

Relatório de Investimentos – Agosto/2022

Processo: **2022.A.06381**

Destino: **DIRAF / PRESI**

Assunto: **Relatório de Investimentos – agosto/2022**

Data: **16/09/2022**

RELATÓRIO Nº. 045 / 2022-COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **agosto/2022**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 07);
- 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 08 a 15);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 16 a 18);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (páginas 19 a 20);
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (páginas 21 a 22)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (páginas 23 a 24)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 25 a 26)
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (páginas 27 a 28)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 29 a 30)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 31)
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 32 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) Relatório de Riscos da Carteira (páginas 41 a 49)
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 50).

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:01
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Brasil: O Banco Central elevou a taxa básica de juros de 13,25% para 13,75%.

Mundo: Powell reafirma necessidade de manter juros elevados por período prolongado.

O Banco Central elevou a taxa básica de juros em 50 pb, de 13,25% para 13,75%. O Copom entendeu que a decisão é compatível com a estratégia de convergência da inflação para o redor da meta ao longo do horizonte relevante, que inclui o ano calendário de 2023 e, em menor grau, o de 2024. De acordo com o comunicado, o Banco Central avalia que o ambiente externo se manteve adverso e volátil, com maiores revisões negativas para o crescimento global e um ambiente inflacionário persistente. Domesticamente, a inflação ao consumidor continuou elevada, ao passo que os indicadores de atividade econômica apontam crescimento ao longo do segundo trimestre, com retomada no mercado de trabalho acima da expectativa do Comitê. No balanço de riscos, o Copom elencou fatores em ambas as direções: de um lado, pressões inflacionárias globais e possíveis estímulos fiscais domésticos adicionais; de outro, reversão dos preços de commodities e possibilidade de desaceleração da atividade econômica mais acentuada. O Comitê ponderou que a possibilidade de medidas fiscais de estímulo à demanda se tornarem permanentes acentua os riscos de alta no cenário, mas, por outro lado, o aumento do risco de desaceleração da economia global também reforça os riscos de baixa. Sobre os próximos passos, o Copom avaliará a necessidade de um ajuste residual de menor magnitude, ressaltando que o atual estágio do ciclo de ajuste e os impactos defasados da política monetária demandam cautela. Em nossa avaliação, o Banco Central deverá manter a Selic em 13,75% nas próximas reuniões.

Em agosto, a prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) recuou 0,73%, ante avanço de 0,13% em julho. A inflação acumulada em 12 meses recuou de 11,4% para 9,6%. A maior surpresa ficou por parte de Alimentação no Domicílio (1,24%), grupo para o qual havia expectativa de arrefecimento maior quando comparado com o IPCA de julho. Em linhas gerais, grande parte da desaceleração no resultado do mês ocorreu por combustíveis e energia elétrica, que ainda refletem a redução de tributos estaduais e federais. Especificamente para esses dois itens, energia elétrica apresentou redução de 3,3%, enquanto gasolina e combustíveis de forma geral vieram em linha com nossa expectativa (-16,8% e -15,6%). Apesar do resultado acima da nossa expectativa para o índice como um todo, entende-se que tanto a desaceleração de alimentos, esperada para as próximas leituras, quanto a continuidade da queda de combustíveis, devido a reajustes de preços, devem contribuir para variações menores do IPCA.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

Em discurso no Simpósio de Jackson Hole, Jerome Powell (presidente do Fed) reforçou o foco na estabilidade de preços, necessária para a sustentabilidade de um mercado de trabalho robusto. Para o retorno da inflação à meta, Powell reconheceu a necessidade de menor crescimento e piora suave no emprego, com implicações negativas para famílias e negócios. Sobre os próximos passos de política monetária, Powell afirmou que a decisão de setembro depende totalmente da evolução dos dados, ao passo que a política monetária restritiva deverá ser mantida por algum tempo. Em nossa avaliação, o discurso enfatizou o combate à inflação, não abrindo qualquer margem para uma interpretação de leniência no combate à alta de preços. O discurso é compatível com a nossa visão de aperto monetário mais intenso do que o projetado pelo Fed na reunião de junho. Acredita-se que atividade econômica seguirá exibindo resiliência e que a desinflação ocorrerá de forma lenta, resultando em aperto adicional da taxa de juros para 4% ao final do ciclo.

Desaceleração da economia chinesa em julho reforça os desafios para a retomada do restante do ano. Mesmo com alívio significativo das restrições de mobilidade por conta do controle dos casos de Covid-19, sinais de enfraquecimento tanto do lado do consumo como do setor imobiliário seguem presentes. No mês passado, na comparação interanual, a produção industrial cresceu 3,8%, abaixo do esperado (4,3%) e do observado em junho (3,9%). Os investimentos em ativos fixos, no acumulado do ano, avançaram 5,7%, com destaque para a queda de 6,4% do segmento imobiliário e para a alta de 7,4% das inversões em infraestrutura. Por fim, as vendas do varejo subiram 2,7% em julho, acumulando retração de 0,2% no ano. Dessa forma, levando em conta todos os indicadores referentes a julho já conhecidos, tem-se sinais de perda de tração da economia, a despeito dos estímulos já adotados e do certo alívio dos controles da pandemia. Diante disso, entende-se que os riscos para a economia chinesa seguem assimétricos para um menor crescimento e que novos estímulos serão adotados, apenas moderadamente. (Fonte: BRAM – Síntese Mensal – setembro/2022).

Perspectivas Renda Fixa

A fala mais dura do presidente do Fed Jerome Powell, durante o simpósio de Jackson Hole, fez com que as taxas de juros americanas subissem e o impacto no vencimento de 2 anos levou a taxa ao maior nível dos últimos 15 anos. O posicionamento do presidente do Fed trouxe uma mudança sobre uma expectativa de reversão precoce do aperto monetário por parte dos grandes bancos centrais. Dito isso, tem-se em uma nova fase, em que o movimento coordenado por parte dos bancos centrais de alta de juros pode seguir, mesmo que promova uma desaceleração mais forte da atividade econômica. Adicionalmente, vê-se sinais mistos, onde a atividade industrial está desacelerando no mundo e os preços das commodities cederem, porém os dados de serviços seguem indicando uma aceleração.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

Lembrando que o ambiente ainda é cercado por uma política COVID zero na China e o conflito no leste europeu.

Seguindo o ambiente citado acima, as taxas de juros de países emergentes subiram, porém o indicador de risco ficou abaixo do fechamento do mês anterior. Importante reforçar que essas economias ainda detêm um diferencial de juros atrativo. Nesse sentido, esse movimento de juros no mundo não se traduziu em uma piora de taxas por aqui no Brasil. A taxa de juros fechou devido a um fluxo maior para essa classe. Diferente dos países desenvolvidos, o Banco Central brasileiro se aproxima do final do movimento e tem sinalizado que não será necessário promover novos ajustes. Para o final do ano, a gestão espera uma Selic de 13,75% um PIB de 2,1% e uma inflação de 5,8%. A maior mudança nas projeções da Bradesco Asset ocorreu na inflação para o final do ano, que tem sido impactada pelos cortes nos impostos promovidos pelo governo, acompanhados pela queda no valor cobrado na gasolina por parte da Petrobras. Ao analisarmos as curvas de juros local, percebe-se uma influência do mercado externo nos ativos prefixados, entretanto, termina o mês com uma queda em todos os vencimentos. A mudança de ciclo tem levado os investidores a incrementar o risco dos portfólios de renda fixa com papéis com vencimentos mais longos. Nesse sentido, os ativos que carregam mais risco trouxeram um desempenho nominal maior. O Índice IMA B 5 que representa os ativos atrelados à inflação com vencimento superior a 5 anos, foi o destaque com 2,5%, apesar do momento delicado ainda requerer cautela, dadas as discussões sobre alterações no teto dos gastos para o ano que vem. Do lado prefixado, o IRF M foi destaque com 2,05% apesar desses excelentes desempenhos os índices de renda fixa da Anbima com maior risco de mercado, seguem abaixo do CDI no ano. Adicionalmente, a performance dos ativos de crédito privado e das letras financeiras do tesouro (LFT) superaram o CDI e seguem como destaque no ano. Novamente o desempenho do real foi inexpressivo frente ao dólar. Porém a moeda americana tem se apreciado contra outras pelo mundo. Isso mostra o quanto nossos ativos estão mais atrativos, quando é considerado o nível de juros, principalmente. O real subiu aproximadamente 0,18% no mês e no ano segue com alta de 7,2%, o dólar fechou o mês cotado a R\$ 5,179.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

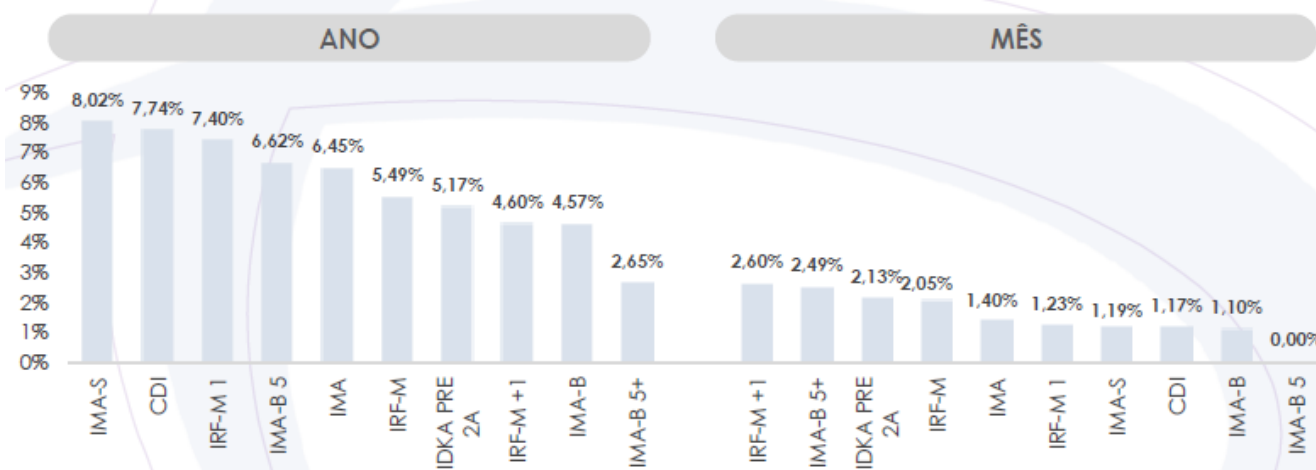
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Fonte: Carta do Gestor Setembro/2022 – BRAM.

Perspectivas Renda Variável

O ambiente de juros foi o grande influenciador dos mercados neste mês. Do lado dos EUA, o discurso mais cauteloso do Fed provocou aumento das taxas futuras, levando as ações americanas a perderem impulso a partir da 2ª quinzena do mês, encerrando, assim, com retorno negativo. Já no Brasil, a perspectiva do fim do ciclo de altas da SELIC, o bom desempenho da economia local e o preço atrativo atraíram fluxo de investidores estrangeiros levando o Ibovespa a ter performance positiva e de destaque no mundo.

O ambiente favorável para os ativos brasileiros influenciou positivamente as Small Caps e as empresas de crescimento, que são sensíveis a taxa de juros. Apesar do ambiente positivo local, no mundo, o cenário permanece desafiador dado que a batalha contra a inflação segue forte, e os riscos para o desaquecimento global também geram preocupação, à medida que os preços de energia seguem pressionados pela extensão do conflito Rússia x Ucrânia, e na China permanecem as dificuldades relacionadas ao Covid e desalavancagem da indústria de construção civil.

Assim, o S&P 500 teve queda de 4,13% e o Ibovespa, alta de 6,16%. Estes índices acumulam desvalorização no ano de 16,41% e valorização de 4,48% respectivamente e em moeda original.

A gestão segue cautelosa em relação a renda variável para o curto prazo, porém as surpresas positivas com a atividade local e os preços das empresas em patamar de elevado desconto leva os gestores a ter uma visão positiva para o médio e longo prazo. Neste contexto, segue a visão de adotar portfólios diversificados. A visão é construtiva para o médio prazo, devido a capacidade e experiência das empresas listadas em continuar apresentando resultados positivos mesmo em momentos mais desafiadores.

Sobre a performance setorial, os setores de Varejo e Energia (Petróleo) foram destaque positivo em função do ambiente mais favorável para juros e do equilíbrio entre oferta e demanda do petróleo. Na

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

ponta contrária, o setor de Mineração Siderurgia continua sofrendo queda em função da maior preocupação com a atividade na China, seguido por Papel & Celulose que sofre influência da desvalorização do Dólar.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	AGOSTO	2022	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	-4,24%	-17,02%	-12,55%	12,99%	35,15%
MSCI WORLD USD	-4,33%	-18,70%	-16,36%	7,00%	22,86%
IDIV	4,27%	11,21%	4,28%	24,51%	19,98%
IBOVESPA	6,16%	4,48%	-7,79%	10,22%	8,29%
SMALL CAPS	10,90%	-6,33%	-22,24%	-9,06%	-3,56%
IBRX100	6,15%	4,48%	-8,18%	10,99%	9,74%

Fonte: Carta do Gestor Setembro/2022 – BRAM.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>

e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1. SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID TP VII	R\$ 7.475.880,58	R\$ 7.564.946,81	0,3112	0,8236	1,1913	2,3422%	9,3466%	12,7810%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 55.107.688,85	R\$ 53.480.639,30	0,2200	(0,3300)	(0,1500)	-0,2606%	5,5200%	8,7000%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 99.462.434,31	R\$ -	0,3300	-	-	0,3300%	0,0000%	0,0000%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 3.070.154,92	R\$ -	(0,4400)	(0,9800)	-	-1,4157%	0,0000%	0,0000%
SAFRA SOBERANO REGIM PROP DI	R\$ 204.857.760,09	R\$ 168.465.719,06	1,0200	1,0300	1,1700	3,2546%	7,6900%	NC
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 23.377,89	R\$ -	0,7900	0,8000	0,6100	2,2161%	6,7710%	10,0018%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 369.997.296,64	R\$ 229.511.305,17						
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 41.573,90	R\$ 16.609,35	0,9700	0,9891	1,1300	3,1209%	7,3978%	9,7924%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 11.621.219,43	R\$ 242.990.624,04	1,0800	1,0800	1,2100	3,4079%	8,1400%	10,9000%
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 124.732.363,05	R\$ 87.458.573,13	1,0606	1,0069	1,1872	3,2901%	7,9261%	NC
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 23.357.019,46	R\$ 23.633.404,35	1,0259	1,0362	1,1833	3,2806%	7,8983%	NC
ICATU VANGUARD FIF PLUS LP	R\$ 103.743.303,55	R\$ 105.033.198,80	0,9700	0,9800	1,2400	3,2238%	8,0500%	NC
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 98.202.720,17	R\$ 99.341.729,99	1,0200	1,0200	1,1600	3,2342%	7,7400%	10,2300%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 361.698.199,56	R\$ 558.474.139,66						
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 37.287.243,45	R\$ 37.597.195,07	0,1900	0,1500	0,8300	1,1731%	7,5000%	10,1500%
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 114.152.405,66	R\$ 115.583.881,30	1,0772	1,1003	1,2540	3,4708%	8,4882%	10,9826%
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 126.817.461,76	R\$ 128.415.587,17	1,0900	1,1000	1,2600	3,4897%	8,3900%	11,3100%
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 78.510.404,12	R\$ 79.520.888,70	1,1500	1,0900	1,2900	3,5716%	9,0100%	12,3000%
MAG CRED PRIV FI RF LP	R\$ 51.137.697,43	R\$ 51.786.728,07	1,0900	1,1000	1,2700	3,5000%	8,4800%	11,1300%
PORTO SEGURO FI REFER DI CRED PRIV	R\$ 108.778.682,73	R\$ 128.180.868,84	1,0477	1,0804	1,2300	3,3957%	8,2600%	11,2000%
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REF CP	R\$ 24.385.694,79	R\$ 42.746.066,11	1,0800	1,0748	1,2133	3,4060%	5,3173%	NC
RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 11.729.002,50	R\$ 11.875.664,09	-	1,1100	1,2500	2,3739%	8,4800%	NC
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 552.798.592,44	R\$ 595.706.879,35						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.284.494.088,64	R\$ 1.383.692.324,18						

Quadro 1.

