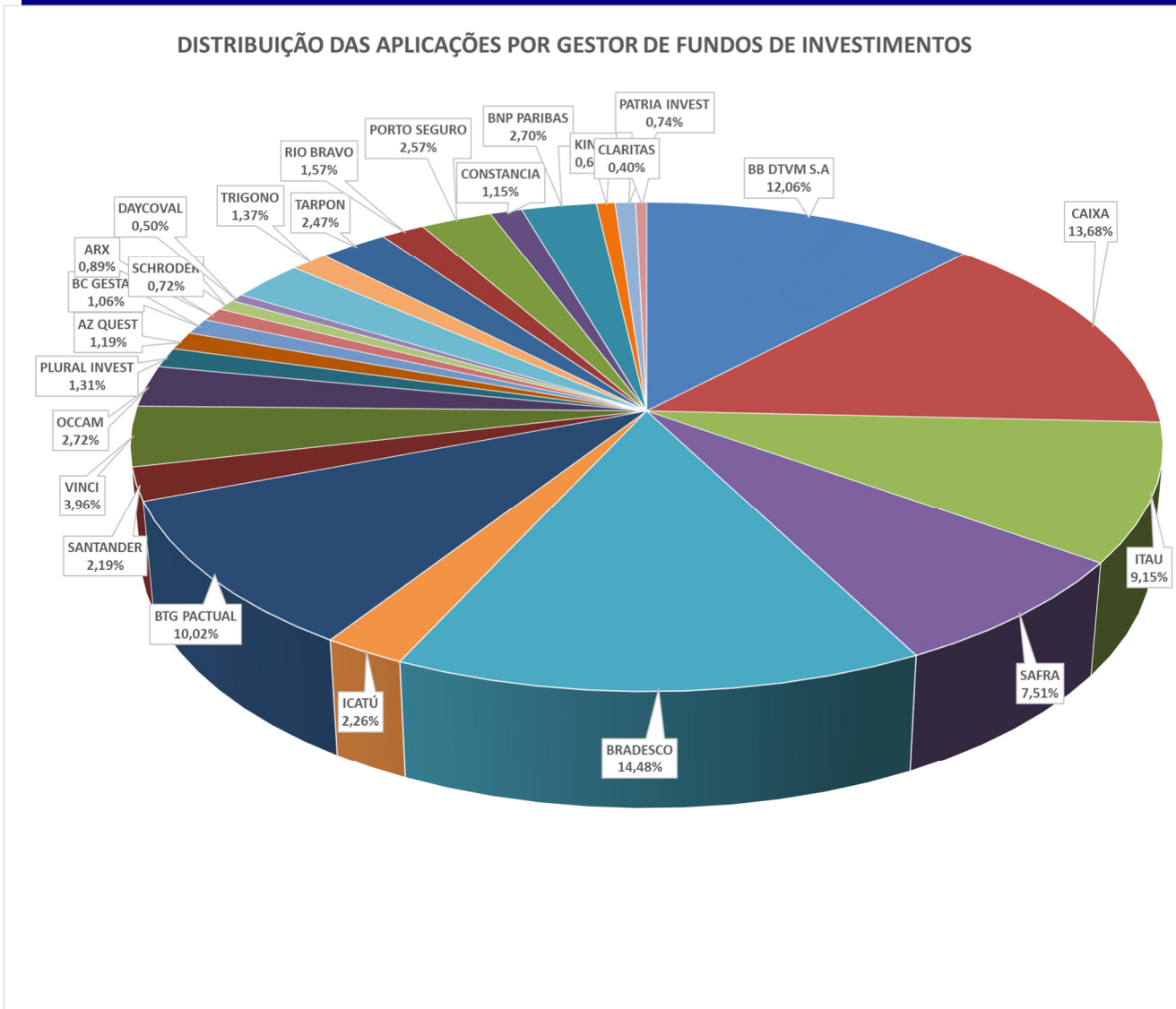


Gráfico 11.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.013.166.373,92
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 4.027.810.410,21
TÍTULOS - CVS	R\$ 5.261.826,75
IMÓVEIS	R\$ 69.752.789,32
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 54.117.917,25
TOTAL	R\$ 8.170.109.317,45

Quadro 52.

