

Relatório de Investimentos – Agosto/2023

Processo: **2023.A.08319**
Destino: **DIRAF / PRESI**
Assunto: **Relatório de Investimentos – agosto/2023**
Data: **15/09/2023**

RELATÓRIO Nº. 035/2023-COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **agosto/2023**, destacando:

- 1) Cenário econômico externo e interno, **fornecido pela LDB CONSULTORIA**, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (**em anexo**);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 03 a 09);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 10 a 12);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (páginas 13 a 15);
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (páginas 16 a 18);
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (páginas 19 a 22)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 23 a 24);
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (páginas 25 a 26);
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 27 a 28);
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 29);
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 30 a 37);
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 38);
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 39);
- 14) Parecer do Comitê de Investimentos (página 40).

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1. SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 387.839.777,73	R\$ 390.706.815,26	1,0195	0,9433	0,7392	2,7262%	3,1256%	NC	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 388.455.286,02	R\$ 390.774.705,71	1,0316	0,9516	0,5971	2,6020%	3,2490%	NC	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 57.177.958,62	R\$ 56.231.267,91	0,9300	1,0500	0,8900	2,8975%	7,5825%	11,0156%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 48.329.580,86	R\$ 111.369.516,10	-	0,8930	0,6307	1,5293%	1,5293%	NC	
SAFRA SOBERANO REGIM PROP DI	R\$ 84.792.070,39	R\$ 85.752.437,16	1,0700	1,0400	1,1300	3,2751%	8,7256%	13,3869%	
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 966.594.673,62	R\$ 1.034.834.742,14							
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ -	R\$ 308.193,72	1,0900	1,0100	1,1000	3,2342%	8,4784%	12,9165%	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 92.582.064,23	R\$ 144.264.841,78	1,1300	1,1800	1,2700	3,6228%	6,9423%	NC	
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 22.017.142,21	R\$ 11.601.501,41	1,1154	1,1411	1,2372	3,5345%	8,9688%	13,7588%	
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 51.209.740,88	R\$ 51.795.124,49	1,0800	1,0600	1,1400	3,3160%	8,8333%	13,4880%	
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 165.808.947,32	R\$ 207.969.661,40							
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 64.192.447,91	R\$ 65.249.383,50	1,1141	0,8975	1,6465	3,7014%	6,8222%	11,7451%	
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 95.902.788,40	R\$ 97.155.975,99	1,2000	1,1900	1,3100	3,7458%	9,1774%	14,2869%	
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 95.255.908,82	R\$ 97.142.565,18	1,3600	1,6300	1,9800	5,0518%	7,8546%	13,0361%	
PORTO SEGURO FI REFER DI CRED PRIV	R\$ 96.249.697,20	R\$ 97.800.940,62	1,2803	1,3543	1,6117	4,3064%	8,7333%	13,6498%	
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REF CP	R\$ 101.840.956,64	R\$ 103.042.726,92	1,1074	1,1344	1,1800	3,4610%	9,0531%	13,9283%	
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 33.048.890,69	R\$ 33.441.491,33	-	1,1000	1,1900	2,3031%	2,3031%	NC	
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 486.490.689,66	R\$ 493.833.083,54							
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.618.894.310,60	R\$ 1.736.637.487,08							

Quadro 1.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a **Ata de reunião do COMIV nº. 201/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 24/07/2023, constante do processo nº 2023.A.06283: **Item 3.1. FPREV Executivo: a) Recursos Novos:** Aplicar no Fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF; **Item 10. Pagamento de CUPOM de NTN B:** Com o objetivo de manter a estratégia de baixa volatilidade para esses recursos, pois os títulos públicos são contabilizados pelo seu valor de aquisição, o Comitê sugere direcionar os recursos para o FUNDO BRADESCO DI PREMIUM, possibilitando, inclusive, a compra de Títulos.

Nota 3: Registra-se que houve uma operação que foi efetivada em desacordo com a sugestão do COMIV na Ata nº 199/2023, devidamente aprovada pela diretoria, apesar de o financeiro ter emitido ordem de aplicação de acordo com a Ata, Item 3.1. FPREV Executivo: a) Recursos Novos: Aplicar no Fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF, o banco aplicou no Fundo CAIXA FI RF DI, tão logo constatou-se o equívoco, foram tomadas as devidas providências, sendo regularizado no de imediato. Destaca-se que todas as operações financeiras são acompanhadas pelo financeiro em conjunto com o Comitê.



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 71.000.932,90	R\$ 66.895.504,45	8,6500	3,6100	(5,7800)	6,0656%	0,2487%	-2,6272%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 79.714.603,53	R\$ 75.096.168,64	8,7400	3,6300	(5,7900)	6,1627%	6,7578%	0,6979%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 106.153.351,67	R\$ 99.981.263,45	8,1775	3,8244	(5,8143)	5,7843%	1,7580%	-1,5998%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 54.052.335,59	R\$ 51.728.605,22	8,9617	3,2736	(4,2990)	7,6911%	3,9408%	1,0986%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 120.404.577,05	R\$ 108.030.379,88	6,4800	2,9100	(10,2800)	-1,6861%	-3,7881%	-10,4270%
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 37.311.040,16	R\$ 34.776.895,93	11,3900	6,1100	(6,8700)	10,0759%	17,4597%	16,2452%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 203.073.073,68	R\$ 188.483.693,10	9,3900	3,0600	(7,1800)	4,6428%	9,9200%	-2,9121%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT	R\$ 14.246.581,10	R\$ 13.761.739,71	9,7742	1,8985	(3,4032)	8,0515%	11,9344%	7,4156%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 19.499.959,01	R\$ 18.547.209,78	8,6507	2,7402	(4,8859)	6,1739%	1,0611%	1,7685%
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 87.067.240,86	R\$ 83.578.311,82	8,1300	3,2700	(4,0100)	7,1881%	3,3815%	4,3093%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 52.502.672,70	R\$ 49.905.253,70	5,2700	2,6100	(4,9500)	2,6707%	-3,9840%	-2,0943%
ITAÚ SMALL CAPS VALUATION	R\$ 79.015.650,20	R\$ 73.400.955,09	6,6300	2,7600	(7,1100)	1,7823%	6,1434%	-2,1719%
OCCAM FIC FIA	R\$ 96.621.843,99	R\$ 91.051.529,84	10,1500	2,8500	(5,7700)	6,7525%	1,3318%	-0,3738%
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 107.827.582,42	R\$ 102.848.280,07	10,3300	3,9000	(4,6200)	9,3368%	10,3286%	4,3146%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 75.761.420,16	R\$ 73.223.532,46	9,5579	5,3187	(3,3498)	11,5198%	23,0318%	19,4519%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 39.062.619,79	R\$ 37.022.796,07	8,7500	3,2800	(5,2200)	6,4541%	5,0984%	-0,6940%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 44.911.537,25	R\$ 45.995.975,77	3,8300	2,5100	2,4100	9,0012%	11,0177%	10,2059%
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.320.060,36	R\$ 5.441.157,73	7,3000	1,0800	2,2800	10,9317%	14,4825%	16,4814%
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 79.456.279,80	R\$ 77.760.238,83	10,1248	5,9069	(2,1346)	14,1402%	29,3843%	27,4823%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 45.427.199,98	R\$ 43.215.811,74	8,1600	1,4500	(4,8700)	4,3846%	7,9419%	0,9417%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 15.573.589,42	R\$ 14.925.334,00	8,3100	4,4400	(4,1600)	8,4132%	5,8031%	2,5026%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 1.434.004.151,62	R\$ 1.355.670.637,28						
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.434.004.151,62	R\$ 1.355.670.637,28						

Quadro 2.