Nota 1: As movimentações tiveram como base a **Ata de reunião COMIV nº. 189/2022**, devidamente autorizadas pela Diretoria: **a) Novos Recursos:** Ratear entre os fundos: BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REFERENCIADO - CP (09.636.393/0001-07), MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP (19.488.768/0001-84), PORTO SEGURO FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO (CNPJ: 18.719.154/0001-01) e RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF (09.543.255/0001-75), com atenção aos limites estabelecidos pela legislação vigente; **b) Recursos Atuais:** Resgatar o saldo total aplicado no Fundo ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF para o Fundo Bradesco DI Premium.), direcionado para o fundo Bradesco DI Premium. c) **Resgatar** o montante de R\$ 38.400.000,00 do Fundo de do Fundo Safra Soberao Regime Próprio (10.347.195/0001-02) para o Fundo Bradesco DI Premium. d) **Resgatar** o montante de R\$ 38.400.000,00 do Fundo Caixa FI Brasil DI para o Fundo Bradesco DI Premium. e) **Resgatar** o saldo total aplicado no Fundo Safra IMA-B Institucional FI FIC para o Fundo SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF. f) **Resgatar** o saldo total aplicado no SANTANDER SELEÇÃO CRESC SENIOR para o Fundo BRADESCO DI PREMIUM. g) **Resgatar** o saldo total aplicado no BTG FIQ FIA DIVIDENDOS para o Fundo Bradesco DI PREMIUM. h) **Resgatar** o saldo total aplicado no ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC para o Fundo Bradesco DI PREMIUM.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 63.959.742,13	R\$ 68.688.601,92	(12,6900)	3,5500	7,3900	-2,9092%	0,8900%	-6,2500%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 70.379.718,86	R\$ 74.586.766,51	(10,7300)	3,7800	5.9800	-1,8155%	-2,4500%	-14,3400%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 96.984.185,60	R\$ 101.606.834,90	(11,6083)	4,1663	4,7663	-3,5371%	-0,1762%	-5,1682%
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 48.394.656,95	R\$ 51.166.443,53	(12,7645)	4,0451	5,7274	-4,0373%	2,0353%	-5,0690%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 112.829.354,10	R\$ 120.594.163,52	(15,2400)	5,8100	6,8893	-4,1368%	-1,4462%	-16,7154%
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 36.996.542,73	R\$ 38.654.327,00	(12,6400)	5,6800	4,4800	-3,5419%	-5,9800%	-24,8300%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 182.505.088,95	R\$ 192.976.974,35	(10,7400)	8,5100	5,7400	2,4156%	-0,4200%	-26,8800%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 1.964,44	R\$ -	(9,1900)	3,8500	-	-5,6938%	NC	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT	R\$ 12.044.283,75	R\$ 12.811.676,95	(10,5244)	4,1632	6,3714	-0,8612%	6,7841%	1,6408%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇOES	R\$ 16.985.689,14	R\$ 18.222.996,27	(11,1261)	4,5949	7,2844	-0,2710%	5,6850%	-11,6480%
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 75.844.622,52	R\$ 80.130.639,42	(9,4100)	3,8500	5,6500	-0,6069%	4,4000%	-10,4400%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 124.515.733,94	R\$ 132.656.704,94	(11,1100)	6,0100	6,5400	0,3951%	3,1300%	-11,2900%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 68.720.287,14	R\$ 75.037.787,45	(14,3700)	5,0900	9,1900	-1,7415%	-1,7400%	-15,6300%
OCCAM FIC FIA	R\$ 104.535.614,17	R\$ 111.964.156,55	(8,9200)	3,4100	7,1100	0,8824%	6,3100%	-5,2200%
SANTANDER CRESC SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 12.221,22	R\$ -	(11,6898)	-	-	-11,6898%	NC	
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 93.092.350,93	R\$ 98.584.592,22	(11,5200)	4,5900	5,9000	-1,9988%	0,9400%	-10,8400%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 55.490.095,44	R\$ 61.289.558,51	(9,5000)	10,4513	7,3400	7,2954%	13,6303%	NC
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 34.903.937,47	R\$ 37.279.848,44	(9,1600)	5,1100	6,8100	1,9842%	6,0100%	-5,9000%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 38.163.848,02	R\$ 41.726.842,78	(14,1914)	8,9939	9,3400	2,2615%	6,1300%	-5,7500%
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.284.169,73	R\$ 4.669.047,29	(15,3320)	6,1399	8,9800	-2,0635%	12,0100%	4,2500%
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 55.380.786,75	R\$ 60.999.121,19	(10,3797)	9,6744	10,1449	8,2620%	14,9754%	NC
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 40.167.416,49	R\$ 43.429.531,45	(7,5100)	4,2500	8,2000	4,3273%	7,9200%	-1,4300%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.051.380,58	R\$ 4.323.453,11	(10,1100)	6,8600	6,7200	2,5114%	-3,7600%	-7,4800%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 40.060.059,45	R\$ 42.814.048,22	(10,7700)	4,6700	6,8700	-0,1866%	9,1400%	-0,6500%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 13.683.336,29	R\$ 14.562.742,28	(13,6700)	5,2600	6,3000	-3,4042%	-3,0321%	NC
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 1.393.987.086,79	R\$ 1.488.776.858,80						
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.393.987.086,79	R\$ 1.488.776.858,80						

Quadro 2.

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 20.845.652,93	R\$ 20.511.319,03	(1,0765)	7,7314	(1,6038)	4,8625%	-21,0507%	-11,0961%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 33.580.882,66	R\$ 32.331.654,65	2,3781	6,6618	(3,7201)	5,1361%	-21,5949%	-10,1924%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 15.459.865,67	R\$ 16.205.496,59	(0,0648)	12,4459	4,8230	17,7929%	-52,7887%	-54,8933%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 64.404.135,23	R\$ 62.387.040,38	(0,5287)	6,7782	(3,1277)	2,8916%	-27,6896%	-21,8480%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 25.222.958,29	R\$ 24.322.543,94	0,3300	7,6700	(3,5700)	4,1688%	-24,5498%	-18,2255%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exte	R\$ 159.513.494,78	R\$ 155.758.054,59						
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 96.865.216,19	R\$ 92.967.870,98	0,1007	7,8263	(4,0234)	3,5922%	-24,4613%	-14,3901%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 46.332.131,88	R\$ 44.288.084,86	1,3600	7,2300	(4,4100)	3,8952%	-28,0897%	NC
ITAU BDR NIVEL I AÇÕES FIC	R\$ 36.739.549,02	R\$ 35.342.131,79	0,1900	5,3600	(3,8000)	1,5489%	-12,6869%	NC
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 179.936.897,09	R\$ 172.598.087,63						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 339.450.391,87	R\$ 328.356.142,22						

Quadro 3.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

2.4 SALDOS E PERFORMANCE – FUNDOS ESTRUTURADOS

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 28.700.262,04	R\$ 27.800.476,47	(7,8200)	10,2084	(3,1400)	-1,5999%	-11,9199%	NC	
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV FIM	R\$ 16.885.551,39	R\$ 16.950.616,27	0,2247	0,7865	0,3853	1,4022%	13,3730%	NC	
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 17.015.454,68	R\$ 16.166.077,98	-	0,4060	(4,9919)	-4,6062%	-4,6062%	NC	
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MM	R\$ 14.580.759,55	R\$ 15.011.282,91	(1,9700)	1,5400	2,9500	2,4761%	0,1650%	NC	
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MM	R\$ 9.946.720,34	R\$ 10.379.509,40	2,1300	(2,7900)	4,3500	3,5993%	1,9733%	NC	
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 87.128.748,00	R\$ 86.307.963,03							
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 35.539.242,01	R\$ 35.364.052,01	(0,6700)	(15,1400)	(0,1500)	-15,8350%	59,0000%	44,2019%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 12.645.275,01	R\$ 12.677.004,10	(1,5700)	(0,5200)	(0,3100)	-2,3854%	8,8200%	6,1118%	
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 238.039,76	R\$ 225.170,33	-	(1,5800)	(5,4100)	-6,9045%	-6,9045%	NC	
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 10.870.572,37	R\$ 10.617.325,13	36,6872	(1,6722)	(2,3297)	31,2704%	-12,6394%	NC	
TOTAL art. 10º, inciso II	R\$ 59.293.129,15	R\$ 58.883.551,57							
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 146.421.877,15	R\$ 145.191.514,60							
TOTAL GERAL	R\$ 3.164.353.444,45	R\$ 3.346.016.839,80							

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.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

2.5 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	jun/22	jul/22	ago/22
ITAÚ	R\$ 440.388.179,83	R\$ 455.019.129,92	R\$ 470.793.941,34
BTG PACTUAL	R\$ 332.316.925,99	R\$ 337.902.236,57	R\$ 348.339.395,63
BANCO DO BRASIL	R\$ 329.235.464,76	R\$ 293.922.611,71	R\$ 297.450.819,60
ICATU	R\$ 312.461.940,52	R\$ 316.337.603,83	R\$ 222.761.033,29
CAIXA	R\$ 274.528.967,95	R\$ 225.785.341,72	R\$ 186.867.583,63
SAFRA	R\$ 249.073.640,23	R\$ 254.260.046,89	R\$ 212.753.803,92
SANTANDER	R\$ 169.185.162,41	R\$ 178.568.762,11	R\$ 177.970.921,68
VINCI PARTNERS	R\$ 122.454.659,17	R\$ 128.234.328,16	R\$ 136.089.610,99
BRADESCO	R\$ 118.472.210,82	R\$ 124.492.147,43	R\$ 363.601.396,91
OCCAM BRASIL	R\$ 101.091.099,72	R\$ 104.535.614,17	R\$ 111.964.156,55
PORTO SEGURO	R\$ 96.004.644,05	R\$ 108.778.682,73	R\$ 128.180.868,84
AZ QUEST	R\$ 67.816.908,32	R\$ 70.379.718,86	R\$ 74.586.766,51
ARX	R\$ 61.767.416,72	R\$ 63.959.742,13	R\$ 68.688.601,92
GUEPARDO	R\$ 51.673.902,96	R\$ 55.490.095,44	R\$ 61.289.558,51
TARPON	R\$ 50.495.632,16	R\$ 55.380.786,75	R\$ 60.999.121,19
MONGERAL	R\$ 48.240.876,93	R\$ 51.137.697,43	R\$ 51.786.728,07
PLURAL INVEST GESTÃO	R\$ 45.270.425,38	R\$ 49.040.748,33	R\$ 48.537.151,24
4UM INVESTIMENTOS	R\$ 41.476.823,13	R\$ 44.218.797,07	R\$ 47.752.984,56
TRÍGONO CAPITAL	R\$ 40.254.500,69	R\$ 42.448.017,75	R\$ 46.395.890,07
CONSTANCIA	R\$ 38.271.088,54	R\$ 40.060.059,45	R\$ 42.814.048,22
BRASIL CAPITAL	R\$ 35.009.739,46	R\$ 36.996.542,73	R\$ 38.654.327,00
RIO BRAVO	R\$ 24.591.780,84	R\$ 36.256.482,39	R\$ 37.266.456,40
SCHRODER	R\$ 23.427.131,15	R\$ 25.222.958,29	R\$ 24.322.543,94
DAYCOVAL	R\$ 16.239.496,26	R\$ 16.985.689,14	R\$ 18.222.996,27
CLARITAS INVESTIMENTOS	R\$ 12.999.797,97	R\$ 13.683.336,29	R\$ 14.562.742,28
BNP PARIBAS	R\$ 12.515.596,19	R\$ 24.385.694,79	R\$ 42.746.066,11
INTRAG TVM	R\$ 11.055.441,22	R\$ 10.870.572,37	R\$ 10.617.325,13
TOTAL	R\$ 2.990.480.470,28	R\$ 3.164.353.444,45	R\$ 3.346.016.839,80

FONTE: COFIN / COMIV

Quadro 5.

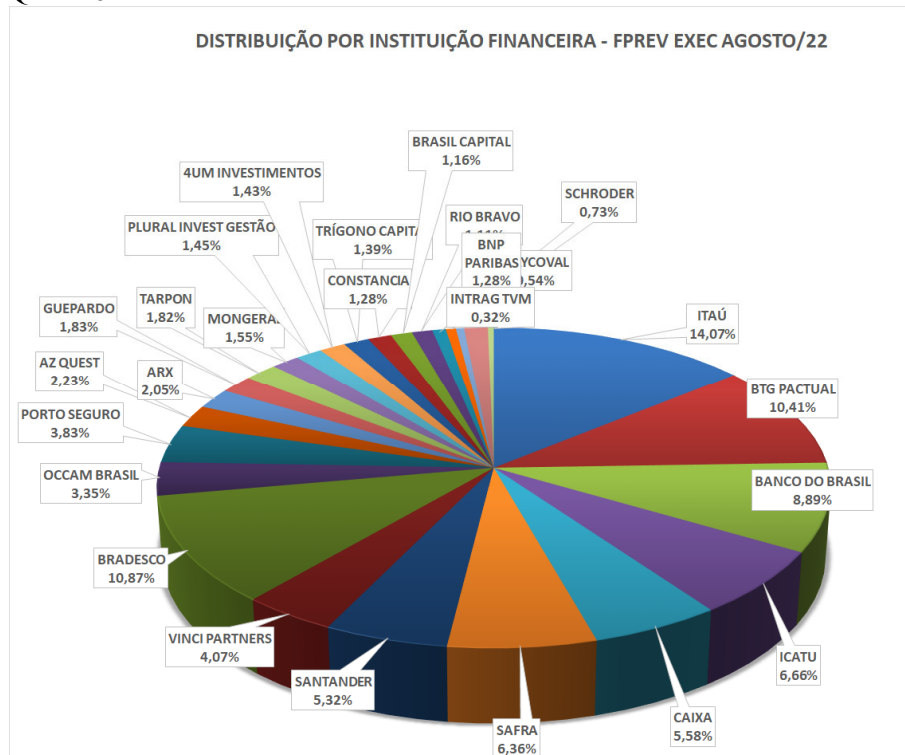


Gráfico 1.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

2.6 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TPF (COMPRA - VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 188.794.750,65	R\$ 189.101.934,00	1,1981	- 0,1590	0,1627	1,2016%	8,8547%	13,7466%
NTN-B (02/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 52.180.985,24	R\$ 52.267.932,42	1,2021	- 0,1551	0,1666	1,2135%	7,6207%	NC
NTN-B (09/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 52.043.251,53	R\$ 52.124.665,01	1,1918	- 0,1652	0,1564	1,1826%	7,3236%	NC
NTN-B (22/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 103.589.901,91	R\$ 103.752.927,07	1,1927	- 0,1643	0,1574	1,1855%	6,8141%	NC
NTN-B (23/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 103.532.801,82	R\$ 103.695.168,66	1,1922	- 0,1648	0,1568	1,1838%	6,7536%	NC
NTN-B (24/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 103.506.571,98	R\$ 103.673.362,11	1,1965	- 0,1605	0,1611	1,1969%	6,7247%	NC
NTN-B (25/02/2022 - 15/05/23)	R\$ 103.400.046,81	R\$ 103.557.337,78	1,1874	- 0,1695	0,1521	1,1695%	6,6106%	NC
NTN-B (07/03/2022 - 15/05/23)	R\$ 51.246.639,31	R\$ 51.323.790,67	1,1858	- 0,1711	0,1505	1,1648%	5,6852%	NC
NTN-B (08/03/2022 - 15/05/23)	R\$ 102.427.333,69	R\$ 102.583.948,80	1,1882	- 0,1687	0,1529	1,1719%	5,6221%	NC
NTN-B (17/03/2022 - 15/05/23)	R\$ 50.901.099,31	R\$ 50.967.931,30	1,1664	- 0,1903	0,1313	1,1065%	4,9483%	NC
NTN-B (25/01/14 - 15/08/30)	R\$ 197.393.214,35	R\$ 192.631.881,64	1,2076	- 0,1496	0,1721	1,2301%	8,9364%	13,8639%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 204.000.248,26	R\$ 199.220.344,63	1,2313	- 0,1262	0,1956	1,3013%	9,1408%	14,1578%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 205.174.530,78	R\$ 200.320.961,28	1,2076	- 0,1496	0,1721	1,2301%	8,9365%	13,8641%
NTN-B (26/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ 33.496.865,36	R\$ 32.576.330,05	0,4795	- 0,2038	0,1178	0,3928%	0,9602%	NC
NTN-B (26/05/2022 - 15/05/2025)	R\$ 33.486.115,80	R\$ 33.521.905,88	1,1417	- 0,2146	0,1069	1,0325%	1,5925%	NC
NTN-B (26/05/2022 - 15/08/2032)	R\$ 33.481.678,18	R\$ 32.572.598,26	1,1409	- 0,2154	0,1061	1,0301%	1,5676%	NC
NTN-B (27/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ 101.456.820,50	R\$ 98.667.013,94	1,1477	- 0,2087	0,1128	1,0504%	1,5948%	NC
NTN-B (30/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ 101.451.923,48	R\$ 98.663.222,42	1,1466	- 0,2098	0,1117	1,0471%	1,5687%	NC
NTN-B (31/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ 101.497.316,88	R\$ 98.714.501,47	1,1616	- 0,1950	0,1266	1,0922%	1,6291%	NC
NTN-B (31/05/2022 - 15/08/2024)	R\$ 61.378.699,81	R\$ 59.696.114,17	1,1628	- 0,1938	0,1278	1,0957%	1,6339%	NC
NTN B (07/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ 49.993.700,75	R\$ 50.057.374,66	-	- 0,0079	0,1274	0,1194%	0,1194%	NC
NTN B (07/07/2022 - 15/08/2040)	R\$ 49.993.039,39	R\$ 48.617.341,33	-	- 0,0083	0,1277	0,1194%	0,1194%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 2.084.427.535,78	R\$ 2.058.308.587,55						

Quadro 6.

Nota 1: Títulos Públicos atualizados pelo valor de aquisição acrescido da taxa de juros. (Ver quadro 7).