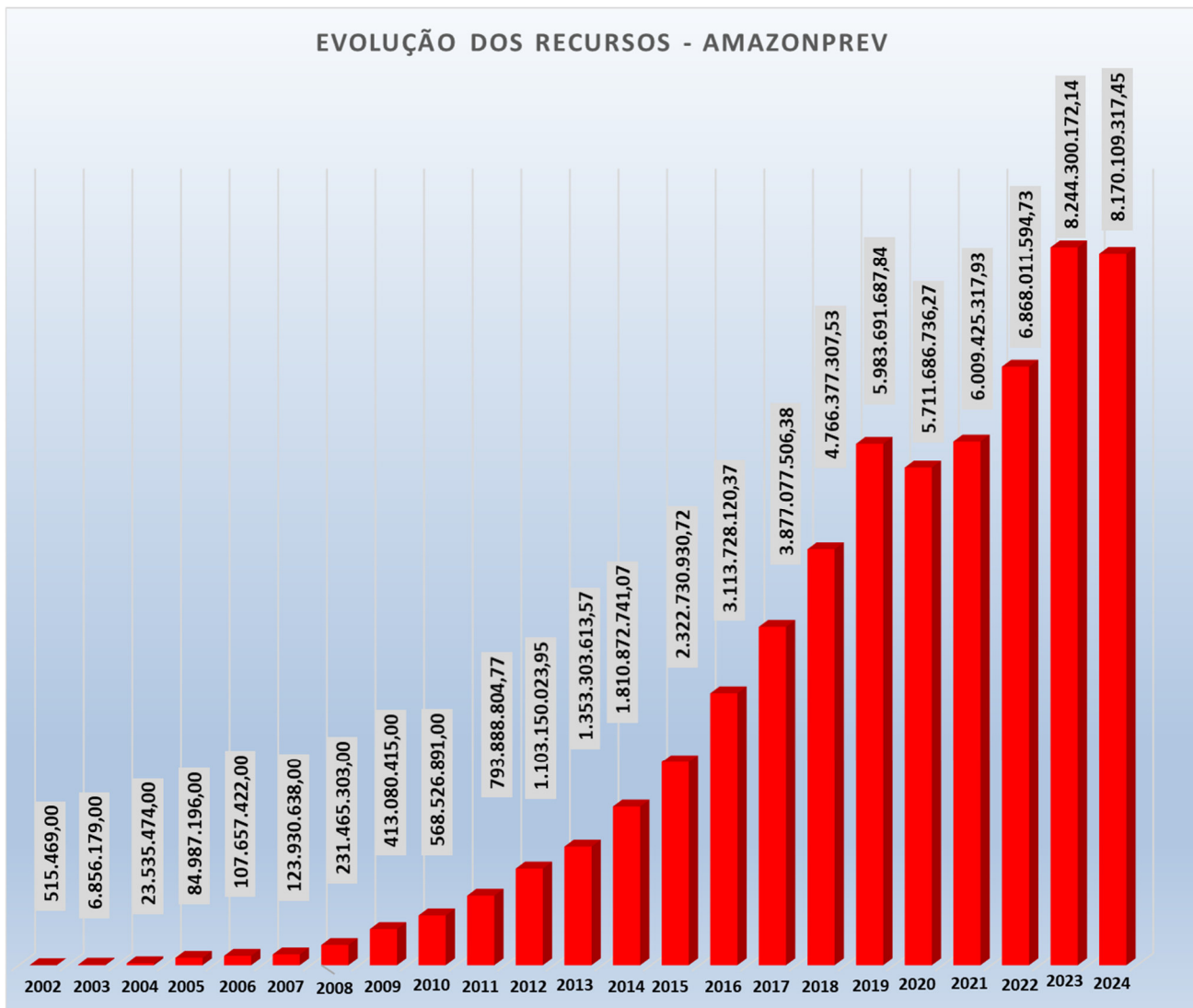


Gráfico 12.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
 Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
 Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV/EXECUTIVO	a) Novos Recursos: Aplicar no fundo ITAU INST. RF REFERENCIADO DI FI (00.832.435/0001-00).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2024
	b) Recursos Atuais: Migrar R\$ 35 milhões do fundo SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR (20.441.483/0001-77) para o fundo INTER CORPORATE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO (36.443.522/0001-05).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2024
	c) Pagamento de CUPOM: Direcionar o recurso proveniente da antecipação dos juros, referente ao fundo CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF (22.791.074/0001-26), para o fundo CAIXA FI BRASIL REF DI LP (CNPJ 03.737.206/0001-97).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2024
	d) Fundo de Capital Protegido: Direcionar o recurso proveniente do fundo de capital protegido RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM, cujo vencimento ocorrerá no dia 19/02/2024, para o novo fundo de capital protegido RIO BRAVO PROTEÇÃO IBOVESPA I.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2024
FPREV/ASSEMBLEIA	a) Novos Recursos: Aplicar no fundo ITAU INST. RF REFERENCIADO DI FI (00.832.435/0001-00).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2024
FPREV/TCE, TJA, MPE, DPE	a) Novos Recursos TCE/TJA/MPE/DPE: aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2024
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE, FPPM)	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público ou CDB Fácil Bradesco, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2024
RECURSOS COMPREV	Novos recursos: Aplicar no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2024
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Novos Recursos: Aplicar no fundo Maxi Poder Público ou CDB Fácil Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2024
AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS	Mantida a estratégia de aquisição de títulos públicos federais, em atendimento a Política Anual de Investimentos, bem como a ALM. Sendo utilizados recursos aplicados em fundos indexados ao CDI e IMA. Estratégia válida para todos os Poderes.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2024
REUNIÃO COFIS/CONAD	Participação do Coordenador do COMIV nas reuniões ordinárias dos Conselhos Fiscal e de Administração, conforme definido nos Normativos Internos.	COMIV	04 e 05/03/2024
REUNIÕES COM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS	Agendada reuniões presenciais com as Instituições Financeiras Credenciadas, para fins de apresentação de produtos aderentes a Política, bem como, perspectivas para o exercício/2024, ficam assim definidas as datas: Banco do Brasil – dia 23/02/2024; Trígono – dia 29/02/2024; Bradesco – dia 01/03/2024 e BTG – dia 14/03/2024.	COMIV	15/03/2024