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

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.672.527,30	R\$ 34.118.323,80	(0,4522)	0,1527	4,4251	4,1116%	1,9872%	2,3562%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 16.369.663,94	R\$ 15.553.199,43	4,0177	5,4848	(4,4987)	4,7868%	21,7637%	-2,8896%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 46.051.424,43	R\$ 47.016.197,90	(0,7754)	1,7742	2,0950	3,1007%	4,9631%	7,7256%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 26.243.585,53	R\$ 26.585.690,73	(2,5700)	1,8100	1,3000	0,4830%	6,0764%	9,2991%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exte	R\$ 121.337.201,20	R\$ 123.273.411,86						
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 62.379.855,13	R\$ 64.143.013,05	1,4691	2,2021	2,8264	6,6346%	13,1332%	12,1060%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 28.172.174,71	R\$ 29.232.955,32	(0,0600)	1,5500	3,7700	5,3152%	13,2227%	9,5889%
ITAÚ BDR NIVEL I AÇÕES FIC	R\$ 31.275.967,76	R\$ 32.125.293,63	(1,0200)	1,9000	2,7200	3,6040%	4,5060%	5,6541%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 121.827.997,60	R\$ 125.501.262,00						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 243.165.198,80	R\$ 248.774.673,86						

Quadro 3.

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

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:56 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 379259/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzcs5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

2.4 SALDOS E PERFORMANCE – FUNDOS ESTRUTURADOS

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 18.696.209,19	R\$ 18.528.958,11	7,0700	3,6800	(0,8900)	10,0222%	21,1712%	26,5633%	
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV FIM	R\$ 16.628.727,19	R\$ 16.081.169,80	4,2407	1,1933	(3,2928)	2,0112%	7,0639%	-5,5680%	
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 19.790.549,03	R\$ 19.346.783,74	4,7570	4,3664	(2,2423)	6,8796%	13,2593%	NC	
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MM	R\$ 16.493.335,67	R\$ 16.049.073,68	3,9600	1,9900	(2,6900)	3,1766%	4,7126%	6,9046%	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 32.589.997,09	R\$ 32.939.464,57	1,8500	0,8900	1,0700	3,8560%	9,4856%	NC	
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MM	R\$ 10.504.875,94	R\$ 10.499.239,27	(0,7800)	0,8400	(0,0500)	0,0034%	2,0606%	1,1577%	
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 114.703.694,11	R\$ 113.444.689,17							
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.895.785,99	R\$ 40.813.196,00	(0,2600)	(0,1700)	(0,2000)	-0,6287%	15,8826%	15,4082%	
BTG PACTUAL INV DE IMPACTO CL A FIP MULT	R\$ 21.294.653,77	R\$ 22.885.503,63	(0,2100)	(0,2100)	(1,1800)	-1,5946%	9,4247%	6,3914%	
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA R II FIP MULT	R\$ 7.059.619,30	R\$ 6.890.569,14	(3,3500)	(1,5100)	(2,3900)	-7,0845%	-8,2087%	NC	
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.592.712,04	R\$ 1.595.670,77	(2,4100)	3,4000	0,1900	1,0998%	12,7313%	31,6200%	
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 22.873.975,75	R\$ 22.724.698,78	(0,5211)	(0,7972)	(0,6526)	-1,9582%	-6,7725%	-7,6575%	
TOTAL art. 10º, inciso II	R\$ 93.716.746,85	R\$ 94.909.638,32							
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 208.420.440,96	R\$ 208.354.327,49							
TOTAL GERAL	R\$ 3.504.484.101,98	R\$ 3.549.437.125,71							
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.015.683,21	R\$ -							
TOTAL RECURSOS	R\$ 3.506.499.785,19	R\$ 3.549.437.125,71							

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: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

5. DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	jun/23	jul/23	ago/23
BRASESCO	R\$ 173.093.211,00	R\$ 212.986.641,28	R\$ 252.603.415,38
BTG	R\$ 378.272.619,35	R\$ 386.275.250,75	R\$ 374.744.485,16
ITAÚ	R\$ 304.208.080,87	R\$ 309.906.819,94	R\$ 304.382.602,90
BANCO DO BRASIL	R\$ 603.227.218,62	R\$ 610.425.320,12	R\$ 606.559.696,98
CAIXA	R\$ 496.925.326,88	R\$ 566.645.825,03	R\$ 619.166.684,38
ICATU	R\$ 84.312.227,89	R\$ 87.067.240,86	R\$ 83.578.311,82
SANTANDER	R\$ 108.859.126,89	R\$ 110.243.872,34	R\$ 112.265.581,40
PORTO	R\$ 94.963.577,43	R\$ 96.249.697,20	R\$ 97.800.940,62
VINCI	R\$ 143.143.610,24	R\$ 148.482.914,25	R\$ 141.466.746,91
SAFRA	R\$ 111.659.557,82	R\$ 146.013.135,79	R\$ 148.426.883,81
OCCAM	R\$ 93.939.981,36	R\$ 96.621.843,99	R\$ 91.051.529,84
BNP	R\$ 100.698.680,39	R\$ 101.840.956,64	R\$ 103.042.726,92
AZ QUEST	R\$ 76.919.827,68	R\$ 79.714.603,53	R\$ 75.096.168,64
RIO BRAVO	R\$ 70.621.349,75	R\$ 59.588.208,70	R\$ 59.487.777,52
ARX	R\$ 68.525.892,14	R\$ 71.000.932,90	R\$ 66.895.504,45
TARPON	R\$ 75.024.634,45	R\$ 79.456.279,80	R\$ 77.760.238,83
GUEPARDO	R\$ 71.935.418,87	R\$ 75.761.420,16	R\$ 73.223.532,46
TRÍGONO	R\$ 49.074.544,81	R\$ 50.231.597,61	R\$ 51.437.133,50
GENIAL/PLURAL	R\$ 48.141.201,15	R\$ 49.042.191,24	R\$ 49.671.523,23
CONSTANCIA	R\$ 44.779.656,17	R\$ 45.427.199,98	R\$ 43.215.811,74
BRASIL CAPITAL	R\$ 35.161.257,29	R\$ 37.311.040,16	R\$ 34.776.895,93
SCHRODER	R\$ 25.776.558,64	R\$ 26.243.585,53	R\$ 26.585.690,73
DAYCOVAL	R\$ 18.979.869,05	R\$ 19.499.959,01	R\$ 18.547.209,78
INTRAG/KINEA	R\$ 23.057.801,94	R\$ 22.873.975,75	R\$ 22.724.698,78
CLARITAS	R\$ 14.910.825,42	R\$ 15.573.589,42	R\$ 14.925.334,00
TOTAL	R\$ 3.382.412.969,70	R\$ 3.504.484.101,98	R\$ 3.549.437.125,71

Quadro 5.