Nota 2: Em agosto, o saldo dos Títulos Públicos está inferior ao mês anterior em virtude do pagamento de cupom de juros.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

2.7 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRASESCO	BANCO DO BRASIL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BRASESCO	BRASESCO	XP INVESTIMENTOS	XP INVESTIMENTOS	BTG PACTUAL	XP INVESTIMENTOS
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 3.830,935404	R\$ 3.846,407779	R\$ 3.867,587413	R\$ 3.870,741565	R\$ 3.871,282262	R\$ 3.879,846559	R\$ 3.892,553987	R\$ 3.894,278534	R\$ 3.928,178170
QUANTIDADE	43.100	13.052	13.000	25.855	25.834	25.831	25.774	12.845	25.678	12.728
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 50.001.368,89	R\$ 50.003.301,13	R\$ 99.996.472,56	R\$ 99.996.737,59	R\$ 99.999.092,10	R\$ 99.999.165,21	R\$ 49.999.855,96	R\$ 99.997.284,19	R\$ 49.997.851,75
VALOR ATUAL	R\$ 189.101.934,00	R\$ 52.267.932,42	R\$ 52.124.665,01	R\$ 103.752.927,07	R\$ 103.695.168,66	R\$ 103.673.362,11	R\$ 103.557.337,78	R\$ 51.323.790,67	R\$ 102.583.948,80	R\$ 50.967.931,30
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	15/01/2014	15/01/2014	15/01/2014	15/01/2014	15/01/2014	15/01/2014	15/01/2014	15/01/2014	15/01/2014
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	02/02/2022	09/02/2022	22/02/2022	23/02/2022	24/02/2022	25/02/2022	07/03/2022	08/03/2022	17/03/2022
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/05/2023	15/05/2023	15/05/2023	15/05/2023	15/05/2023	15/05/2023	15/05/2023	15/05/2023	15/05/2023
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,53%	6,40%	6,41%	6,405%	6,46%	6,345%	6,3250%	6,3550%	6,082%
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRASESCO	BRASESCO	BRASESCO	BTG PACTUAL	ITAU UNIBANCO	ITAU UNIBANCO	XP INVESTIMENTOS	XP INVESTIMENTOS	BRASESCO	XP INVESTIMENTOS
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911	R\$ 4.035,254623	R\$ 3.995,210332	R\$ 4.101,402182	R\$ 4.042,234233	R\$ 4.045,332802	R\$ 4.032,450538	R\$ 4.031,272986
QUANTIDADE	43.450	44.113	44.350	8.177	8.259	8.046	24.738	24.719	24.798	15.000
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45	R\$ 32.996.277,05	R\$ 32.996.442,13	R\$ 32.999.881,96	R\$ 99.996.790,46	R\$ 99.996.581,53	R\$ 99.996.708,44	R\$ 60.469.094,79
VALOR ATUAL	R\$ 192.631.881,64	R\$ 199.220.344,63	R\$ 200.320.961,28	R\$ 32.576.330,05	R\$ 33.521.905,88	R\$ 32.572.598,26	R\$ 98.667.013,94	R\$ 98.663.222,42	R\$ 98.714.501,47	R\$ 59.696.114,17
DATA DE EMISSÃO	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010	17/04/2012	08/01/2020	05/01/2022	17/04/2012	17/04/2012	17/04/2012	17/04/2012
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014	26/05/2022	26/05/2022	26/05/2022	27/05/2022	30/05/2022	31/05/2022	31/05/2022
DATA DO RESGATE	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040	15/08/2024	15/05/2025	15/08/2032	15/08/2024	15/08/2024	15/08/2024	15/08/2024
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,5998%	6,9000%	6,6000%	5,9080%	5,7700%	5,7600%	5,8300%	5,8300%	6,0200%	6,0350%
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRASESCO	XP INVESTIMENTOS								
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 4.023,000603	R\$ 4.077,393693								
QUANTIDADE	12.428	12.262								
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 49.997.851,49	R\$ 49.997.001,46								
VALOR ATUAL	R\$ 50.057.374,66	R\$ 48.617.341,33								
DATA DE EMISSÃO										
DATA DA APLICAÇÃO	07/07/2022	07/07/2022								
DATA DO RESGATE	15/05/2035	15/08/2040								
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,0300%	6,0348%								

Quadro 7.

2.8 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	29/07/2022	31/08/2022
CVS - A	R\$ 932.658,28	R\$ 917.281,40
CVS - B	R\$ 6.033.792,10	R\$ 5.934.307,60
CVS - C	R\$ 120.986,32	R\$ 118.991,60
CVS - D	R\$ 661.685,64	R\$ 650.775,84
TOTAL	R\$ 7.749.122,34	R\$ 7.621.356,44

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.

2.9 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/22	R\$ 25.234,67	R\$ 145.243,31	R\$ 170.477,98
fev/22	R\$ 24.814,21	R\$ 145.243,31	R\$ 170.057,52
mar/22	R\$ 24.417,20	R\$ 145.386,05	R\$ 169.803,25
abr/22	R\$ 24.009,52	R\$ 145.386,05	R\$ 169.395,57
mai/22	R\$ 23.627,78	R\$ 145.687,38	R\$ 169.315,16
jun/22	R\$ 23.240,46	R\$ 145.830,12	R\$ 169.070,58
jul/22	R\$ 22.855,32	R\$ 146.115,60	R\$ 168.970,92
ago/22	R\$ 22.486,35	R\$ 146.416,93	R\$ 168.903,28
TOTAL	R\$ 190.685,51	R\$ 1.165.308,75	R\$ 1.355.994,26

Quadro 9.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

2.10 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2022			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/22	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/22	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
mar/22	R\$ 43.635,72	R\$ -	R\$ 43.635,72
abr/22	R\$ 43.635,72	R\$ 100.364,40	R\$ 144.000,12
mai/22	R\$ -	R\$ -	R\$ -
jun/22	R\$ -	R\$ 445.093,39	R\$ 445.093,39
jul/22	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84
ago/22	R\$ 87.271,44	R\$ -	R\$ 87.271,44
TOTAL	R\$ 261.814,32	R\$ 746.186,59	R\$ 1.008.000,91

Quadro 10.

2.11 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	29/07/2022	31/08/2022	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.164.353.444,45	R\$ 3.346.016.839,80	61,0560%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.084.427.535,78	R\$ 2.058.308.587,55	37,5587%
TÍTULOS CVS	R\$ 7.749.122,34	R\$ 7.621.356,44	0,1391%
IMÓVEIS	R\$ 68.293.435,00	R\$ 68.293.435,00	1,2462%
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -	0,0000%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 20.276.788,84	R\$ 0,06	0,0000%
TOTAL	R\$ 5.345.100.326,41	R\$ 5.480.240.218,85	100,00%

FONTE: COFIN / COMIV

Quadro 11.

2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
ago/21	R\$ 5.028.755.971,61	-0,52%	4,59%	4,82%
set/21	R\$ 4.986.467.576,78	-0,84%	3,71%	7,20%
out/21	R\$ 4.928.789.222,04	-1,16%	2,51%	8,34%
nov/21	R\$ 4.978.953.067,50	1,02%	3,56%	5,92%
dez/21	R\$ 5.138.934.502,37	3,21%	6,88%	6,88%
jan/22	R\$ 5.127.420.463,18	-0,22%	-0,22%	9,29%
fev/22	R\$ 5.183.580.609,21	1,10%	0,87%	11,36%
mar/22	R\$ 5.320.489.330,31	2,64%	3,53%	11,68%
abr/22	R\$ 5.227.351.195,97	-1,75%	1,72%	7,37%
mai/22	R\$ 5.288.544.931,25	1,17%	2,91%	6,07%
jun/22	R\$ 5.200.480.011,20	-1,67%	1,20%	3,00%
jul/22	R\$ 5.345.100.326,41	2,78%	4,01%	5,73%
ago/22	R\$ 5.480.240.218,85	2,53%	6,64%	8,98%

Quadro 12.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 08/2021			R\$ 5.028.755.971,61
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2021	R\$ 41.572.477,52	R\$ 10.674.589,38	R\$ 30.897.888,14
10/2021	R\$ 43.880.558,88	R\$ 10.627.718,85	R\$ 33.252.840,03
11/2021	R\$ 54.114.701,48	R\$ 14.772.501,88	R\$ 39.342.199,60
12/2021	R\$ 94.087.378,25	R\$ 11.974.925,91	R\$ 82.112.452,34
01/2022	R\$ 15.009.670,47	R\$ 10.463.470,04	R\$ 4.546.200,43
02/2022	R\$ 46.741.255,69	R\$ 13.383.817,50	R\$ 33.357.438,19
03/2022	R\$ 46.961.000,94	R\$ 11.439.707,28	R\$ 35.521.293,66
04/2022	R\$ 45.229.260,90	R\$ 10.946.668,23	R\$ 34.282.592,67
05/2022	R\$ 46.172.988,27	R\$ 15.327.214,72	R\$ 30.845.773,55
06/2022	R\$ 47.103.866,59	R\$ 10.942.355,40	R\$ 36.161.511,19
07/2022	R\$ 47.549.359,29	R\$ 10.900.524,10	R\$ 36.648.835,19
08/2022	R\$ 48.163.488,37	R\$ 12.302.988,95	R\$ 35.860.499,42
Saldo dos Investimentos em 08/2022			R\$ 5.480.240.218,85

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	8,7271 %	4,3923 %	-0,3600 %
Juros	4,9500 %	3,2734 %	0,4034 %
Meta	14,1091 %	7,8095 %	0,0420 %
Rentabilidade em %	0,3566 %	1,8725 %	1,8574 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 18.654.722,83	R\$ 97.901.293,92	R\$ 99.279.393,02
Resultado em %	-12,0520 %	-5,5069 %	+1,8147 %
Resultado em R\$	R\$ -718.774.794,55	R\$ -310.305.945,26	R\$ +97.035.800,53

Quadro 13.

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 do Executivo FPREV, registrados sob Regime de Caixa.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMÁZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

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					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 96.663,98	R\$ 97.179,01	0,7900	0,8000	0,6100	2,2161%	6,7700%	9,9800%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 96.663,98	R\$ 97.179,01						
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 308.827,81	R\$ 578.523,29	1,0259	1,0362	1,1833	3,2806%	7,8983%	NC
ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP	R\$ 78.686,09	R\$ 79.664,43	0,9700	0,9800	1,2400	3,2238%	8,0500%	NC
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 80.355,27	R\$ 81.297,44	1,0200	1,0300	1,1700	3,2546%	7,6900%	NC
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 479.687,60	R\$ 485.382,63	1,0606	1,0069	1,1872	3,2901%	7,9261%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 947.556,77	R\$ 1.224.867,79						
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.170.939,32	R\$ 2.188.985,32	0,1900	0,1500	0,8300	1,1731%	7,6000%	10,1500%
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 987.347,79	R\$ 1.000.055,66	1,1500	1,0900	1,2900	3,5716%	9,0100%	12,3000%
TOTAL art. 7º, inciso V, "b"	R\$ 3.158.287,11	R\$ 3.189.040,98						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.202.507,86	R\$ 4.511.087,78						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 436.623,91	R\$ 461.297,73	(9,4100)	3,8500	5,6500	-0,6069%	4,4000%	-10,4400%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.033.699,18	R\$ 1.093.011,39	(10,7400)	8,5100	5,7400	2,4156%	-0,4200%	-26,8800%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 480.507,08	R\$ 511.122,25	(10,5244)	4,1632	6,3714	-0,8612%	6,7841%	1,6408%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.855.942,07	R\$ 1.987.829,60	(8,9200)	3,4100	7,1100	0,8824%	6,3100%	-5,2200%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 98.839,22	R\$ 103.268,13	(12,6400)	5,6800	4,4800	-3,5419%	-5,9800%	-24,8300%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 3.905.611,46	R\$ 4.156.529,10						
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 3.905.611,46	R\$ 4.156.529,10						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.278.498,88	R\$ 1.222.095,01	1,3600	7,2300	(4,4100)	3,8952%	-28,0800%	-19,7400%
TOTAL art. 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 1.278.498,88	R\$ 1.222.095,01						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.278.498,88	R\$ 1.222.095,01						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 714.364,84	R\$ 691.637,33	(7,7100)	10,0200	(3,1800)	-1,6914%	-12,0600%	-5,3300%
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 154.714,39	R\$ 149.752,92	(7,7900)	10,0900	(3,2100)	-1,7446%	-12,1800%	-5,3200%
BTG PACTUAL S&P500 BRL FI MULTIMERCADO	R\$ 325.450,60	R\$ 315.247,36	(7,8200)	10,2100	(3,1400)	-1,5984%	-11,9200%	-4,9200%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 1.194.529,83	R\$ 1.156.637,61						
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 1.194.529,83	R\$ 1.156.637,61						

TOTAL GERAL	R\$ 10.581.148,03	R\$ 11.046.349,50						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
VALORES EM TRANSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL DOS RECURSOS	R\$ 10.581.148,03	R\$ 11.046.349,50						

Quadro 14.

Nota 1: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 189/2022, devidamente autorizada pela Diretoria: **a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BB PREVID RF PERFIL (13.077.418/0001-49).

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.711.517,98	R\$ 2.647.202,68	1,2313	- 0,1262	0,1956	1,3013%	9,1408%	17,8941%
NTN B (12/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ 5.505.658,52	R\$ 5.513.709,49	-	0,1036	0,1462	0,2500%	0,2500%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 8.217.176,50	R\$ 8.160.912,17						

Quadro 15.

Nota 1: Em agosto, o saldo dos Títulos Públicos está inferior ao mês anterior em virtude do pagamento de cupom de juros.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	29/07/2022	31/08/2022
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 4.202.507,86	R\$ 4.511.087,78
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 3.905.611,46	R\$ 4.156.529,10
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.278.498,88	R\$ 1.222.095,01
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 1.194.529,83	R\$ 1.156.637,61
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 8.217.176,50	R\$ 8.160.912,17
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 18.798.324,53	R\$ 19.207.261,67

Quadro 16.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação



Gráfico 2.



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 08/2021	R\$ 16.744.921,39
------------------------------------	-------------------

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2021	R\$ 152.252,38	R\$ 0,00	R\$ 152.252,38
10/2021	R\$ 165.653,56	R\$ 0,00	R\$ 165.653,56
11/2021	R\$ 169.762,40	R\$ 0,00	R\$ 169.762,40
12/2021	R\$ 164.966,52	R\$ 0,00	R\$ 164.966,52
01/2022	R\$ 330.496,56	R\$ 0,00	R\$ 330.496,56
02/2022	R\$ 181.051,78	R\$ 0,00	R\$ 181.051,78
03/2022	R\$ 182.602,86	R\$ 0,00	R\$ 182.602,86
04/2022	R\$ 187.717,42	R\$ 0,00	R\$ 187.717,42
05/2022	R\$ 225.494,08	R\$ 0,00	R\$ 225.494,08
06/2022	R\$ 206.676,04	R\$ 0,00	R\$ 206.676,04
07/2022	R\$ 208.176,70	R\$ 0,00	R\$ 208.176,70
08/2022	R\$ 195.200,20	R\$ 0,00	R\$ 195.200,20

Saldo dos Investimentos em 08/2022	R\$ 19.207.261,67
------------------------------------	-------------------

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
---------------------	----------	--------------------	-------------

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	8,7271 %	4,3923 %	-0,3600 %
Juros	4,9500 %	3,2734 %	0,4034 %
Meta	14,1091 %	7,8095 %	0,0420 %
Rentabilidade em %	0,5188 %	1,6182 %	1,1370 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 92.289,78	R\$ 291.146,69	R\$ 213.736,94
Resultado em %	-11,9099 %	-5,7428 %	+1,0946 %
Resultado em R\$	R\$ -2.413.968,62	R\$ -1.113.278,04	R\$ +205.846,39

Quadro 17.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 4.245.191,27	R\$ 7.352.063,69	1,0800	1,2100	1,0800	4,5454%	8,1400%	10,9000%
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 67.217.629,98	R\$ 68.013.019,86	1,0259	1,1833	1,0362	4,3816%	7,8983%	NC
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 1.728.643,23	R\$ 1.748.911,59	1,0200	1,1700	1,0300	3,2546%	7,6900%	NC
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 8.170.021,33	R\$ 8.267.018,84	1,0606	1,1872	1,0069	4,4020%	7,9261%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 81.361.485,81	R\$ 85.381.013,98						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 81.361.485,81	R\$ 85.381.013,98						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.166.336,02	R\$ 1.218.598,57	(12,6400)	5,6800	4,4800	-3,5419%	-5,9800%	-24,8300%
BB AÇÕES VALOR	R\$ 20.011.613,57	R\$ 20.965.446,10	(11,6083)	4,1663	4,7663	-3,5371%	-0,1762%	-5,1682%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 8.394.575,69	R\$ 9.271.922,02	(9,5000)	7,3851	10,4513	7,3405%	13,6781%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$ 5.724.742,77	R\$ 6.131.556,22	(8,9200)	3,4100	7,1100	0,8824%	6,3100%	NC
TARPON GT INST FIC FIA	R\$ 6.268.900,90	R\$ 6.904.875,65	(10,3797)	9,6744	10,1449	8,2620%	16,5194%	NC
TRIGONO FLAGSHIP INST FI FIA	R\$ 6.320.465,26	R\$ 6.910.546,87	(14,1914)	8,9939	9,3400	2,2615%	6,1300%	NC
TOTAL art. 8º, inciso I - RENDA VARIÁVEL	R\$ 47.886.634,21	R\$ 51.402.945,43						
FUNDO DE INVESTIMENTO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 6.851.620,03	R\$ 6.633.635,66	(7,7100)	10,0200	(3,1800)	-1,6914%	-12,0600%	-5,3300%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 1.819.119,12	R\$ 1.762.087,69	(7,8200)	10,2084	(3,1351)	-1,5949%	-11,9154%	NC
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 8.670.739,15	R\$ 8.395.723,35						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.437,16	R\$ 1.437,96						
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL RECURSOS	R\$ 137.920.296,33	R\$ 145.181.120,72						

Quadro 18.

Nota 1: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 189/2022, devidamente autorizada pela Diretoria: **a) Novos Recursos:** Direcionar para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).