DILIGÊNCIAS	Visita a Inspira e a V.tal, duas empresas pertencentes ao FIP Economia Real, de Private Equity de 2020.	COMIV/DIRAF	20 e 21/02/2024
ENVIO DO DAIR A SPREV VIA CDPREV	Atualização das informações concernentes a carteiras de investimentos, aplicações e resgates, bem como, o total de recursos do RPPS.	COMIV	29/02/2024

Quadro 53.

Nota: O Plano de Ação Mensal refere-se às ações programadas para o próximo período conforme registro em Ata de Reunião do Comitê.

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2



Relatório de Investimentos – janeiro/2024

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação AMAZONPREV – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente **no dia 16 de fevereiro de 2024**, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de **janeiro/2024**, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas movimentações dos recursos do RPPS.

O Relatório da Carteira da Amazonprev reflete os resultados sobre 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.

O Comitê vem acompanhando sistematicamente os desenquadramentos em alguns Fundos de Investimentos, conforme registrado no quadro 50, pág. 36 deste Relatório. Trata-se de limite com base no Patrimônio Líquido do fundo, e que nesse caso, é permitido manter em carteira, conforme decisão colegiada, por até 180 (cento e oitenta dias).

Todas as operações efetuadas foram devidamente autorizadas pela Diretoria, com registro nas Atas de Reunião do Comitê de 15 de dezembro de 2023.

Assinado Eletronicamente
Claudinei Soares
Coordenador

Assinado Eletronicamente
Bruno Barroso
Secretário

Assinado Eletronicamente
Bruno Novo
Membro

Assinado Eletronicamente
Leonardo Cavalcanti
Membro

Assinado Eletronicamente
Wellington Guimaraes
Membro

Assinado Eletronicamente
André Bentes
Membro

Assinado Eletronicamente
Augusto Netto
Membro

Assinado Eletronicamente
Nuno Ponce
Membro

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/02/2024 10:06:33
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/02/2024 08:23:08
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 26/02/2024 09:41:34

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/02/2024 14:15:35
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEO GONCALVES em 20/02/2024 08:52:18
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 20/02/2024 08:47:51
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/02/2024 09:38:48
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 20/02/2024 09:58:27

Documento assinado eletronicamente 448446/2024
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: NDQ4NDQ2