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC AGOSTO/2023

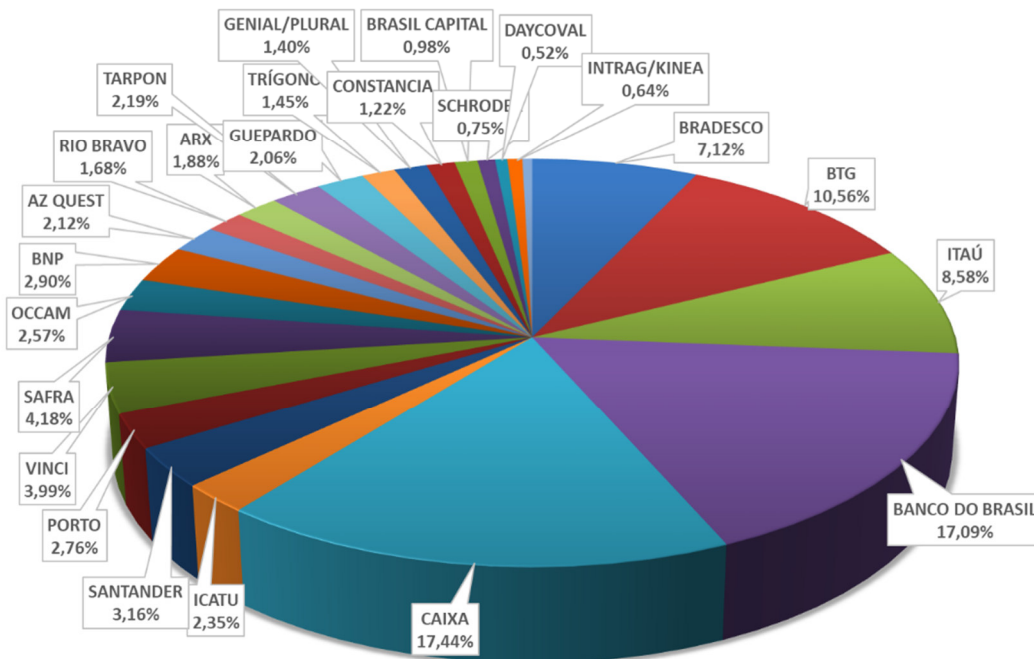


Gráfico 1.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:08 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzcs5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
14/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2030	R\$ 99.437.031,23	2.288,5392690	6,5998%	43.450	BANCO BRADESCO
28/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2030	R\$ 98.620.663,31	2.235,6371889	6,9000%	44.113	BANCO BRADESCO
14/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 99.980.152,45	2.254,3439110	6,6000%	44.350	BANCO BRADESCO
26/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 32.996.277,05	4.035,2546230	5,9080%	8.177	BTG PACTUAL CTVM
26/05/2022	EXECUTIVO	15/05/2025	R\$ 32.996.442,13	3.995,2103320	5,7700%	8.259	ITAU UNIBANCO S/A
26/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R\$ 32.999.881,95	4.101,4021820	5,7600%	8.046	ITAU UNIBANCO S/A
27/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.996.790,45	4.042,2342330	5,8400%	24.738	XP INVESTIMENTOS CCTVM
30/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.996.581,53	4.045,3328020	5,8300%	24.719	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.996.708,44	4.032,4505380	6,0200%	24.798	BRADESCO
31/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 60.469.094,79	4.031,2729860	6,0350%	15.000	XP INVESTIMENTOS CCTVM
07/07/2022	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 49.997.001,46	4.077,3936930	6,0348%	12.262	XP INVESTIMENTOS CCTVM
07/07/2022	EXECUTIVO	15/05/2035	R\$ 49.997.851,49	4.023,0006030	6,0300%	12.428	BANCO BRADESCO
18/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.997.037,06	3.988,7130860	6,7000%	25.070	XP INVESTIMENTOS CCTVM
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 99.998.464,79	3.977,3472590	7,0100%	25.142	XP INVESTIMENTOS CCTVM
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2028	R\$ 44.998.285,53	3.989,9119550	6,3100%	11.295	BGC LIQUIDEZ
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R\$ 44.998.054,42	3.955,8729160	6,3100%	11.375	BGC LIQUIDEZ
15/12/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R\$ 30.000.634,84	3.947,4519530	6,4350%	7.600	BGC LIQUIDEZ
20/12/2022	EXECUTIVO	15/08/2026	R\$ 43.796.819,33	3.997,5191060	6,5830%	3.656	XP INVESTIMENTOS CCTVM
02/01/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R\$ 49.999.402,21	4.002,5137860	6,3300%	12.492	XP INVESTIMENTOS CCTVM
04/01/2023	EXECUTIVO	15/08/2026	R\$ 49.998.898,46	4.042,6017520	6,3700%	12.368	BANCO BRADESCO
02/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2032	R\$ 49.999.079,97	4.050,1482360	6,3230%	12.345	XP INVESTIMENTOS CCTVM
02/02/2023	EXECUTIVO	15/05/2033	R\$ 50.001.797,93	3.967,7668570	6,3890%	12.602	BGC LIQUIDEZ
07/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 99.998.414,72	3.945,3331780	6,4990%	25.346	BGC LIQUIDEZ
10/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 50.000.319,67	3.989,4933110	6,4000%	12.533	BGC LIQUIDEZ
10/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 49.996.382,76	3.992,6834980	6,3920%	12.522	BRADESCO
13/02/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R\$ 49.996.084,50	3.970,4641440	6,3800%	12.592	XP INVESTIMENTOS CCTVM
27/02/2023	EXECUTIVO	15/05/2033	R\$ 49.999.200,55	4.029,5938550	6,2900%	12.408	XP INVESTIMENTOS CCTVM
27/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 49.998.484,59	3.900,3420380	6,3800%	12.819	BTG PACTUAL CTVM
28/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 45.001.168,51	3.914,5066550	6,3500%	11.496	BTG PACTUAL CTVM
01/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 49.998.152,56	3.876,7273440	6,4510%	12.897	BTG PACTUAL CTVM
03/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 33.278.800,15	3.870,0663039	6,4810%	8.599	BTG PACTUAL CTVM
28/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 80.401.529,70	4.032,7797410	6,1900%	19.937	BGC LIQUIDEZ
29/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 24.998.990,87	4.025,6023950	6,2130%	6.210	BTG PACTUAL CTVM
29/03/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R\$ 15.002.435,16	4.134,0411010	6,1230%	3.629	BTG PACTUAL CTVM
30/03/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R\$ 25.002.106,94	4.140,7928030	6,1100%	6.038	XP INVESTIMENTOS CCTVM
30/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 15.005.470,96	4.047,8745510	6,1650%	3.707	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R\$ 20.000.649,11	4.035,6434850	6,2001%	4.956	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/03/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R\$ 10.078.203,03	4.135,4957040	6,1330%	2.437	XP INVESTIMENTOS CCTVM
20/04/2023	EXECUTIVO	15/05/2045	R\$ 80.001.923,16	4.159,1849840	6,1076%	19.235	BGC LIQUIDEZ
24/04/2023	EXECUTIVO	15/05/2045	R\$ 19.990.851,03	4.164,7606320	6,1005%	4.800	BGC LIQUIDEZ
15/05/2023	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 14.166.225,80	4.131,2993880	6,9900%	3.429	BRADESCO
15/05/2023	EXECUTIVO	15/08/2024	R\$ 66.001.441,62	4.131,2870320	6,9902%	15.976	BGC LIQUIDEZ
18/05/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R\$ 84.534.868,51	4.121,0387810	6,0530%	20.513	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R\$ 76.731.768,52	4.110,9975100	6,2150%	18.665	BGC LIQUIDEZ
24/05/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R\$ 17.682.335,73	4.112,1711020	6,2770%	4.300	BGC LIQUIDEZ
24/11/2022	EXECUTIVO - LTN	01/01/2025	R\$ 10.005.811,97	758,0160580	14,0800%	13.200	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 2.459.144.570,95			1.191.348	