4.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –MPE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (09/06/2022 - 15/08/2024)	R\$ 50.376.797,62	R\$ 48.988.080,71	0,9648	- 0,2075	0,1140	0,8701%	0,8701%	NC
NTN-B (12/07/22 - 15/05/35)	R\$ 20.020.576,42	R\$ 20.049.852,69	-	0,1036	0,1462	0,2500%	0,2500%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 70.397.374,03	R\$ 69.037.933,40						

Quadro 19.

Nota 1: Em agosto, o saldo dos Títulos Públicos está inferior ao mês anterior em virtude do pagamento de cupom de juros.



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

4.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 08/2021				R\$ 183.555.898,30
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)	
09/2021	R\$ 1.647.557,59	R\$ 3.779,70	R\$ 1.643.777,89	
10/2021	R\$ 1.646.387,89	R\$ 23.802,84	R\$ 1.622.585,05	
11/2021	R\$ 3.285.936,72	R\$ 81.114,00	R\$ 3.204.822,72	
12/2021	R\$ 3.913.495,83	R\$ 32.084,33	R\$ 3.881.411,50	
01/2022	R\$ 1.169,74	R\$ 0,00	R\$ 1.169,74	
02/2022	R\$ 1.664.453,78	R\$ 20.395,10	R\$ 1.644.058,68	
03/2022	R\$ 1.660.420,76	R\$ 41.948,93	R\$ 1.618.471,83	
04/2022	R\$ 1.659.762,58	R\$ 16.778,94	R\$ 1.642.983,64	
05/2022	R\$ 1.689.107,22	R\$ 18.421,09	R\$ 1.670.686,13	
06/2022	R\$ 1.652.239,90	R\$ 34.635,86	R\$ 1.617.604,04	
07/2022	R\$ 1.640.438,74	R\$ 33.562,04	R\$ 1.606.876,70	
08/2022	R\$ 1.630.533,84	R\$ 33.562,04	R\$ 1.596.971,80	
Saldo dos Investimentos em 08/2022				R\$ 214.219.053,32

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	8,7271 %	4,3923 %	-0,3600 %
Juros	4,9500 %	3,2734 %	0,4034 %
Meta	14,1091 %	7,8095 %	0,0420 %
Rentabilidade em %	4,5892 %	6,3045 %	2,0663 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 8.911.735,30	R\$ 12.279.834,04	R\$ 4.304.411,16
Resultado em %	-8,3428 %	-1,3960 %	+2,0234 %
Resultado em R\$	R\$ -18.464.219,51	R\$ -2.930.314,39	R\$ +4.216.970,34

Quadro 20.



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

Anexo Saldo, Disponibilidade Financeira e Performance dos Fundos de Investimentos - Renda Fixa								
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRABESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 28.281.010,21	R\$ 29.809.517,09	1,0800	1,0800	1,2100	3,4079%	8,1562%	10,9000%
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 247.300,44	R\$ 250.226,76	1,0259	1,0362	1,1833	3,2806%	6,2116%	NC
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 1.220.023,08	R\$ 1.234.327,87	1,0200	1,0300	1,1700	3,2546%	3,2546%	NC
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 254.667,95	R\$ 257.691,46	1,0606	1,0069	1,1872	3,2901%	5,2373%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 30.003.001,68	R\$ 31.551.763,18						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 30.003.001,68	R\$ 31.551.763,18						
FUNDOS DE AÇÕES	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 784.253,84	R\$ 819.395,61	(12,6400)	5,6800	4,4800	-3,5419%	-5,9694%	-24,8300%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 14.797,42	R\$ 15.740,23	(10,5244)	4,1632	6,3714	-0,8612%	6,7840%	1,6408%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.587.871,25	R\$ 2.858.338,68	(9,5000)	7,3851	10,4513	7,3405%	13,6781%	NC
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 3.386.922,51	R\$ 3.693.474,52						
FUNDO ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.417.084,64	R\$ 3.308.370,05	(7,7100)	10,0200	(3,1800)	-1,6914%	-12,0523%	-5,3300%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 1.574.829,63	R\$ 1.525.456,95	(7,8200)	10,2084	(3,1351)	-1,5949%	-11,9154%	NC
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 4.991.914,27	R\$ 4.833.827,00						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 458,78	R\$ 9.407,74						
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL RECURSOS	R\$ 38.382.297,24	R\$ 40.088.472,44						

Quadro 21.

Nota 1: As movimentações neste mês com base na Ata de reunião COMIV nº. 189/2022, devidamente autorizada pela Diretoria: **a) Novos Recursos:** Direcionar para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).

5.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –DPE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN B (12/07/2022 - 15/05/2023)	R\$ 10.010.288,21	R\$ 10.024.926,34	-	0,1036	0,1462	0,2500%	0,2500%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 10.010.288,21	R\$ 10.024.926,34						

Quadro 22.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

5.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

Saldo dos Investimentos em 08/2021			R\$ 32.103.675,09
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2021	R\$ 1.179.063,91	R\$ 12.001,73	R\$ 1.167.062,18
10/2021	R\$ 1.172.130,12	R\$ 51.465,27	R\$ 1.120.664,85
11/2021	R\$ 1.220.800,58	R\$ 90.180,34	R\$ 1.130.620,24
12/2021	R\$ 3.547.742,31	R\$ 80.855,04	R\$ 3.466.887,27
01/2022	R\$ 0,00	R\$ 41.366,60	R\$ -41.366,60
02/2022	R\$ 1.248.223,40	R\$ 41.366,60	R\$ 1.206.856,80
03/2022	R\$ 1.254.503,15	R\$ 66.813,74	R\$ 1.187.689,41
04/2022	R\$ 1.254.391,51	R\$ 54.090,17	R\$ 1.200.301,34
05/2022	R\$ 1.239.427,94	R\$ 43.017,61	R\$ 1.196.410,33
06/2022	R\$ 1.265.619,51	R\$ 54.090,17	R\$ 1.211.529,34
07/2022	R\$ 1.314.247,49	R\$ 6.039,13	R\$ 1.308.208,36
08/2022	R\$ 1.289.382,39	R\$ 102.141,21	R\$ 1.187.241,18
Saldo dos Investimentos em 08/2022			R\$ 50.113.398,78

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	8,7271 %	4,3923 %	-0,3600 %
Juros	4,9500 %	3,2734 %	0,4034 %
Meta	14,1091 %	7,8095 %	0,0420 %
Rentabilidade em %	6,7936 %	5,2376 %	1,1026 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 2.667.618,99	R\$ 2.226.980,18	R\$ 533.572,15
Resultado em %	-6,4109 %	-2,3856 %	+1,0602 %
Resultado em R\$	R\$ -2.860.508,05	R\$ -1.092.165,78	R\$ +513.259,48

Quadro 23.



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASECO FI RF DI PREMIUM	R\$ 26.046.960,64	R\$ 34.634.385,32	1,0800	1,0800	1,2100	3,4079%	8,1400%	10,9000%
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 52.855.196,56	R\$ 53.482.712,95	1,0606	1,0069	1,1872	3,2901%	7,9261%	NC
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 110.270.541,35	R\$ 111.575.378,67	1,0259	1,0362	1,1833	3,2806%	7,8983%	NC
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 1.964.480,16	R\$ 1.987.513,71	1,0200	1,0300	1,1700	3,2546%	7,6900%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 191.137.178,71	R\$ 201.679.990,65						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 191.137.178,71	R\$ 201.679.990,65						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.545.760,66	R\$ 2.659.834,08	(12,6400)	5,6800	4,4800	-3,5419%	-5,9694%	-24,8300%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 9.322.200,69	R\$ 9.916.158,25	(10,5244)	4,1632	6,3714	-0,8612%	6,7840%	1,6408%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.021.385,93	R\$ 1.093.967,97	(8,9200)	3,4100	7,1100	0,8824%	-1,1350%	NC
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 1.127.672,37	R\$ 1.232.952,40	(14,1914)	8,9939	9,3400	2,2615%	16,5188%	NC
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.124.539,75	R\$ 1.238.623,37	(10,3797)	9,6744	10,1449	8,2620%	9,5237%	NC
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 5.637.810,52	R\$ 6.227.037,72	(9,5000)	7,3851	10,4513	7,3405%	13,6781%	NC
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 4.578.737,12	R\$ 4.890.411,75	(9,1600)	5,1100	6,8100	1,9842%	6,0187%	-5,9000%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 25.358.107,04	R\$ 27.258.985,54						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 25.396.950,93	R\$ 24.989.620,85	(1,0765)	7,7314	(1,6038)	4,8625%	-21,0505%	-11,1395%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 25.396.950,93	R\$ 24.989.620,85						
FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 18.228.942,83	R\$ 17.648.988,79	(7,7100)	10,0200	(3,1800)	-1,6914%	-12,0600%	5,3300%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 18.228.942,83	R\$ 17.648.988,79						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 4.350.840,55	R\$ -						
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 264.472.020,06	R\$ 271.577.585,83						

Quadro 24.

Nota 1: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 189/2022, devidamente autorizada pela Diretoria: **a) Novos Recursos:** Direcionar para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).

6.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –TJAM/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (11/02/22 - 15/05/23)	R\$ 41.588.046,69	R\$ 41.657.832,04	1,2033	- 0,1539	0,1678	1,2171%	7,2885%	NC
NTN-B (16/06/22 - 15/05/23)	R\$ 201.421.060,24	R\$ 201.789.793,73	0,8507	- 0,1387	0,1831	0,8952%	2,0215%	NC
NTN-B (12/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ 47.548.868,99	R\$ 47.618.400,14	-	0,1036	0,1462	0,2500%	0,1036%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 290.557.975,92	R\$ 291.066.025,91						

Quadro 25

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

6.3 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

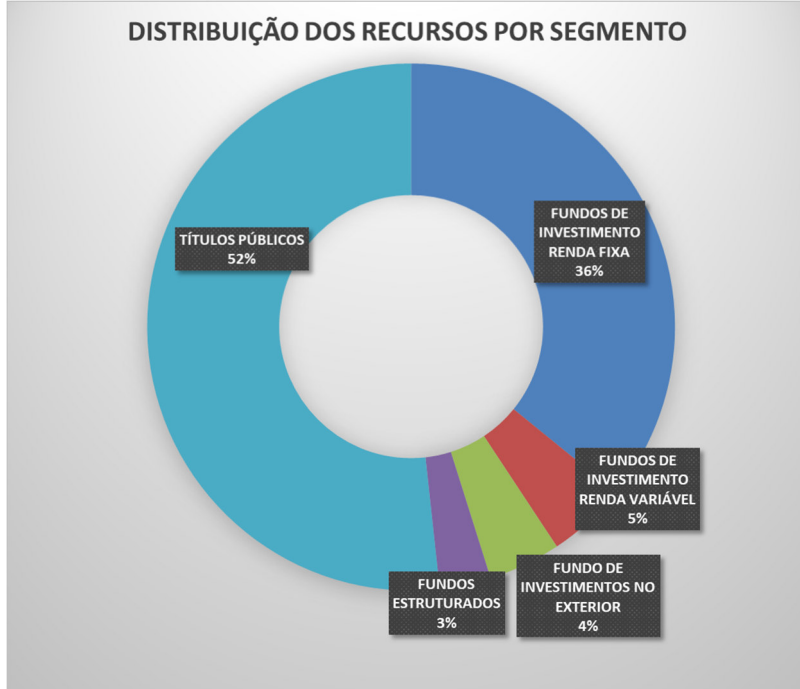


Gráfico 3.

6.4 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 08/2021				R\$ 477.906.052,89
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)	
09/2021	R\$ 3.738.023,51	R\$ 317.532,32	R\$ 3.420.491,19	
10/2021	R\$ 3.756.511,37	R\$ 317.532,32	R\$ 3.438.979,05	
11/2021	R\$ 3.805.215,10	R\$ 331.580,86	R\$ 3.473.634,24	
12/2021	R\$ 7.253.729,28	R\$ 456.014,72	R\$ 6.797.714,56	
01/2022	R\$ 5.672.474,97	R\$ 302.640,83	R\$ 5.369.834,14	
02/2022	R\$ 56.570,27	R\$ 356.405,95	R\$ -299.835,68	
03/2022	R\$ 7.951.840,91	R\$ 323.754,43	R\$ 7.628.086,48	
04/2022	R\$ 4.109.557,59	R\$ 36.232,72	R\$ 4.073.324,87	
05/2022	R\$ 24.966,47	R\$ 623.560,78	R\$ -598.594,31	
06/2022	R\$ 8.338.800,59	R\$ 308.280,26	R\$ 8.030.520,33	
07/2022	R\$ 4.283.886,16	R\$ 333.045,61	R\$ 3.950.840,55	
08/2022	R\$ 4.331.931,11	R\$ 455.010,26	R\$ 3.876.920,85	
Saldo dos Investimentos em 08/2022				R\$ 562.643.611,74

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	8,7271 %	4,3923 %	-0,3600 %
Juros	4,9500 %	3,2734 %	0,4034 %
Meta	14,1091 %	7,8095 %	0,0420 %
Rentabilidade em %	7,1180 %	4,5736 %	0,6732 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 35.575.642,58	R\$ 23.794.383,35	R\$ 3.736.694,91
Resultado em %	-6,1266 %	-3,0015 %	+0,6310 %
Resultado em R\$	R\$ -34.904.745,95	R\$ -16.828.955,80	R\$ +3.503.722,46

Quadro 26.



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

ANEXO 1 - FUNDOS DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA								
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRABESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 12.931.597,33	R\$ 14.555.217,34	1,0800	1,0800	1,2100	3,4079%	8,1400%	10,9000%
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 57.393.701,66	R\$ 58.072.844,46	1,0259	1,0362	1,1833	3,2806%	7,8983%	NC
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 27.566.912,27	R\$ 27.894.196,82	1,0606	1,0069	1,1872	3,2901%	7,9261%	NC
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 316.517,31	R\$ 320.228,48	1,0200	1,0300	1,1700	3,2546%	7,6900%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 98.208.728,57	R\$ 100.842.487,10						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 98.208.728,57	R\$ 100.842.487,10						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 687.768,32	R\$ 718.586,65	(12,6400)	5,6800	4,4800	-3,5419%	-5,9800%	-24,8300%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 9.322.200,69	R\$ 9.916.158,25	(10,5244)	4,1632	6,3714	-0,8612%	6,7841%	1,6408%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.305.873,97	R\$ 1.442.355,41	(9,5000)	7,3851	10,4513	7,3405%	13,6781%	NC
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 853.262,48	R\$ 911.344,06	(9,1600)	5,1100	6,8100	1,9842%	6,0100%	-5,9000%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 12.169.105,46	R\$ 12.988.444,37						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 485.732,19	R\$ 477.941,76	(1,0765)	7,7314	(1,6038)	4,8625%	-21,0507%	-11,1395%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 485.732,19	R\$ 477.941,76						
FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.401.045,64	R\$ 3.292.841,34	(7,7100)	10,0200	(3,1800)	-1,6914%	-12,0600%	-5,3300%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 3.401.045,64	R\$ 3.292.841,34						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 746.772,88	R\$ -						
VALORES EM TRANSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 115.011.384,74	R\$ 117.601.714,57						

Quadro 27.

Nota 1: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 189/2022, devidamente autorizada pela Diretoria: **a) Novos Recursos:** Direcionar para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90).

7.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –TCE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/07/2022	31/08/2022	jun/22	jul/22	ago/22	TRIMESTRE	2022	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN B (12/07/2022 - 15/05/2035)	R\$ 17.017.489,95	R\$ 17.042.374,79	-	0,1036	0,1462	0,2500%	0,2500%	NC
TOTAL GERAL	R\$ 17.017.489,95	R\$ 17.042.374,79						

Quadro 28

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

7.3 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

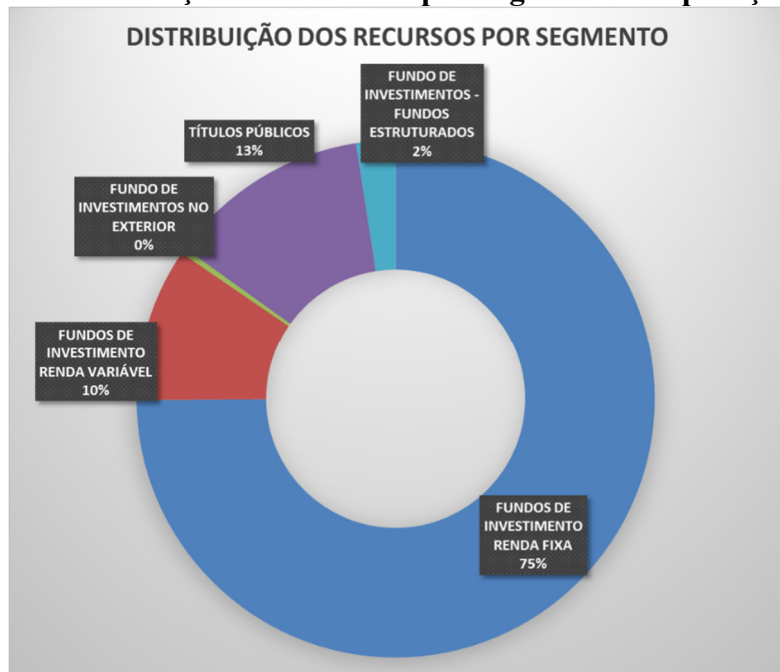


Gráfico 4.

7.4 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 08/2021		R\$ 114.732.728,50	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2021	R\$ 596.685,79	R\$ 32.206,97	R\$ 564.478,82
10/2021	R\$ 621.603,17	R\$ 7.463,96	R\$ 614.139,21
11/2021	R\$ 1.288.278,50	R\$ 56.027,71	R\$ 1.232.250,79
12/2021	R\$ 1.716.449,08	R\$ 39.670,93	R\$ 1.676.778,15
01/2022	R\$ 4.958,52	R\$ 0,00	R\$ 4.958,52
02/2022	R\$ 1.449.125,02	R\$ 24.900,86	R\$ 1.424.224,16
03/2022	R\$ 700.731,13	R\$ 39.696,10	R\$ 661.035,03
04/2022	R\$ 723.931,36	R\$ 0,00	R\$ 723.931,36
05/2022	R\$ 730.190,58	R\$ 64.596,96	R\$ 665.593,62
06/2022	R\$ 752.226,14	R\$ 57.988,93	R\$ 694.237,21
07/2022	R\$ 743.489,44	R\$ 7.489,13	R\$ 736.000,31
08/2022	R\$ 820.598,04	R\$ 106.726,53	R\$ 713.871,51
Saldo dos Investimentos em 08/2022		R\$ 134.644.089,36	

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	8,7271 %	4,3923 %	-0,3600 %
Juros	4,9500 %	3,2734 %	0,4034 %
Meta	14,1091 %	7,8095 %	0,0420 %
Rentabilidade em %	8,5491 %	7,0903 %	1,4401 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 10.199.862,17	R\$ 8.696.476,00	R\$ 1.901.343,16
Resultado em %	-4,8725 %	-0,6671 %	+1,3975 %
Resultado em R\$	R\$ -6.627.674,03	R\$ -881.850,28	R\$ +1.845.924,37

Quadro 29.



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 08/2021		R\$ 5.853.799.247,78	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2021	R\$ 48.886.060,70	R\$ 11.040.110,10	R\$ 37.845.950,60
10/2021	R\$ 51.242.844,99	R\$ 11.027.983,24	R\$ 40.214.861,75
11/2021	R\$ 63.884.694,78	R\$ 15.331.404,79	R\$ 48.553.289,99
12/2021	R\$ 110.683.761,27	R\$ 12.583.550,93	R\$ 98.100.210,34
01/2022	R\$ 21.018.770,26	R\$ 10.807.477,47	R\$ 10.211.292,79
02/2022	R\$ 51.340.679,94	R\$ 13.826.886,01	R\$ 37.513.793,93
03/2022	R\$ 58.711.099,75	R\$ 11.911.920,48	R\$ 46.799.179,27
04/2022	R\$ 53.164.621,36	R\$ 11.053.770,06	R\$ 42.110.851,30
05/2022	R\$ 50.082.174,56	R\$ 16.076.811,16	R\$ 34.005.363,40
06/2022	R\$ 59.319.428,77	R\$ 11.397.350,62	R\$ 47.922.078,15
07/2022	R\$ 55.739.597,82	R\$ 11.280.660,01	R\$ 44.458.937,81
08/2022	R\$ 56.431.133,95	R\$ 13.000.428,99	R\$ 43.430.704,96
Saldo dos Investimentos em 08/2022		R\$ 6.461.067.633,72	

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

Taxa de Juros Anual	4,9500 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	8,7271 %	4,3923 %	-0,3600 %
Juros	4,9500 %	3,2734 %	0,4034 %
Meta	14,1091 %	7,8095 %	0,0420 %
Rentabilidade em %	1,2472 %	2,3699 %	1,7434 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 76.101.871,65	R\$ 145.190.114,18	R\$ 109.969.151,34
Resultado em %	-11,2715 %	-5,0456 %	+1,7007 %
Resultado em R\$	R\$ -784.045.910,70	R\$ -333.152.509,55	R\$ +107.321.523,57

Quadro 30.

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.

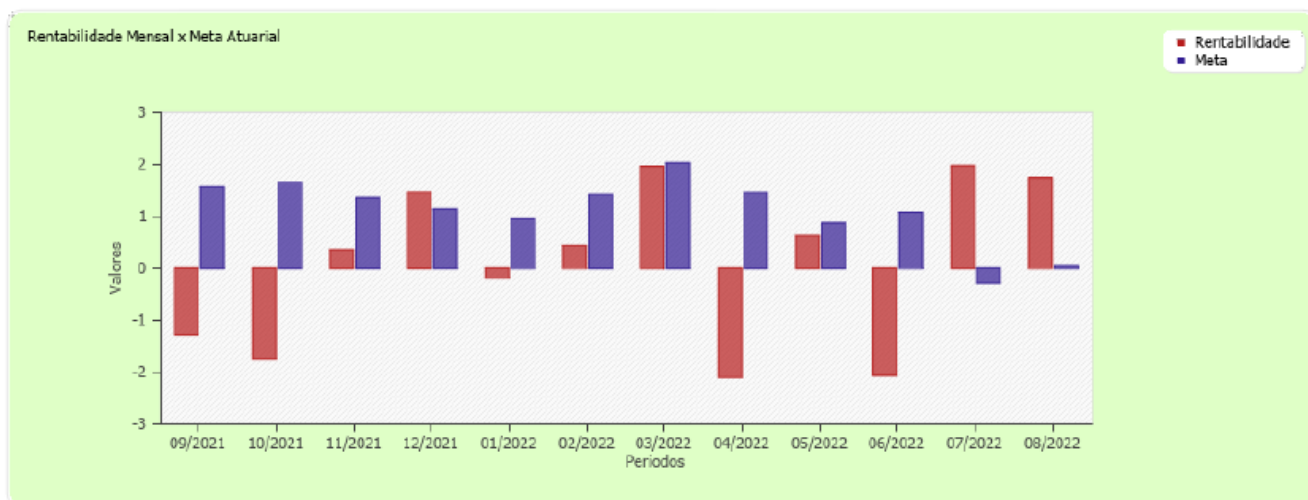


Gráfico 5.



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

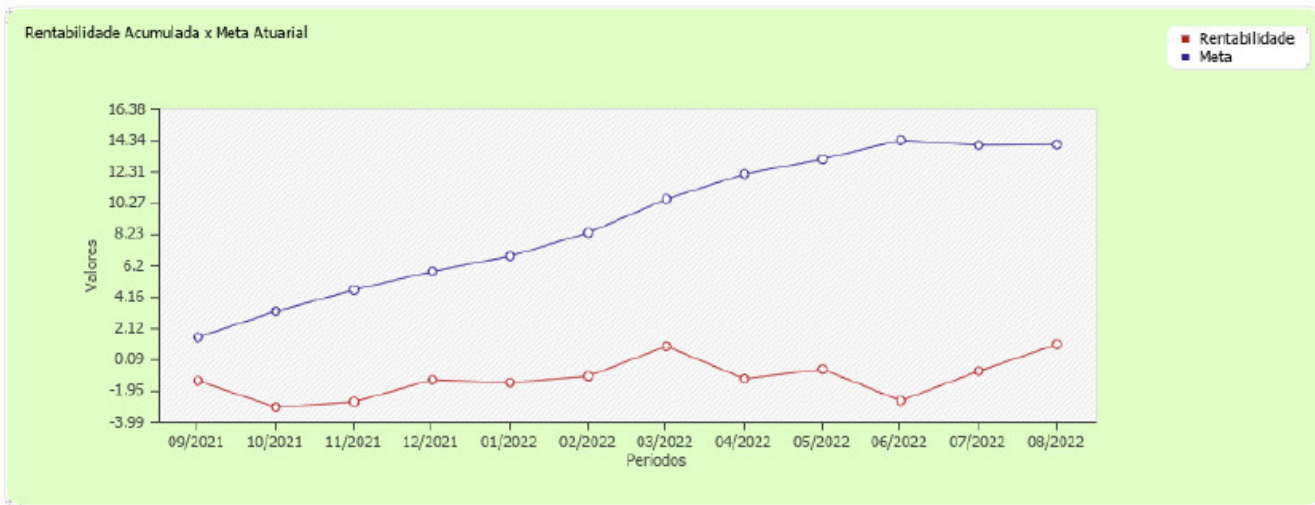


Gráfico 6.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	29/07/2022	31/08/2022
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.301.780,38	R\$ 2.448.668,29
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 6.974.205,51	R\$ 7.624.830,31
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 390,02	R\$ 390,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 2.792.664,36	R\$ 55.296,74
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 239.642,41	R\$ 239.642,41
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 50.889,57	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ -	R\$ 113,71
TOTAL	R\$ 12.359.572,25	R\$ 10.368.941,48

Quadro 31.

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	
	29/07/2022	31/08/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ -	R\$ 108.673,17
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 56.596,21	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.752,73	R\$ 24.725,78
TOTAL	R\$ 81.348,94	R\$ 133.398,95

Quadro 32.

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	
	29/07/2022	31/08/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 503,38	R\$ -
TOTAL	R\$ 503,38	R\$ -

Quadro 33.

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/07/2022	31/08/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.439,81	R\$ 2.496,38
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 2.383,23	R\$ 2.383,23
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.294,92	R\$ 2.294,92
TOTAL	R\$ 7.117,96	R\$ 7.174,53

Quadro 34.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/07/2022	31/08/2022
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.192.438,20	R\$ 3.393.595,88
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 110.776,67	R\$ 179.997,05
TOTAL	R\$ 4.303.214,87	R\$ 3.573.592,93

Quadro 35.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/07/2022	31/08/2022
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 11.743,77	R\$ 5.890.953,62
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 627.752,49	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 5.306.630,43	R\$ -
TOTAL	R\$ 5.946.126,69	R\$ 5.890.953,62

Quadro 36.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/07/2022	31/08/2022
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 1.247.160,74
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN		
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.175.689,06	R\$ -
TOTAL	R\$ 1.175.689,06	R\$ 1.247.160,74
TOTAL GERAL FFIN	R\$ 23.873.573,15	R\$ 21.221.222,25

Quadro 37.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

DESCRIÇÃO	SALDOS		
	30/06/2022	29/07/2022	31/08/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.671.356,77	R\$ 318.488,72	R\$ -
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 35.685.936,41	R\$ 35.044.474,05	R\$ 35.460.534,97
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 71.112,63	R\$ 885.482,17	R\$ 404.147,03
TOTAL PODER EXECUTIVO	R\$ 37.428.405,81	R\$ 36.248.444,94	R\$ 35.864.682,00
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	30/06/2022	29/07/2022	31/08/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL - ALE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	30/06/2022	29/07/2022	31/08/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL - TCE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	30/06/2022	29/07/2022	31/08/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 162.285,64	R\$ -	R\$ -
TOTAL TJ/AM	R\$ 162.285,64	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS		
	30/06/2022	29/07/2022	31/08/2022
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL PGJ/AM	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL GERAL	R\$ 37.590.691,45	R\$ 36.248.444,94	R\$ 35.864.682,00

Quadro 38.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

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 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL	R\$ 2.453.640.760,16	38,09%	30,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 2.453.640.760,16				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.564.946,81	3,65%	9,00%	100,00%	art. 7º, Inciso I, "b"
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.480.639,30				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ -				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ -				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ -				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ -				
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO DI FIC REF	R\$ 173.837.998,15				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 97.179,01				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 234.980.763,27				
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 14.466.001,10	15,99%	5,00%	70,00%	art. 7º, inciso III, "a"
BRANCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 335.608.794,12				
ITAÚ SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 99.341.729,99				
ICATU VANGUARDARF FI PLUS LP	R\$ 105.112.863,23				
BB PREVID RF PERFIL	R\$ 262.123.397,39				
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 213.306.110,80				
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 1.029.958.896,63				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 39.786.180,39	9,30%	10,00%	10,00%	art 7º, inciso V, "b"
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 115.583.881,30				
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 128.415.587,17				
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 80.520.944,36				
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 51.786.728,07				
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 128.180.868,84				
BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 42.746.066,11				
RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 11.875.664,09				
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 598.895.920,33				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.317.476.340,39	67,03%			

Quadro 39.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 68.688.601,92	24,66%	40,00%	40,00%	art. 8º, inciso I
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 74.586.766,51				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 122.572.281,00				
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 51.166.443,53				
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 120.594.163,52				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 44.174.010,04				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 194.069.985,74				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ -				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 33.170.855,93				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.222.996,27				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 80.591.937,15				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 132.656.704,94				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 75.037.787,45				
OCCAM FIC FIA	R\$ 121.177.510,34				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ -				
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 98.584.592,22				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 81.089.212,35				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 43.081.604,25				
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 49.870.342,05				
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 69.142.620,21				
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 43.429.531,45				
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.669.047,29				
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 42.814.048,22				
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.323.453,11				
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.562.742,28				
TOTAL art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 1.588.277.237,77				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.588.277.237,77	24,66%			

Quadro 40.

11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR		TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
				LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$	45.978.881,64	2,81%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$	32.331.654,64				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$	16.205.496,59				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$	62.387.040,38				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$	24.322.543,94				
TOTAL art 9º, inciso II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$	181.225.617,19				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$	92.967.870,98	2,70%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$	45.510.179,87				
ITAU BDR NIVEL I AÇÕES	R\$	35.342.131,79				
TOTAL art 9º, inciso III - BDR Nível I	R\$	173.820.182,64				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$	355.045.799,83	5,51%			

Quadro 41.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

11.4 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Fundos Estruturados

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2022		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 31.575.473,17	1,89%	5,00%	10,00%	art. 10º, inciso I, a
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 31.403.268,47				
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 149.752,92				
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.950.616,27				
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 16.166.077,98				
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM	R\$ 10.379.509,40				
RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 15.011.282,91				
TOTAL art. 10º, inciso I, "a"	R\$ 121.635.981,12				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 35.364.052,01	0,91%	2,00%	5,00%	art. 10º, inciso I, b
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 12.677.004,10				
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 225.170,33				
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 10.617.325,13				
TOTAL art. 10º, inciso I, "b"	R\$ 58.883.551,57				
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 180.519.532,69	2,80%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 6.441.318.910,68	100%			

Quadro 42.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

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	BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.564.946,81	0,12%	100%
	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.480.639,30	0,82%	
	ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ -	0,00%	
	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ -	0,00%	
FI RENDA FIXA	BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 14.466.001,10	0,22%	20%
	BRABESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 335.608.794,12	5,15%	
	BB PREVID RF PERFIL	R\$ 262.123.397,39	4,02%	
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 213.306.110,80	3,27%	
	ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP - FUNDO NOVO	R\$ 105.112.863,23	1,61%	
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC - FUNDO NOVO	R\$ 99.341.729,99	1,52%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO DI FIC REF	R\$ 173.837.998,15	2,67%	
	ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 97.179,01	0,00%	
FI RF CREDITO PRIVADO	ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 39.786.180,39	0,61%	20%
	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 115.583.881,30	1,77%	
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 128.415.587,17	1,97%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 80.520.944,36	1,24%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 128.180.868,84	1,97%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 42.746.066,11	0,66%	
	RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 11.875.664,09	0,18%	
	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 51.786.728,07	0,79%	
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 68.688.601,92	1,05%	20%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 74.586.766,51	1,14%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 122.572.281,00	1,88%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 51.166.443,53	0,78%	
	BRABESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 120.594.163,52	1,85%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 44.174.010,04	0,68%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 194.069.985,74	2,98%	
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ -	0,00%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 33.170.855,93	0,51%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.222.996,27	0,28%	
	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 80.591.937,15	1,24%	
	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 132.656.704,94	2,04%	
	ITAU SMALL CAP VALUATION	R\$ 75.037.787,45	1,15%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 121.177.510,34	1,86%	
	SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ -	0,00%	
	VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 98.584.592,22	1,51%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 81.089.212,35	1,24%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 43.081.604,25	0,66%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 49.870.342,05	0,77%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 69.142.620,21	1,06%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.669.047,29	0,07%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 42.814.048,22	0,66%	
	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.323.453,11	0,07%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.562.742,28	0,22%	
	4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 43.429.531,45	0,67%	
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 45.978.881,64	0,71%	20%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.331.654,64	0,50%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 16.205.496,59	0,25%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 62.387.040,38	0,96%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 24.322.543,94	0,37%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 92.967.870,98	1,43%	20%
	ITAU BDR NIVE 1 AÇÕES	R\$ 35.342.131,79	0,54%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 45.510.179,87	0,70%	
FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 31.575.473,17	0,48%	20%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 31.403.268,47	0,48%	
	ITAU PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 149.752,92	0,00%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.950.616,27	0,26%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 16.166.077,98	0,25%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$ 10.379.509,40	0,16%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 15.011.282,91	0,23%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 35.364.052,01	0,54%	20%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 10.617.325,13	0,16%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 225.170,33	0,00%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 12.677.004,10	0,19%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 3.987.678.150,52		