Quadro 6.

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

2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/07/2023	31/08/2023
CVS - A	R\$ 736.785,45	R\$ 720.370,35
CVS - B	R\$ 4.766.908,45	R\$ 4.660.791,65
CVS - C	R\$ 95.577,30	R\$ 93.447,90
CVS - D	R\$ 522.754,98	R\$ 511.117,86
TOTAL	R\$ 6.122.026,18	R\$ 5.985.727,76

Quadro 7.

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.



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/23	R\$ 20.548,63	R\$ 147.749,14	R\$ 168.297,77
fev/23	R\$ 20.137,49	R\$ 147.891,88	R\$ 168.029,37
mar/23	R\$ 19.756,14	R\$ 148.193,21	R\$ 167.949,35
abr/23	R\$ 19.342,87	R\$ 148.335,95	R\$ 167.678,82
mai/23	R\$ 18.953,86	R\$ 148.637,28	R\$ 167.591,14
jun/23	R\$ 18.556,69	R\$ 148.922,76	R\$ 167.479,45
jul/23	R\$ 18.154,01	R\$ 149.208,24	R\$ 167.362,25
ago/23	R\$ 17.760,31	R\$ 149.509,57	R\$ 167.269,88
TOTAL	R\$ 153.210,00	R\$ 1.188.448,03	R\$ 1.341.658,03

Quadro 8.

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2023			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/23	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/23	R\$ -	R\$ 200.728,73	R\$ 200.728,73
mar/23	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84
abr/23	R\$ 43.635,72	R\$ 100.364,40	R\$ 144.000,12
mai/23	R\$ -	R\$ -	R\$ -
jun/23	R\$ 87.271,44	R\$ -	R\$ 87.271,44
jul/22	R\$ -	R\$ -	R\$ -
ago/22	R\$ 43.635,72	R\$ 200.728,80	R\$ 244.364,52
TOTAL	R\$ 261.814,32	R\$ 602.186,33	R\$ 864.000,65

Quadro 9.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	31/07/2023	31/08/2023	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.504.484.101,98	R\$ 3.549.437.125,71	55,8913%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.771.070.711,02	R\$ 2.729.696.801,49	42,9833%
TÍTULOS CVS	R\$ 6.122.026,18	R\$ 5.985.727,76	0,0943%
IMÓVEIS	R\$ 65.484.778,63	R\$ 65.484.778,63	1,0312%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 2.015.683,21	R\$ -	0,0000%
TOTAL	R\$ 6.349.177.301,02	R\$ 6.350.604.433,59	100,00%

Quadro 10.

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

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
ago/22	R\$ 5.480.240.218,85	2,53%	6,64%	8,98%
set/22	R\$ 5.511.466.216,21	0,57%	7,25%	10,53%
out/22	R\$ 5.705.500.023,14	3,52%	11,02%	15,76%
nov/22	R\$ 5.675.963.312,47	-0,52%	10,45%	14,00%
dez/22	R\$ 5.780.297.494,50	1,84%	12,48%	12,48%
jan/23	R\$ 5.771.604.745,47	-0,15%	-0,15%	12,56%
fev/23	R\$ 5.742.296.217,39	-0,51%	-0,66%	10,78%
mar/23	R\$ 5.791.959.003,03	0,86%	0,20%	8,86%
abr/23	R\$ 5.880.428.580,01	1,53%	1,73%	12,49%
mai/23	R\$ 6.042.794.420,25	2,76%	4,54%	14,26%
jun/23	R\$ 6.221.758.620,80	2,96%	7,64%	19,64%
jul/23	R\$ 6.349.177.301,02	2,05%	9,84%	18,78%
ago/23	R\$ 6.350.604.433,59	0,02%	9,87%	15,88%

Quadro 11.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:55 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzcs5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 08/2022		R\$ 5.480.240.218,85	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2022	R\$ 48.483.431,53	R\$ 10.781.769,44	R\$ 37.701.662,09
10/2022	R\$ 47.905.531,55	R\$ 10.820.436,66	R\$ 37.085.094,89
11/2022	R\$ 47.465.381,12	R\$ 11.535.636,72	R\$ 35.929.744,40
12/2022	R\$ 110.680.756,99	R\$ 16.540.401,56	R\$ 94.140.355,43
01/2023	R\$ 33.677.075,44	R\$ 13.128.151,27	R\$ 20.548.924,17
02/2023	R\$ 48.396.223,00	R\$ 19.336.309,60	R\$ 29.059.913,40
03/2023	R\$ 47.844.489,27	R\$ 13.501.061,49	R\$ 34.343.427,78
04/2023	R\$ 48.529.359,82	R\$ 12.897.196,53	R\$ 35.632.163,29
05/2023	R\$ 49.523.530,80	R\$ 17.943.389,07	R\$ 31.580.141,73
06/2023	R\$ 48.501.155,60	R\$ 14.660.037,39	R\$ 33.841.118,21
07/2023	R\$ 54.934.340,93	R\$ 13.180.680,80	R\$ 41.753.660,13
08/2023	R\$ 51.193.351,70	R\$ 14.114.289,57	R\$ 37.079.062,13
Saldo dos Investimentos em 08/2023		R\$ 6.350.604.433,59	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)	
Item	Em 12 meses	No ano	No mês		
IPCA (IBGE)	4,6082 %	3,2312 %	0,2300 %		
Juros	5,1200 %	3,3848 %	0,4170 %		
Meta	9,9642 %	6,7254 %	0,6479 %		
Rentabilidade em %	7,0438 %	5,2087 %	-0,5615 %		
Rentabilidade em R\$	R\$ 401.668.947,09	R\$ 306.468.528,25	R\$ -35.651.929,56		
Resultado em %	-2,6558 %	-1,4211 %	-1,2017 %		
Resultado em R\$	R\$ -166.429.718,98	R\$ -89.220.371,43	R\$ -76.790.091,49		

Quadro 13.

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

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:38 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

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					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 218.402,65	R\$ 627.085,78	-	0,8930	0,6307	1,5293%	1,5293%	1,5293%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 75.323,80	R\$ 75.602,71	2,2200	0,9000	0,3700	3,5216%	11,6720%	12,7814%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 293.726,45	R\$ 702.688,49						
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 61.220,25	R\$ 61.913,64	1,0700	1,0400	1,1300	3,2751%	7,5320%	NC
BRANCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 442.425,99	R\$ 435.575,94	1,0400	1,0100	1,1000	3,1832%	5,4746%	NC
ITAÚ SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 3.889,38	R\$ 3.933,84	1,0800	1,0600	1,1400	3,3160%	4,4938%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 507.535,62	R\$ 501.423,42						
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 1.109.228,40	R\$ 1.131.197,99	1,3600	1,6300	1,9800	5,0518%	7,8546%	13,0361%
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 1.109.228,40	R\$ 1.131.197,99						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.910.490,47	R\$ 2.335.309,90						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 501.230,50	R\$ 481.145,37	8,1300	3,2700	(4,0100)	7,1881%	3,3815%	4,3093%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.150.195,16	R\$ 1.067.561,68	9,3900	3,0600	(7,1800)	4,6428%	1,4167%	-2,9121%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 568.367,80	R\$ 549.025,04	9,7742	1,8985	(3,4032)	8,0515%	11,9344%	7,4156%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.013.568,29	R\$ 955.135,40	10,1500	2,8500	(5,7700)	6,7525%	1,3318%	-0,3738%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 128.912,35	R\$ 120.156,70	11,3900	6,1100	(6,8700)	10,0759%	17,4597%	16,2452%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 3.362.274,10	R\$ 3.173.024,19						
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 3.362.274,10	R\$ 3.173.024,19						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.004.970,24	R\$ 1.042.810,88	(0,0600)	1,5500	3,7700	5,3152%	13,2223%	9,5885%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 1.004.970,24	R\$ 1.042.810,88						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.004.970,24	R\$ 1.042.810,88						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/06/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 517.004,61	R\$ 512.029,77	6,9200	3,5900	(0,9600)	9,6951%	22,9353%	23,1216%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 517.004,61	R\$ 512.029,77						
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 517.004,61	R\$ 512.029,77						
TOTAL GERAL	R\$ 6.794.739,42	R\$ 7.063.174,74						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.384,91	R\$ -						
TOTAL DOS RECURSOS	R\$ 6.798.124,33	R\$ 7.063.174,74						

Quadro 14.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base as **Ata de reunião do COMIV nº. 201/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 24/07/2023, constante do processo nº 2023.A.06283: **Item 3.2. FPREV ALE: a) Recursos Novos:** Aplicar no Fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF.



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

3.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
29/01/2014	ASSEMBLEIA	15/08/2030	R\$ 1.357.103,79	2.288,5392690	6,5998%	593	BANCO BRADESCO
12/07/2022	ASSEMBLEIA	15/05/2035	R\$ 5.499.958,54	3.946,4559030	6,2700%	1.394	BTG PACTUAL CTVM
20/12/2022	ASSEMBLEIA	15/08/2026	R\$ 1.199.255,73	3.997,5191060	6,5830%	300	XP INVESTIMENTOS CCTVM
28/02/2023	ASSEMBLEIA	15/05/2033	R\$ 3.000.163,99	4.043,3477691	6,2500%	742	BTG PACTUAL CTVM
28/03/2023	ASSEMBLEIA	15/08/2040	R\$ 2.601.142,93	4.032,7797410	6,1900%	645	BGC LIQUIDEZ
24/04/2023	ASSEMBLEIA	15/05/2045	R\$ 495.606,52	4.164,7606320	6,1005%	119	BGC LIQUIDEZ
18/05/2023	ASSEMBLEIA	15/05/2025	R\$ 271.988,55	4.121,0387810	6,0530%	66	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	ASSEMBLEIA	15/05/2025	R\$ 295.991,82	4.110,9975100	6,2150%	72	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 14.721.211,86			3.931	

Quadro 15.

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

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	31/07/2023	31/08/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 1.910.490,47	R\$ 2.335.309,90
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 3.362.274,10	R\$ 3.173.024,19
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.004.970,24	R\$ 1.042.810,88
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 517.004,61	R\$ 512.029,77
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 16.198.376,36	R\$ 16.137.032,76
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 3.384,91	R\$ -
TOTAL	R\$ 22.996.500,69	R\$ 23.200.207,50

Quadro 16.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

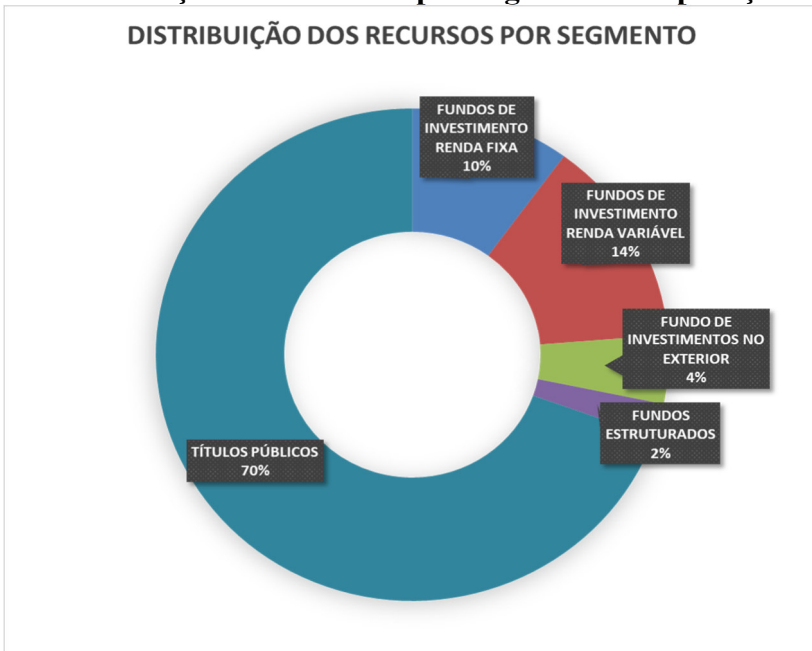


Gráfico 2.