Quadro 43.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - RS	% DO PL DO FUNDO
FI RF - 100% TPF	BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.564.946,81	R\$ 11.325.025.814,75	0,07%
	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.480.639,30	R\$ 218.246.329,73	24,50%
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ -	R\$ 8.479.792.486,57	0,00%
	ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ -	R\$ 350.517.658,79	0,00%
	ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ -	R\$ 1.553.836.239,30	0,00%
FI RENDA FIXA	SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ -	R\$ 569.575.734,81	0,00%
	BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 14.466.001,10	R\$ 547.182.276,48	2,64%
	BRABESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 335.608.794,12	R\$ 6.775.226.177,00	4,95%
	BB PREVID RF PERFIL	R\$ 262.123.397,39	R\$ 11.325.025.814,75	2,31%
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 213.306.110,80	R\$ 14.286.717.843,06	1,49%
	ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP	R\$ 105.112.863,23	R\$ 781.802.639,84	13,44%
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 99.341.729,99	R\$ 27.656.938.251,00	0,36%
FI RF CREDITO PRIVADO	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 173.837.998,15	R\$ 3.750.698.852,30	4,63%
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 97.179,01	R\$ 2.528.329.321,30	0,00%
	ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 39.786.180,39	R\$ 1.440.461.207,90	2,76%
	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 115.583.881,30	R\$ 2.502.065.960,45	4,62%
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 128.415.587,17	R\$ 3.246.196.303,69	3,96%
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 80.520.944,36	R\$ 2.306.468.079,93	3,49%
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 128.180.868,84	R\$ 4.429.327.174,85	2,89%
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 42.746.066,11	R\$ 2.121.705.750,30	2,01%
	RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 11.875.664,09	R\$ 261.765.939,99	4,54%
	MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 51.786.728,07	R\$ 1.167.245.726,65	4,44%
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 68.688.601,92	R\$ 852.061.680,09	8,06%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 74.586.766,51	R\$ 1.757.685.348,42	4,24%
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 122.572.281,00	R\$ 1.078.944.666,25	11,36%
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 51.166.443,53	R\$ 1.440.461.207,90	3,55%
	BRABESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 120.594.163,52	R\$ 1.029.772.402,40	11,71%
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 44.174.010,04	R\$ 391.775.197,51	11,28%
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 194.069.985,74	R\$ 1.448.736.263,86	13,40%
	BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ -	R\$ 49.583.501,56	0,00%
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 33.170.855,93	R\$ 499.621.876,99	6,64%
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.222.996,27	R\$ 140.563.845,65	12,96%
	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 80.591.937,15	R\$ 957.886.346,39	8,41%
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 132.656.704,94	R\$ 2.019.893.410,50	6,57%
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 75.037.787,45	R\$ 628.587.885,24	11,94%
	OCCAM FIC FIA	R\$ 121.177.510,34	R\$ 997.786.121,03	12,14%
	SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ -	R\$ 132.795.336,05	0,00%
	VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 98.584.592,22	R\$ 883.777.003,91	11,15%
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 81.089.212,35	R\$ 824.912.634,77	9,83%
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 43.081.604,25	R\$ 493.307.965,10	8,73%
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 49.870.342,05	R\$ 1.033.243.344,67	4,83%
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 69.142.620,21	R\$ 533.763.056,70	12,95%
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.669.047,29	R\$ 75.845.726,16	6,16%
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 42.814.048,22	R\$ 1.273.120.661,80	3,36%
	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ 4.323.453,11	R\$ 345.428.700,72	1,25%
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.562.742,28	R\$ 401.131.628,21	3,63%
	4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 43.429.531,45	R\$ 345.428.700,72	12,57%
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 45.978.881,64	R\$ 1.288.479.681,70	3,57%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.331.654,64	R\$ 108.757.101.686,84	0,03%
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 16.205.496,59	R\$ 16.253.429.150,88	0,10%
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 62.387.040,38	R\$ 1.101.201.361,10	5,67%
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 24.322.543,94	R\$ 16.115.961.101,34	0,15%
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 92.967.870,98	R\$ 1.553.836.239,30	5,98%
	ITAÚ BDR NIVE I AÇÕES	R\$ 35.342.131,79	R\$ 249.671.852,71	14,16%
FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 45.510.179,87	R\$ 1.413.581.769,90	3,22%
	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 31.575.473,17	R\$ 877.251.347,58	3,60%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 31.403.268,47	R\$ 415.457.333,78	7,56%
	ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 149.752,92	R\$ 1.437.147.092,40	0,01%
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.950.616,27	R\$ 122.090.832,78	13,88%
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 16.166.077,98	R\$ 160.388.837,12	10,08%
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$ 10.379.509,40	R\$ 162.758.576,59	6,38%
FIP	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 15.011.282,91	R\$ 126.355.532,46	11,88%
	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 35.364.052,01	R\$ 2.543.874.237,61	1,39%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 10.617.325,13	R\$ 203.703.473,45	5,21%
	CLA VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP MULT	R\$ 225.170,33	R\$ 4.408.989,55	5,11%
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 3.987.678.150,52	R\$ 259.279.208,74	4,89%

Quadro 44.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

11.7 Enquadramento IV – Limites Gerais – art. 20º - A - Res. CMN 4.963/202

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA JULHO/2022) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (AGOSTO/22)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 4.963/21
BB DTVM S.A	R\$ 1.455.449,27	R\$ 582.373.821,35	0,0400%	5%
CAIXA DTVM	R\$ 490.859,47	R\$ 349.240.378,26	0,0711%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 821.118,92	R\$ 471.040.873,27	0,0574%	
BANCO SAFRA	R\$ 90.579,87	R\$ 250.923.651,19	0,2770%	
BRADESCO	R\$ 545.670,19	R\$ 470.668.958,74	0,0863%	
ICATÚ VANGUARDA	R\$ 40.094,36	R\$ 225.490.980,77	0,5624%	
BANCO BTG	R\$ 243.759,40	R\$ 354.035.254,68	0,1452%	
BANCO SANTANDER	R\$ 302.387,53	R\$ 177.970.921,68	0,0589%	
VINCI PARTNERS	R\$ 46.342,98	R\$ 141.891.366,80	0,3062%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 11.435,63	R\$ 121.177.510,34	1,0596%	
PLURAL INVEST (GENIAL)	R\$ 43.774,82	R\$ 48.537.151,23	0,1109%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 9.770,69	R\$ 74.586.766,51	0,7634%	
BC GESTAO RECURSOS LTDA	R\$ 4.266,09	R\$ 44.174.010,04	1,0355%	
ARX INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 35.339,15	R\$ 68.688.601,92	0,1944%	
SCHRODER BRASIL	R\$ 23.221,32	R\$ 24.322.543,94	0,1047%	
MONGERAL AEGON	R\$ 9.897,28	R\$ 51.786.728,07	0,5232%	
SUL AMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 30.634,78	R\$ -	0,0000%	
DAYCOVAL	R\$ 10.456,11	R\$ 18.222.996,27	0,1743%	
GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 1.764,46	R\$ 81.089.212,35	4,5957%	
4UM GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 1.990,01	R\$ 47.752.984,56	2,3996%	
TRIGONO CAPITAL LTDA	R\$ 2.414,68	R\$ 54.539.389,34	2,2587%	
TARPON INVESTIMENTOS	R\$ 6.464,93	R\$ 69.142.620,21	1,0695%	
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	R\$ 9.608,58	R\$ 47.645.965,80	0,4959%	
PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	R\$ 18.944,94	R\$ 128.180.868,84	0,6766%	
CONSTANCIA INVESTIMENTOS	R\$ 1.593,51	R\$ 42.814.048,22	2,6868%	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	R\$ 59.425,85	R\$ 42.746.066,11	0,0719%	
KINEA INVESTIMENTO LTDA	R\$ 66.448,14	R\$ 10.617.325,13	0,0160%	
CLARITAS ADMINISTRACAO DE RECURSOS LTDA	R\$ 7.612,35	R\$ 14.562.742,28	0,1913%	

Quadro 45.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

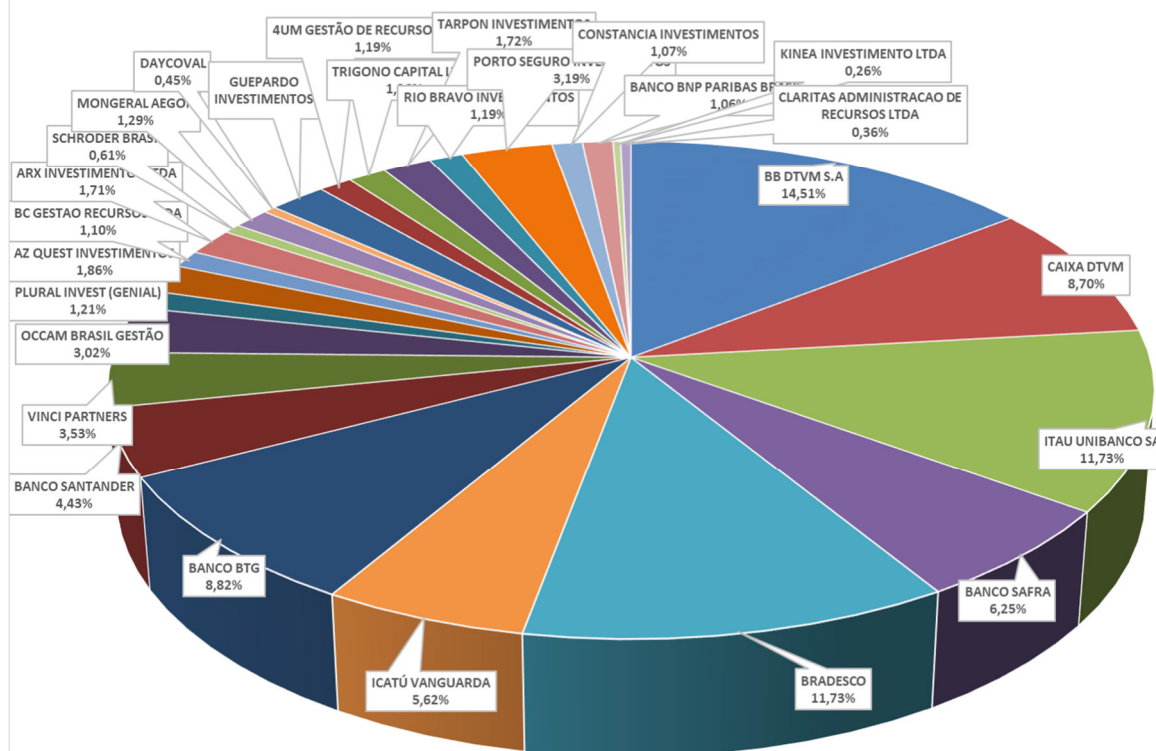


Gráfico 7.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.987.678.150,52
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 2.453.640.760,16
TÍTULOS - CVS	R\$ 7.621.356,44
IMÓVEIS	R\$ 68.293.435,00
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 919.836,65
TOTAL	R\$ 6.518.153.538,77

Quadro 46.

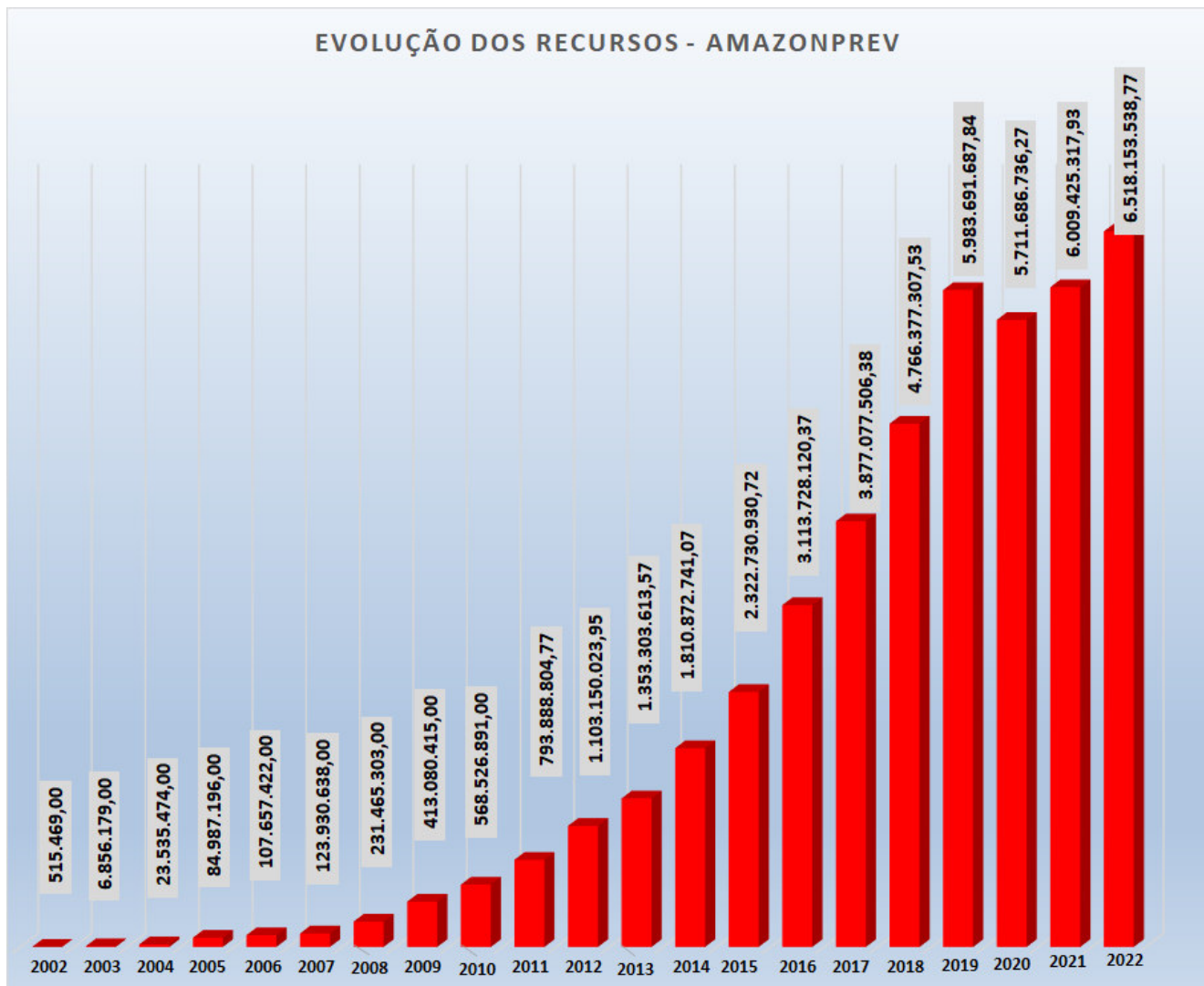


Gráfico 8.



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL	
FPREV/EXECUTIVO	Novos Recursos Executivo: Direcionar para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90) Demais Recursos: b1) Zerar posição no fundo ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP (19.719.727/0001-51), direcionando na mesma proporção entre: BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF (09.636.393/0001-07), MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP (19.488.768/0001-84) e BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP (14.171.644/0001-57); b2) Resgatar R\$ 20.000.000,00 (vinte milhões) do fundo BB FIA BDR - NIVEL I (21.470.644/0001-13) direcionando para o fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90)
FPREV/ASSEMBLEIA	Novos Recursos ALE: aplicar no fundo BB PREVID RF PERFIL (13.077.418/0001-49)
FPREV/TCE, TJA, MPE, DPE	Novos Recursos TCE/ TJA/MPE/DPE: aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90)
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE, FPPM)	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.
RECURSOS COMPREV	Novos recursos aplicar no fundo Bradesco Maxi Poder Público.
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público;

Quadro 47.

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: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



RELATÓRIOS - 2022

RELATÓRIO DE RISCOS FPREV - AMAZONPREV



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.261.299.427,03
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.752.630.692,47
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 355.045.799,84
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 6.368.975.919,34

					12M	ago/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOURO	R\$ 2.453.640.760,16						
TOTAL - art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 2.453.640.760,16						
					12M	ago/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "b"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 7.564.946,81	1,70%	0,18%	-0,95	12,78%	1,19%	9,35%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 53.480.639,30	5,15%	0,53%	-2,90	2,90%	-2,95%	-0,11%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ -	2,65%	0,27%	-2,29	9,67%	0,01%	6,50%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ -	8,81%	0,91%	-7,29	1,17%	2,48%	2,52%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	R\$ -	5,81%	0,60%	-5,32	3,35%	1,40%	4,17%
Safra Sob Reg Proprio Fc FI RF RefDI	R\$ 173.837.998,15	0,15%	0,02%	0,00	10,17%	1,17%	7,69%
Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 97.179,01	1,40%	0,14%	-1,05	9,98%	0,61%	6,77%
TOTAL - art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 234.980.763,27						
					12M	ago/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso III, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 16.609,35	0,15%	0,02%	0,00	9,76%	1,13%	7,40%
Bradesco FI RF RefDI Premium	R\$ 329.341.807,48	0,16%	0,02%	0,00	10,90%	1,21%	8,14%
Caixa FI Brasil RF RefDI LP	R\$ 177.845.575,83	0,18%	0,02%	0,00	10,55%	1,19%	7,93%
Itau Soberano RF Simples Fc	R\$ 99.341.729,99	0,15%	0,02%	0,00	10,23%	1,16%	7,74%
Icatu Vanguarda RF FI Plus LP	R\$ 105.112.863,23	0,50%	0,05%	-0,39	10,45%	1,24%	8,05%
BB Prev RF RefDI LP Perfil Fc	R\$ 262.123.397,39	0,16%	0,02%	0,00	10,49%	1,18%	7,90%
TOTAL - art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 973.781.983,27						
					12M	ago/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso V, "b"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 39.786.180,39	3,94%	0,41%	-3,99	10,15%	0,83%	7,50%
Mag Cred Priv FI RF LP	R\$ 51.786.728,07	0,18%	0,02%	0,00	11,43%	1,27%	8,48%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	R\$ 115.583.881,30	0,23%	0,02%	-0,02	11,42%	1,25%	8,52%
BTG Pact Cre Cor I Fc FI RF Cred Priv LP	R\$ 80.520.944,36	0,29%	0,03%	-0,02	12,30%	1,29%	9,01%
Porto Seguro FI RF RefDI Cred Priv	R\$ 128.180.868,84	0,18%	0,02%	0,00	11,21%	1,23%	8,26%
Bnpp Match DI FI RF RefCred Priv	R\$ 42.746.066,11	0,17%	0,02%	0,00	11,57%	1,21%	8,29%
Rio Bravo Cred Priv FI RF	R\$ 11.875.664,09	0,23%	0,02%	-0,07	11,31%	1,25%	8,48%
Itau High Grade RF Cred Priv Fc	R\$ 128.415.587,17	0,19%	0,02%	0,00	11,31%	1,26%	8,39%
TOTAL - art. 7º, inciso V, "b"	R\$ 598.895.920,33						

Quadro 1.