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 08/2022		R\$ 19.207.261,67	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2022	R\$ 211.199,86	R\$ 0,00	R\$ 211.199,86
10/2022	R\$ 209.483,44	R\$ 0,00	R\$ 209.483,44
11/2022	R\$ 208.368,70	R\$ 0,00	R\$ 208.368,70
12/2022	R\$ 215.348,54	R\$ 0,00	R\$ 215.348,54
01/2023	R\$ 415.713,96	R\$ 50.378,58	R\$ 365.335,38
02/2023	R\$ 206.662,34	R\$ 10.022,51	R\$ 196.639,83
03/2023	R\$ 205.889,22	R\$ 10.391,50	R\$ 195.497,72
04/2023	R\$ 206.002,88	R\$ 12.482,71	R\$ 193.520,17
05/2023	R\$ 228.539,50	R\$ 11.441,00	R\$ 217.098,50
06/2023	R\$ 217.377,92	R\$ 11.524,07	R\$ 205.853,85
07/2023	R\$ 217.377,92	R\$ 10.805,73	R\$ 206.572,19
08/2023	R\$ 216.019,28	R\$ 11.691,42	R\$ 204.327,86
Saldo dos Investimentos em 08/2023		R\$ 23.200.207,50	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês	
IPCA (IBGE)	4,6082 %	3,2312 %	0,2300 %	
Juros	5,1200 %	3,3848 %	0,4170 %	
Meta	9,9642 %	6,7254 %	0,6479 %	
Rentabilidade em %	6,6769 %	5,5704 %	-0,0027 %	
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.363.699,79	R\$ 1.174.150,51	R\$ -621,05	
Resultado em %	-2,9894 %	-1,0822 %	-0,6464 %	
Resultado em R\$	R\$ -670.711,69	R\$ -243.352,95	R\$ -149.622,05	

Quadro 17.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 1.811.189,47	R\$ 3.610.785,66	-	0,8930	0,6307	4,7612%	1,5293%	NC
BRASESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 4.794.011,61	R\$ 4.655.289,20	1,0400	1,0100	1,1000	3,1832%	3,1832%	NC
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 6.605.201,08	R\$ 8.266.074,86						
BRASESCO RF DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 4.187.875,46	1,0400	1,0100	1,2700	3,3567%	4,4833%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ -	R\$ 4.187.875,46						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 6.605.201,08	R\$ 12.453.950,32						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.521.208,98	R\$ 1.417.889,35	11,3900	6,1100	(6,8700)	10,0759%	17,4597%	16,2452%
BB AÇÕES VALOR	R\$ 16.269.537,31	R\$ 15.323.575,47	8,1775	3,8244	(5,8143)	5,7843%	1,7580%	-1,5998%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 8.756.747,75	R\$ 8.463.410,56	9,5579	5,3187	(3,5500)	11,2888%	22,6809%	19,1112%
OCCAM FIC FIA	R\$ 6.483.354,68	R\$ 6.109.584,93	10,1500	2,8500	(5,7700)	6,7525%	1,3318%	-3,0349%
TARPON GT INST FIC FIA	R\$ 8.994.157,96	R\$ 8.802.172,38	10,1248	5,9069	(2,1346)	14,1402%	29,3843%	27,4823%
TRIGONO FLAGSHIP INST FI FIA	R\$ 6.363.692,23	R\$ 6.517.350,59	3,8300	2,5100	2,4100	9,0012%	11,0177%	10,2059%
TOTAL art. 8º, inciso I - RENDA VARIÁVEL	R\$ 48.388.698,91	R\$ 46.633.983,28						
FUNDO DE INVESTIMENTO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 8.247.795,43	R\$ 8.168.431,87	6,9200	3,5900	(0,9600)	9,6951%	22,9353%	19,2063%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 8.247.795,43	R\$ 8.168.431,87						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 9.088,62	R\$ 4.157,76						
TOTAL RECURSOS	R\$ 63.250.784,04	R\$ 67.260.523,23						

Quadro 18.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 201/2023, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 27.06.2023. **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF.

4.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
09/06/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/08/2024	R\$ 49.999.161,74	4.059,0324520	5,8090%	12.318	SANTANDER
12/07/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2035	R\$ 19.999.849,23	3.946,4559030	6,2700%	5.068	BTG PACTUAL CTVM
13/12/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2025	R\$ 12.000.000,00	3.970,9698140	6,3925%	3.022	XP INVESTIMENTOS CCTVM
15/12/2022	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/08/2028	R\$ 19.997.391,52	3.982,7507510	6,4600%	5.021	BGC LIQUIDEZ
04/01/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/08/2026	R\$ 49.998.898,47	4.042,6017520	6,3700%	12.368	XP INVESTIMENTOS CCTVM
28/02/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2033	R\$ 12.000.655,95	4.043,3477691	6,2500%	2.968	BTG PACTUAL CTVM
03/03/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/08/2040	R\$ 16.718.686,43	3.870,0663039	6,4810%	4.320	BTG PACTUAL CTVM
24/04/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2045	R\$ 3.519.222,73	4.164,7606320	6,1005%	845	BGC LIQUIDEZ
18/05/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2025	R\$ 1.442.363,57	4.121,0387810	6,0530%	350	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	MINISTÉRIO PÚBLICO	15/05/2025	R\$ 2.996.917,18	4.110,9975100	6,2150%	729	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 188.673.146,82			47.009	

Quadro 19.

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

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:38 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 379259/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzcs5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

4.3 Total dos Recursos – MPE/FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	SALDO	
	31/07/2023	31/08/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 6.605.201,08	R\$ 12.453.950,32
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 48.388.698,91	R\$ 46.633.983,28
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 8.247.795,43	R\$ 8.168.431,87
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 196.075.025,33	R\$ 193.425.729,49
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 9.088,62	R\$ 4.157,76
TOTAL	R\$ 259.325.809,37	R\$ 260.686.252,72

Quadro 20.

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

4.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

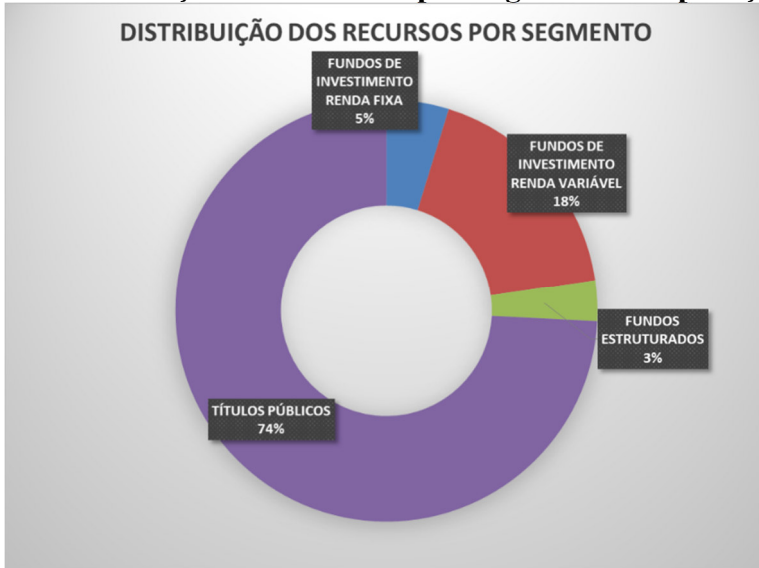


Gráfico 3.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:28 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar> e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

4.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 08/2022		R\$ 214.219.053,32	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2022	R\$ 1.637.208,36	R\$ 42.623,43	R\$ 1.594.584,93
10/2022	R\$ 1.621.262,66	R\$ 46.725,64	R\$ 1.574.537,02
11/2022	R\$ 1.613.014,95	R\$ 45.605,84	R\$ 1.567.409,11
12/2022	R\$ 1.611.566,90	R\$ 89.462,79	R\$ 1.522.104,11
01/2023	R\$ 3.260.425,74	R\$ 136.113,27	R\$ 3.124.312,47
02/2023	R\$ 1.613.129,15	R\$ 145.358,74	R\$ 1.467.770,41
03/2023	R\$ 1.623.976,36	R\$ 160.693,65	R\$ 1.463.282,71
04/2023	R\$ 2.424.596,60	R\$ 178.605,05	R\$ 2.245.991,55
05/2023	R\$ 2.448.819,76	R\$ 170.907,83	R\$ 2.277.911,93
06/2023	R\$ 2.450.779,10	R\$ 152.787,06	R\$ 2.297.992,04
07/2023	R\$ 1.803.152,02	R\$ 144.209,32	R\$ 1.658.942,70
08/2023	R\$ 1.789.593,08	R\$ 190.978,30	R\$ 1.598.614,78
Saldo dos Investimentos em 08/2023		R\$ 260.686.252,72	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,6082 %	3,2312 %	0,2300 %
Juros	5,1200 %	3,3848 %	0,4170 %
Meta	9,9642 %	6,7254 %	0,6479 %
Rentabilidade em %	10,7475 %	8,4524 %	-0,0918 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 24.073.745,64	R\$ 19.636.253,90	R\$ -238.171,43
Resultado em %	+0,7124 %	+1,6182 %	-0,7350 %
Resultado em R\$	R\$ +1.753.333,76	R\$ +4.010.629,78	R\$ -1.918.418,59

Quadro 21.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:55 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun23	jul23	ago23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 1.360.541,53	R\$ 2.831.489,90	-	-	0,6307	0,6307%	0,6307%	NC
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.360.541,53	R\$ 2.831.489,90						
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 3.489.935,13	R\$ 3.415.514,45	1,0400	1,0100	1,1000	3,1832%	6,3621%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 3.489.935,13	R\$ 3.415.514,45						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 4.850.476,66	R\$ 6.247.004,35						
FUNDOS DE AÇÕES	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun23	jul23	ago23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.022.873,31	R\$ 953.400,34	11,3900	6,1100	(6,8700)	10,0759%	17,4597%	16,2452%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 17.503,13	R\$ 16.907,46	9,7742	1,8985	(3,4032)	8,0515%	11,9344%	10,7452%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.533.257,59	R\$ 3.414.899,05	9,5579	5,3187	(3,3498)	11,5198%	22,6806%	19,1109%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 4.573.634,03	R\$ 4.385.206,85						
FUNDO ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun23	jul23	ago23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 4.113.394,34	R\$ 4.073.813,63	6,9200	3,5900	(0,9600)	9,6951%	22,9353%	23,1216%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 4.113.394,34	R\$ 4.073.813,63						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 22.500,70	R\$ -						
TOTAL RECURSOS	R\$ 13.560.005,73	R\$ 14.706.024,83						

Quadro 22.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 201/2023, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 24/07/2023. **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF.

5.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
12/07/2022	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2035	R\$ 9.999.924,61	3.946,4559030	6,2700%	2.534	BTG PACTUAL CTVM
13/12/2022	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2025	R\$ 35.000.000,00	3.970,9698140	6,3925%	8.814	XP INVESTIMENTOS CCTVM
28/02/2023	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2033	R\$ 1.997.413,76	4.043,3477691	6,2500%	494	BTG PACTUAL CTVM
28/03/2023	DEFENSORIA PÚBLICA	15/08/2040	R\$ 3.000.388,13	4.032,7797410	6,1900%	744	BGC LIQUIDEZ
18/05/2023	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2025	R\$ 1.438.242,53	4.121,0387810	6,0530%	349	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	DEFENSORIA PÚBLICA	15/05/2025	R\$ 4.998.972,97	4.110,9975100	6,2150%	1.216	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 56.434.942,00			14.151	

Quadro 23.

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

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:08
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzcs5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

5.3 Total dos Recursos – DPE/FPREV

RECURSOS DPE FPREV	SALDO	
	31/07/2023	31/08/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 4.850.476,66	R\$ 6.247.004,35
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.573.634,03	R\$ 4.385.206,85
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 4.113.394,34	R\$ 4.073.813,63
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 58.626.723,92	R\$ 58.996.799,22
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 22.500,70	R\$ -
TOTAL	R\$ 72.186.729,65	R\$ 73.702.824,05

Quadro 24.