Fonte: Economática, base Extratos de Posição Mensal dos Investimentos – FPREV Amazonprev.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso I, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Ações Valor FICFIA	R\$ 122.572.281,00	19,25%	1,98%	-10,59	-5,17%	4,77%	-0,18%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 120.594.163,52	25,14%	2,59%	0,00	-16,67%	6,88%	-1,45%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 194.069.985,74	25,24%	2,60%	-2,12	-26,88%	5,74%	-0,42%
Caixa FIA Consumo	R\$ -	26,33%	2,71%	-2,35	-32,20%	6,44%	-13,36%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	R\$ 80.591.937,15	18,75%	1,93%	0,00	-10,44%	5,65%	4,40%
Itau Acoes Dunamis Fc	R\$ 132.656.704,94	18,85%	1,94%	0,00	-11,29%	6,54%	3,13%
Itau FofRpi Acoes Ibovespa Ativo Fc	R\$ -	20,17%	2,08%	0,00	-10,37%	6,35%	5,45%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	R\$ -	22,05%	2,27%	0,00	-19,37%	7,53%	1,88%
Itau Small Cap Valuation Fc Acoes	R\$ 75.037.787,45	24,94%	2,57%	0,00	-15,63%	9,19%	-1,74%
Sant Seleccion Cresce Senior Acoes Fc FI	R\$ -	20,57%	2,12%	0,00	-12,72%	6,76%	5,84%
Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	R\$ -	20,35%	2,10%	-15,73	-8,21%	6,54%	4,23%
Sant Seleccion Crescimento Acoes Fc FI	R\$ -	20,55%	2,12%	0,00	-12,67%	6,77%	5,86%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 74.586.766,51	16,27%	1,68%	0,00	-14,34%	5,98%	-2,45%
Occam Fc de FIA	R\$ 121.177.510,34	18,80%	1,94%	-14,70	-5,22%	7,11%	6,31%
Sul America Equities FIA	R\$ -	21,57%	2,22%	0,00	-20,75%	6,51%	-2,32%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ -	18,84%	1,94%	0,00	-9,46%	4,76%	6,76%
Vinci Mosaico Institucional FIA	R\$ 98.584.592,22	21,84%	2,25%	0,00	-10,84%	5,90%	0,94%
Vinci Selection Equities FIA	R\$ 43.081.604,25	17,72%	1,83%	0,00	-5,90%	6,81%	6,01%
Brasil Capital Rp Inst Fc de FIA	R\$ 44.174.010,04	23,02%	2,37%	-1,40	-24,83%	4,48%	-5,98%
Bnpp Action Fc FIA	R\$ -	19,73%	2,03%	-17,31	-5,70%	6,36%	8,49%
Daycoval Ibovespa Ativo FIA	R\$ 18.222.996,27	21,62%	2,23%	0,00	-11,65%	7,28%	5,68%
Cx FIC FIA BR Acoes Livre Quantitativo	R\$ 33.170.855,93	19,26%	1,98%	-12,37	1,64%	6,37%	6,78%
Guepardo Institucional FIC FIA	R\$ 81.089.212,34	24,23%	2,50%	-17,19	6,97%	10,45%	8,09%
Trigono Flagship Institucional Fc de FIA	R\$ 49.870.342,05	25,22%	2,60%	0,00	-5,75%	9,34%	6,13%
Tarpon Gt Institucional Fc FIA	R\$ 69.142.620,21	19,22%	1,99%	-20,62	16,64%	10,14%	16,52%
4um Small Caps FIA	R\$ 43.429.531,45	24,89%	2,57%	0,00	-7,48%	8,12%	-3,76%
BB Acoes Quantitativo Fc	R\$ 51.166.443,53	19,49%	2,01%	-11,64	-5,07%	5,73%	2,04%
Trigono Delphos Income Inst Fc de FIA	R\$ 4.669.047,29	24,97%	2,58%	-18,28	4,25%	8,98%	12,01%
4um Marlin Dividendos FIA	R\$ 4.323.453,11	17,08%	1,76%	-13,37	-1,43%	6,72%	7,92%
Constancia Fundamento FIA	R\$ 42.814.048,22	18,01%	1,86%	-14,22	-0,65%	6,87%	9,14%
Claritas Valor Feeder Fc FIA	R\$ 14.562.742,28	21,10%	2,18%	-17,04	-1,37%	6,43%	11,80%
ARX Income Inst Fc FIA	R\$ 68.688.601,92	19,62%	2,02%	-11,65	-6,25%	7,39%	0,89%
TOTAL - art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 1.588.277.237,76						

Quadro 2.

Fonte: Economática, base Extratos de Posição Mensal dos Investimentos – FPREV Amazonprev.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 45.978.881,64	21,94%	2,26%	-3,71	-11,14%	-1,60%	-21,05%
Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	R\$ 62.387.040,38	18,72%	1,93%	-3,35	-21,63%	-3,13%	-27,46%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	R\$ 24.322.543,94	21,37%	2,20%	-3,70	-18,25%	-3,57%	-24,54%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 16.205.496,59	53,58%	5,56%	-7,10	-55,09%	4,82%	-52,91%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 32.331.654,65	21,22%	2,19%	-4,72	-10,60%	-3,72%	-21,88%
TOTAL - art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 181.225.617,20						
					12M	ago/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Esg Is FIA - Bdr Nível I	R\$ 92.967.870,98	21,31%	2,20%	-4,45	-14,42%	-4,02%	-24,46%
Itau Bdr Nível I Acoes Fc	R\$ 35.342.131,79	19,67%	2,03%	-4,41	-5,58%	-3,80%	-15,97%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nível I	R\$ 45.510.179,87	22,91%	2,36%	-4,37	-19,74%	-4,41%	-28,08%
TOTAL - TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 173.820.182,64						
					12M	ago/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS TOTAL art 10º, I, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
Safra S&P Reais Pb FICFI Mult	R\$ 31.575.473,17	20,85%	2,15%	-5,08	-5,33%	-3,18%	-12,06%
BTG Pactual S&P 500 Brl FI Mult	R\$ 31.403.268,47	21,17%	2,18%	-5,10	-4,92%	-3,14%	-11,92%
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	R\$ 149.752,92	21,05%	2,17%	-5,12	-5,32%	-3,21%	-12,18%
Cx Fc Cap Prot Bolsa de Valores IV Mult	R\$ 16.950.616,27			-1,54		0,39%	
Rio Bravo Protecao II FI Mult	R\$ 10.379.509,40			0,00		4,35%	
Rio Bravo Protecao FI Mult	R\$ 15.011.282,91			-3,22		2,95%	
TOTAL - art. 10º, inciso I, "a"	R\$ 105.469.903,14						
					12M	ago/22	2022
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS TOTAL art 10º, I, "b"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
BTG Pactual Economia Real FI Partic Mult	R\$ 35.364.052,01			-2,39	43,95%	-0,49%	58,46%
Kinea P e V Feede Inst I FIP Mult	R\$ 10.617.325,13			-12,35		-2,33%	
Vinci Strategic Partners I FIP Mult C1A	R\$ 225.170,33			0,00		-5,41%	
BTG Pa Inv de Im FI Participac Mult C1A	R\$ 12.677.004,10			-3,24	6,75%	0,27%	9,45%
TOTAL - art. 10º, inciso I, "b"	R\$ 58.883.551,57						

Quadro 3.

Fonte: Economática, base Extratos de Posição Mensal dos Investimentos – FPREV Amazonprev.

Nota 1: VOLATILIDADE: Volatilidade é o nome que se dá ao Desvio Padrão dos retornos de um ativo. Dessa forma, a Volatilidade mede o quanto os retornos diários se afastam do retorno médio do período analisado. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio.

Nota 2: VALUE at RISK (95%): Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição normal. Dado o Desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo médio da carteira será de 4,63%.

Nota 3: DRAWDOWN: Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MjAxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período. Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, consequentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

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

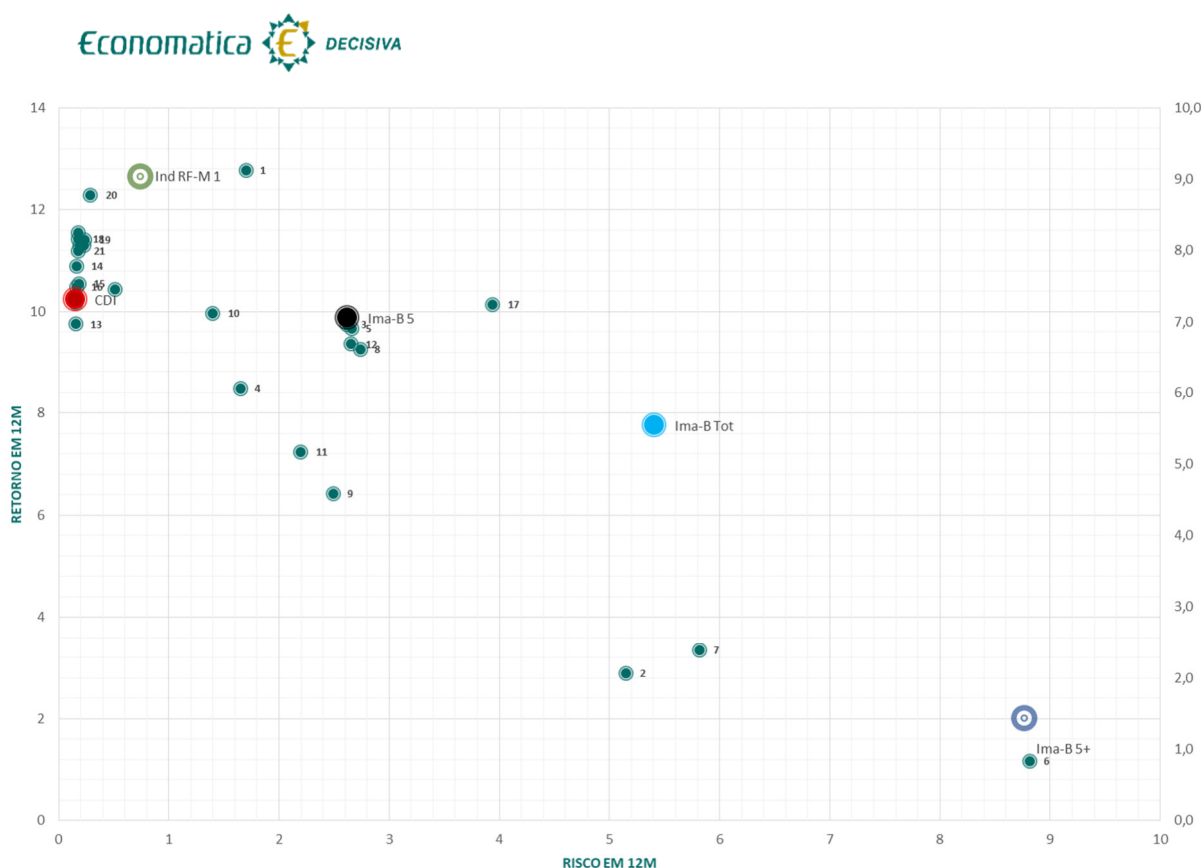


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Tit Publ VII FI	12,78	1,70	D+000	D+000
2	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	2,90	5,15	D+000	D+000
3	art. 7º, inciso I, "b"	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	9,75	2,61	D+000	D+000
4	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	8,49	1,65	D+000	D+000
5	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	9,67	2,65	D+000	D+001
6	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	1,17	8,81	D+000	D+001
7	art. 7º, inciso I, "b"	Safrá Ima Institucional Fc FI RF	3,35	5,81	D+003	D+004
8	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Idka 2 FI	9,27	2,74	D+001	D+001
9	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Alocação Ativa Fc	6,43	2,49	D+003	D+003
10	art. 7º, inciso I, "b"	Itau Instit Alocação Dinâmica RF FICFI	9,98	1,40	D+000	D+001
11	art. 7º, inciso III, "a"	Bradesco Fc FI RF Alocação Dinâmica	7,25	2,19	D+003	D+004
12	art. 7º, inciso III, "a"	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	9,37	2,65	D+001	D+001
13	art. 7º, inciso III, "a"	Bradesco FI RF Maxi Poder Público	9,76	0,15	D+000	D+000
14	art. 7º, inciso III, "a"	Bradesco FI RF Ref DI Premium	10,90	0,16	D+000	D+000
15	art. 7º, inciso III, "a"	Caixa FI Brasil RF Ref DI LP	10,55	0,18	D+000	D+000
16	art. 7º, inciso III, "a"	BB Prev RF Ref DI LP Perfil Fc	10,49	0,16	D+000	D+000
17	art. 7º, inciso V, "b"	Icatu Vang FI RF Inflação Cred Priv LP	10,15	3,94	D+005	D+006
18	art. 7º, inciso V, "b"	Mag Cred Priv FI RF LP	11,43	0,18	D+000	D+001
19	art. 7º, inciso V, "b"	Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	11,42	0,23	D+000	D+001
20	art. 7º, inciso V, "b"	BTG Pact Cre Cor I Fc FI RF Cred Priv LP	12,30	0,29	D+030	D+031
21	art. 7º, inciso V, "b"	Porto Seguro FI RF Refer DI Cred Priv	11,21	0,18	D+000	D+000
22	art. 7º, inciso V, "b"	Itau High Grade RF Cred Priv Fc	11,31	0,19	D+000	D+000
23	art. 7º, inciso III, "a"	Itau Soberano RF Simples Fc	10,23	0,15	D+000	D+000
24	art. 7º, inciso I, "b"	Safrá Sob Reg Proprio Fc FI RF Ref DI	10,17	0,15	D+000	D+000
25	art. 7º, inciso III, "a"	Icatu Vanguarda RF FI Plus LP	10,45	0,50	D+000	D+001
26	art. 7º, inciso V, "b"	Bnpp Match DI FI RF Ref Cred Priv	11,57	0,17	D+000	D+000
27	art. 7º, inciso V, "b"	Rio Bravo Cred Priv FI RF	11,31	0,23	D+000	D+001

Quadro 4. Legenda Gráfico 1.

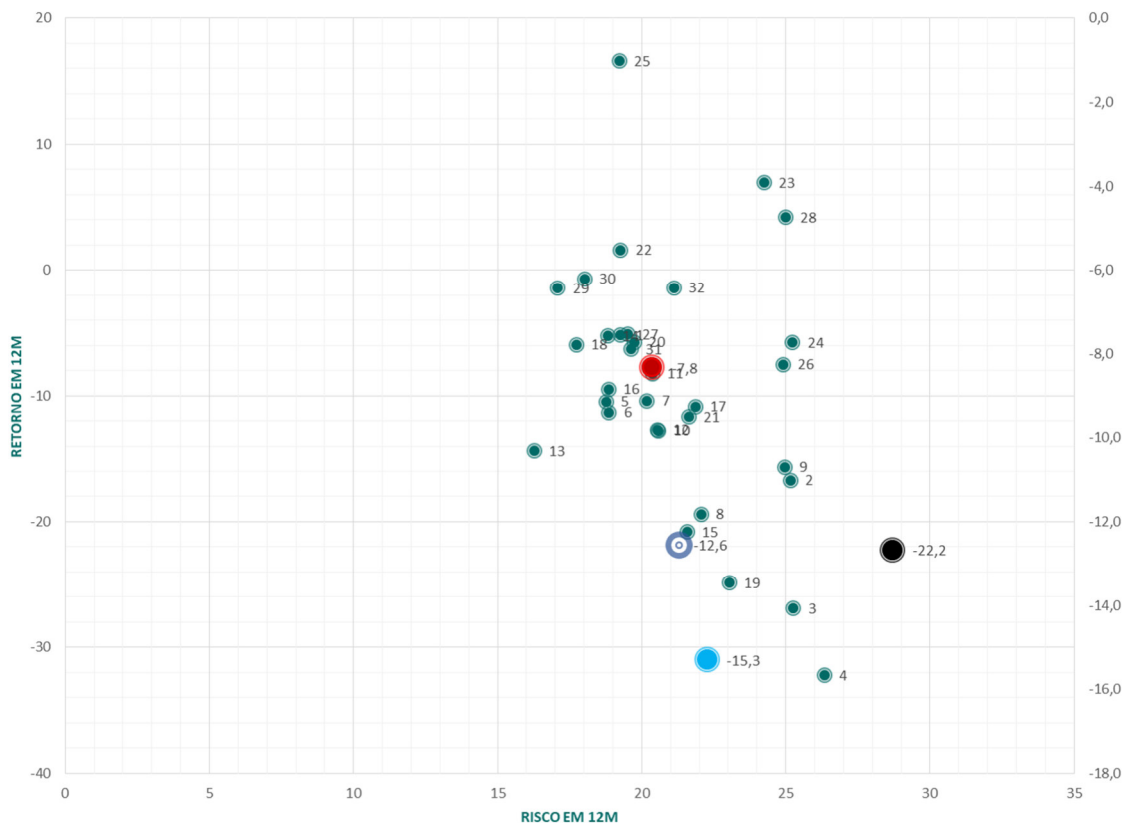


Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

Nº	art.	Fundos	Código	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso I, "a"	BB Ações Valor FICFIA	458236<BraNa>	-5,17	19,25	D+030	D+032
2	art. 8º, inciso I, "a"	Bradesco FIA Mid Small Caps	131679<BraNa>	-16,67	25,14	D+001	D+003
3	art. 8º, inciso I, "a"	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	252311<BraNa>	-26,88	25,24	D+001	D+032
4	art. 8º, inciso I, "a"	Caixa FIA Consumo	302198<BraNa>	-32,20	26,33	D+001	D+003
5	art. 8º, inciso I, "a"	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	173126<BraNa>	-10,44	18,75	D+001	D+003
6	art. 8º, inciso I, "a"	Itau Acoes Dunamis Fc	423701<BraNa>	-11,29	18,85	D+021	D+023
7	art. 8º, inciso I, "a"	Itau Fof Rpi Acoes Ibovespa Ativo Fc	208507<BraNa>	-10,37	20,17	D+002	D+004
8	art. 8º, inciso I, "a"	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	424838<BraNa>	-19,37	22,05	D+021	D+023
9	art. 8º, inciso I, "a"	Itau Small Cap Valuation Fc Acoes	025127<BraNa>	-15,63	24,94	D+001	D+003
10	art. 8º, inciso I, "a"	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	053872<BraNa>	-12,72	20,57	D+001	D+003
11	art. 8º, inciso I, "a"	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	055840<BraNa>	-8,21	20,35	D+001	D+003
12	art. 8º, inciso I, "a"	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	464066<BraNa>	-12,67	20,55	D+027	D+029
13	art. 8º, inciso I, "a"	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	520772<BraNa>	-14,34	16,27	D+027	D+029
14	art. 8º, inciso I, "a"	Occam Fc de FIA	378100<BraNa>	-5,22	18,80	D+001	D+003
15	art. 8º, inciso I, "a"	Sul America Equities FIA	255173<BraNa>	-20,75	21,57	D+001	D+003
16	art. 8º, inciso I, "a"	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	206032<BraNa>	-9,46	18,84	D+001	D+003
17	art. 8º, inciso I, "a"	Vinci Mosaico Institucional FIA	453099<BraNa>	-10,84	21,84	D+001	D+003
18	art. 8º, inciso I, "a"	Vinci Selection Equities FIA	320196<BraNa>	-5,90	17,72	D+060	D+062
19	art. 8º, inciso I, "a"	Brasil Capital Rp Inst Fc de FIA	586013<BraNa>	-24,83	23,02	D+030	D+032
20	art. 8º, inciso I, "a"	Bnpp Action Fc FIA	287393<BraNa>	-5,70	19,73	D+027	D+029
21	art. 8º, inciso I, "a"	Daycoval Ibovespa Ativo FIA	289140<BraNa>	-11,65	21,62	D+012	D+014
22	art. 8º, inciso I, "a"	Cx FIC FIA BR Acoes Livre Quantitativo	503452<BraNa>	1,64	19,26	D+013	D+015
23	art. 8º, inciso I, "a"	Guepardo Institucional FIC FIA	214019<BraNa>	6,97	24,23	D+030	D+032
24	art. 8º, inciso I, "a"	Trigono Flagship Institucional Fc de FIA	539961<BraNa>	-5,75	25,22	D+030	D+032
25	art. 8º, inciso I, "a"	Tarpon Gt Institucional Fc FIA	522775<BraNa>	16,64	19,22	D+030	D+032
26	art. 8º, inciso I, "a"	4um Small Caps FIA	213691<BraNa>	-7,48	24,89	D+017	D+020
27	art. 8º, inciso I, "a"	BB Acoes Quantitativo Fc	155942<BraNa>	-5,07	19,49	D+001	D+003
28	art. 8º, inciso I, "a"	Trigono Delphos Income Inst Fc de FIA	603783<BraNa>	4,25	24,97	D+030	D+032
29	art. 8º, inciso I, "a"	4um Marlin Dividendos FIA	213705<BraNa>	-1,43	17,08	D+001	D+004
30	art. 8º, inciso I, "a"	Constancia Fundamento FIA	236942<BraNa>	-0,65	18,01	D+014	D+015
31	art. 8º, inciso I, "a"	ARX Income Inst Fc FIA	561371<BraNa>	-6,25	19,62	D+001	D+003
32	art. 8º, inciso I, "a"	Claritas Valor Feeder Fc FIA	245755<BraNa>	-1,37	21,10	D+031	D+033

Quadro 5. Legenda Gráfico 2.

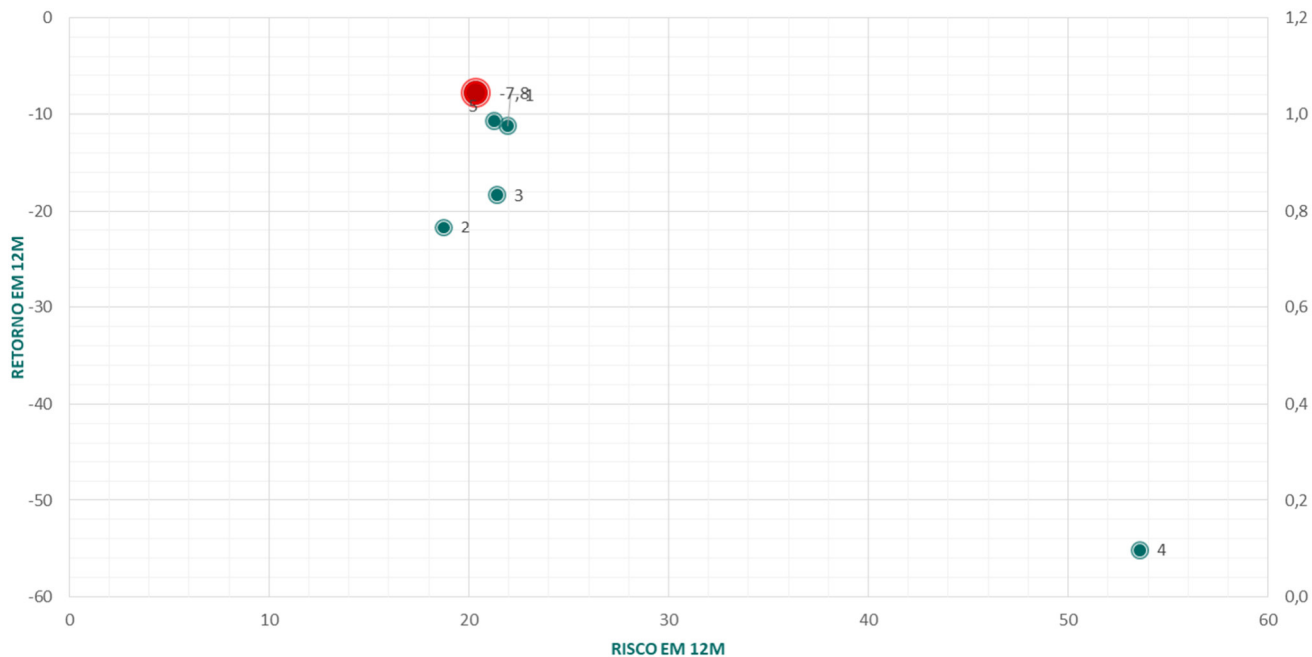


Gráfico 3: Art. 9-A-IIº Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	BB Mult Global Select Equity Ie FI	-11,14	21,94	D+001	D+005
2	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	-21,63	18,72	D+001	D+008
3	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	-18,25	21,37	D+001	D+004
4	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	-55,09	53,58	D+001	D+006
5	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	-10,60	21,22	D+001	D+006

Quadro 6. Legenda Gráfico 3.

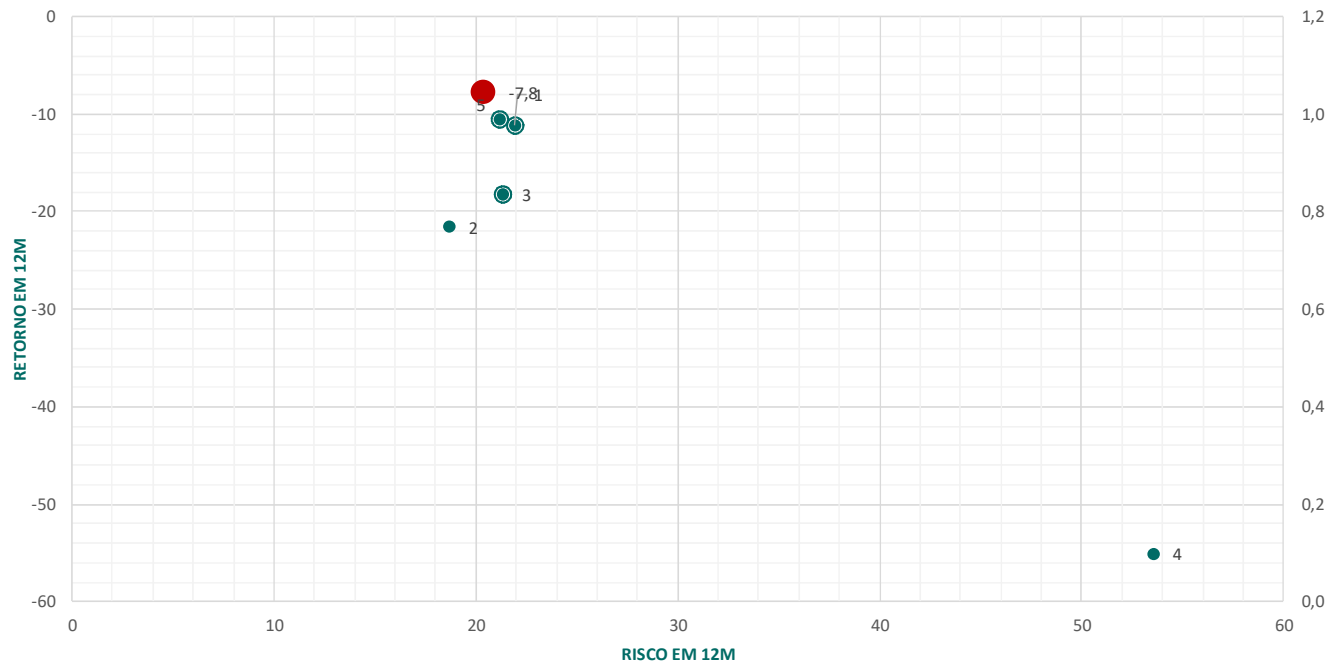


Gráfico 4: Art. 9-A-IIº Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - III - BDR Nível I	BB Acoes Esg Is FIA -Bdr Nível I	-14,42	21,31	D+001	D+004
2	art 9º - A - III - BDR Nível I	Safrá Consumo Americano FIA Bdr Nível I	-19,74	22,91	D+001	D+004
3	art 9º - A - III - BDR Nível I	Itau Acoes Bdr Nível I Fc	-6,61	19,68	D+001	D+003

Quadro 7. Legenda Gráfico 5.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

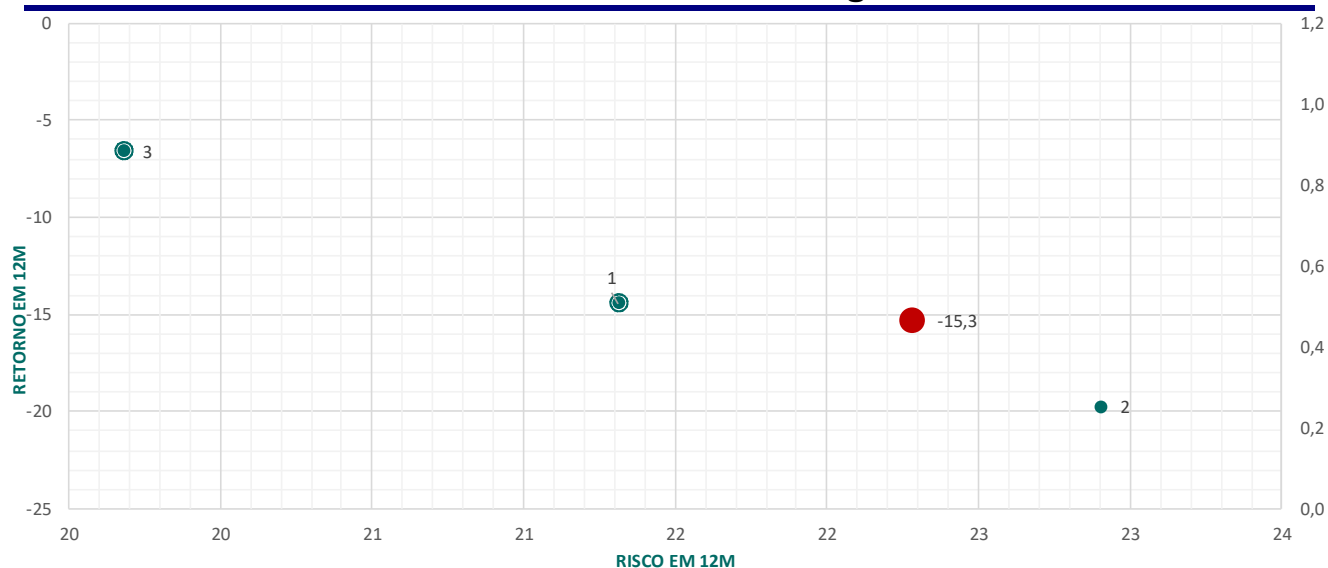


Gráfico 5: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 10º, inciso I, "a"	Safra S&P Reais Pb FICFI Mult	-5,33	20,85	D+001	D+002
2	art. 10º, inciso I, "a"	Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	-5,32	21,05	D+000	D+001
3	art. 10º, inciso I, "a"	BTG Pactual S&P 500 Brl FI Mult	-4,92	21,17	D+000	D+002
4	art. 10º, inciso I, "a"	Cx Fc Cap Prot Bolsa de Valores IV Mult			D+000	D+002
5	art. 10º, inciso I, "a"	Rio Bravo Protecao FI Mult			D+001	D+003
6	art. 10º, inciso I, "a"	Rio Bravo Protecao II FI Mult			D+001	D+003
7	art. 10º, inciso I, "b"	Vinci Strategic Partners I FIP Mult CI A			-	-

Quadro 7. Legenda Gráfico 5.

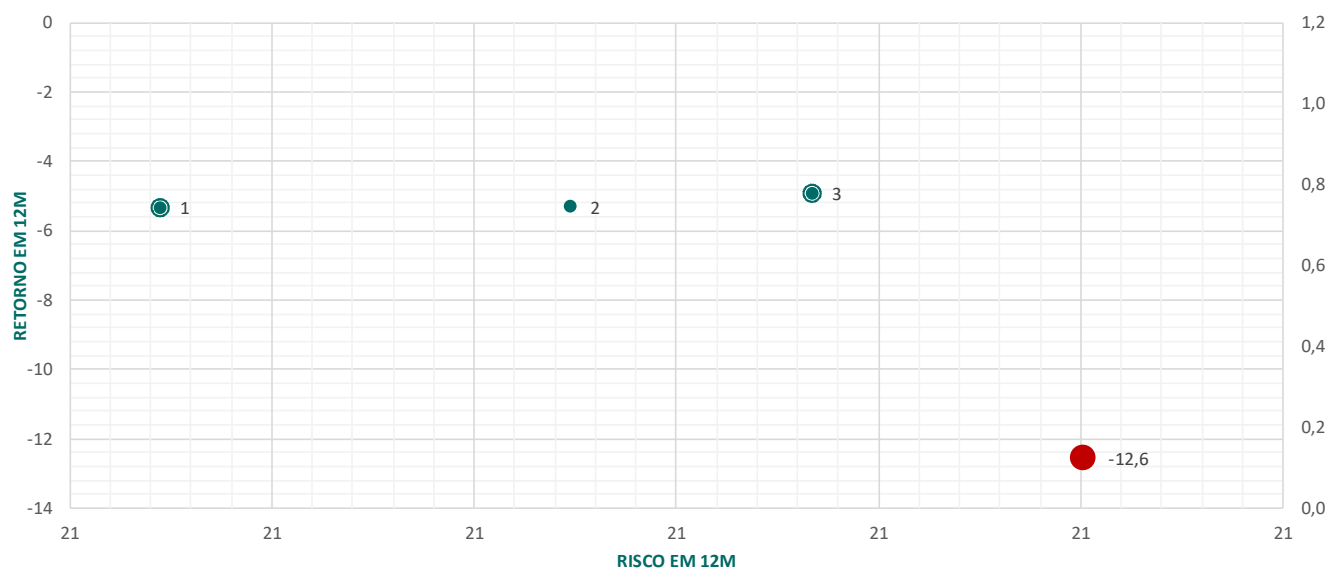


Gráfico 6: Art. 10º Resolução CMN nº. 4.963/2021 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw



Relatório de Investimentos – Agosto/2022

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 16 de setembro de 2022, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de agosto/2022, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

O Relatório da Carteira da Amazonprev reflete 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.

Ressalta-se o melhor desempenho, no referido mês, para os ativos de Renda Variável, como reflexo de uma expectativa mais positiva para a economia brasileira.

Todas as operações efetuadas foram devidamente autorizadas pela Diretoria, com registro nas Atas de Reunião do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 16 de setembro de 2022.

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Bruno Barroso
Membro

Leonardo Cavalcanti
Membro

Wellington Guimaraes
Membro

Claudinei Soares
Membro

André Luiz Bentes
Membro

Marcos Souza
Membro

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 20/09/2022 10:53:08
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 20/09/2022 11:18:46

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 20/09/2022 09:11:28
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 20/09/2022 09:19:40
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 20/09/2022 09:27:55
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 20/09/2022 10:03:02
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 20/09/2022 10:49:07

Documento assinado eletronicamente 201340/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MJxMzQw