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

5.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

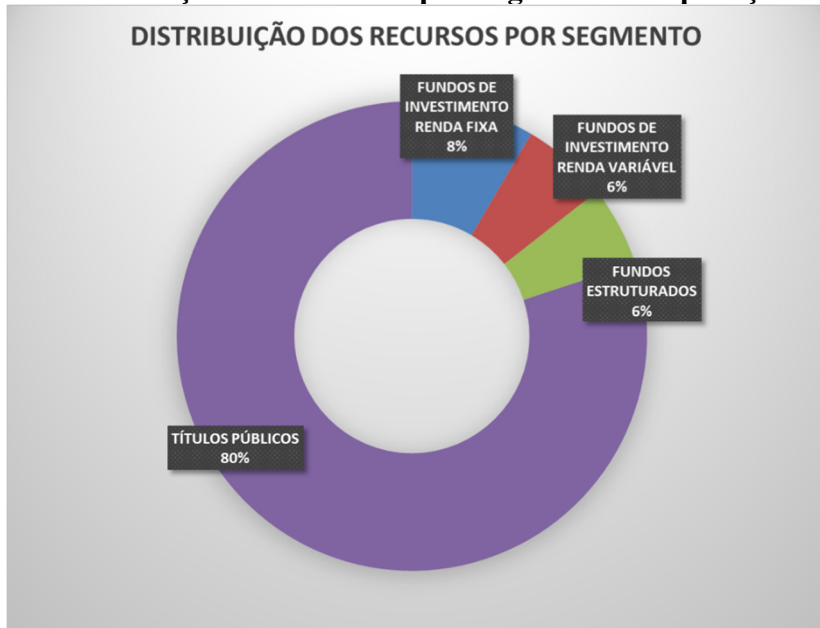


Gráfico 4.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

5.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

Saldo dos Investimentos em 08/2022		R\$ 50.113.398,78	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2022	R\$ 1.297.425,41	R\$ 47.405,73	R\$ 1.250.019,68
10/2022	R\$ 1.312.094,85	R\$ 54.090,17	R\$ 1.258.004,68
11/2022	R\$ 1.325.950,25	R\$ 48.051,04	R\$ 1.277.899,21
12/2022	R\$ 1.340.533,16	R\$ 83.947,48	R\$ 1.256.585,68
01/2023	R\$ 2.652.384,33	R\$ 41.366,60	R\$ 2.611.017,73
02/2023	R\$ 1.363.583,62	R\$ 191.804,69	R\$ 1.171.778,93
03/2023	R\$ 1.361.693,00	R\$ 121.514,16	R\$ 1.240.178,84
04/2023	R\$ 1.353.367,86	R\$ 107.760,38	R\$ 1.245.607,48
05/2023	R\$ 1.366.665,90	R\$ 172.454,63	R\$ 1.194.211,27
06/2023	R\$ 1.360.589,35	R\$ 122.825,00	R\$ 1.237.764,35
07/2023	R\$ 1.361.041,17	R\$ 106.111,80	R\$ 1.254.929,37
08/2023	R\$ 1.355.445,23	R\$ 119.560,47	R\$ 1.235.884,76
Saldo dos Investimentos em 08/2023		R\$ 73.702.824,05	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)	
Item	Em 12 meses	No ano	No mês		
IPCA (IBGE)	4,6082 %	3,2312 %	0,2300 %		
Juros	5,1200 %	3,3848 %	0,4170 %		
Meta	9,9642 %	6,7254 %	0,6479 %		
Rentabilidade em %	12,7730 %	9,2403 %	0,3882 %		
Rentabilidade em R\$	R\$ 7.355.543,29	R\$ 5.744.261,45	R\$ 280.209,64		
Resultado em %	+2,5543 %	+2,3564 %	-0,2581 %		
Resultado em R\$	R\$ +1.614.024,92	R\$ +1.562.021,27	R\$ -187.509,13		

Quadro 25.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MzcsMjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 4.791.246,12	R\$ 4.821.464,32	-	-	0,6307	0,6307%	0,0000%	0,6307%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 4.791.246,12	R\$ 4.821.464,32						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 535.681,12	R\$ 26.243.352,56	1,1300	1,1800	1,2700	3,6228%	6,9423%	11,7480%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 18.480.768,25	R\$ -	1,0400	1,0100	1,1000	3,1832%	5,1945%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 19.016.449,37	R\$ 26.243.352,56						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 23.807.695,49	R\$ 31.064.816,88						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.320.341,58	R\$ 3.094.825,90	11,3900	6,1100	(6,8700)	10,0759%	17,4597%	16,2452%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 11.026.765,14	R\$ 10.651.500,91	9,7742	1,8985	(3,4032)	8,0515%	11,9344%	7,4156%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.156.734,46	R\$ 1.090.047,94	10,1500	2,8500	(5,7700)	6,7525%	1,3318%	-0,3738%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 1.327.054,33	R\$ 1.359.097,62	3,8300	2,5100	2,4100	9,0012%	11,0177%	10,2059%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.613.406,93	R\$ 1.578.967,81	10,1248	5,9069	(2,1346)	14,1402%	29,3843%	27,4823%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 7.697.383,26	R\$ 7.439.533,10	9,5579	5,3187	(3,3498)	11,5198%	23,0318%	19,4519%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 5.124.277,67	R\$ 4.856.691,34	8,7500	3,2800	(5,2200)	6,4541%	5,0984%	-0,6940%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 31.265.963,37	R\$ 30.070.664,62						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 27.201.968,64	R\$ 27.916.685,07	(1,3941)	2,0435	2,6274	3,2646%	9,2203%	11,7131%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 27.201.968,64	R\$ 27.916.685,07						

FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 21.943.509,82	R\$ 21.732.360,70	6,9200	3,5900	(0,9600)	9,6951%	22,9400%	23,1262%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 21.943.509,82	R\$ 21.732.360,70						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 0,03	R\$ 33.609,27						
TOTAL	R\$ 104.219.137,35	R\$ 110.818.136,54						

Quadro 26.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 201/2023, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 24/07/2023. **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 379259/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MzcsMjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

6.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO/ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
11/02/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2023	R\$ 39.974.516,15	3.843,7034760	6,5450%	10.400	BTG PACTUAL CTVM
15/06/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2023	R\$ 199.999.428,21	3.969,1088970	6,7400%	50.389	XP INVESTIMENTOS CCTVM
12/07/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2035	R\$ 47.499.641,91	3.946,4559030	6,2700%	12.036	BTG PACTUAL CTVM
13/12/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R\$ 2.998.480,93	3.970,9698140	6,3925%	755	XP INVESTIMENTOS CCTVM
13/12/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2027	R\$ 40.001.143,66	3.958,6053090	6,3100%	10.105	BGC LIQUIDEZ
15/12/2022	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2024	R\$ 49.998.121,72	4.008,1867660	6,9500%	12.474	XP INVESTIMENTOS CCTVM
28/02/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2040	R\$ 4.998.825,00	3.914,5066550	6,3500%	1.277	BTG PACTUAL CTVM
28/02/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2033	R\$ 13.998.069,71	4.043,3477691	6,2500%	3.462	BTG PACTUAL CTVM
01/03/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2033	R\$ 49.999.547,60	4.018,2871980	6,3460%	12.443	BGC LIQUIDEZ
28/03/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2040	R\$ 9.997.260,98	4.032,7797410	6,1900%	2.479	BGC LIQUIDEZ
29/03/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2035	R\$ 9.996.111,38	4.134,0411010	6,1230%	2.418	BTG PACTUAL CTVM
30/03/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2040	R\$ 9.998.250,14	4.047,8745510	6,1650%	2.470	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/03/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2035	R\$ 9.925.189,69	4.135,4957040	6,1330%	2.400	XP INVESTIMENTOS CCTVM
20/04/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2045	R\$ 9.998.680,70	4.159,1849840	6,1076%	2.404	BGC LIQUIDEZ
24/04/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2045	R\$ 9.995.425,52	4.164,7606320	6,1005%	2.400	BGC LIQUIDEZ
15/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2024	R\$ 19.830.237,06	4.131,2993880	6,9900%	4.800	BRASESCO
15/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2024	R\$ 99.998.388,61	4.127,5596900	7,0700%	24.227	XP INVESTIMENTOS CCTVM
18/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R\$ 9.997.640,08	4.121,0387810	6,0530%	2.426	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R\$ 9.973.279,95	4.110,9975100	6,2150%	2.426	BGC LIQUIDEZ
24/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R\$ 82.317.441,11	4.112,1711020	6,2770%	20.018	BGC LIQUIDEZ
26/06/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2024	R\$ 62.001.520,92	4.156,7123700	7,3820%	14.916	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 793.497.201,03			196.725	

Quadro 27.

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

6.3 Total dos Recursos – TJ/AM-FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	SALDO	
	31/07/2023	31/08/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 23.807.695,49	R\$ 31.064.816,88
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 31.265.963,37	R\$ 30.070.664,62
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 27.201.968,64	R\$ 27.916.685,07
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 21.943.509,82	R\$ 21.732.360,70
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 565.066.171,67	R\$ 561.968.387,65
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 0,03	R\$ 33.609,27
TOTAL	R\$ 669.285.309,02	R\$ 672.786.524,19

Quadro 28.

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

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:38 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzcs5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

6.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

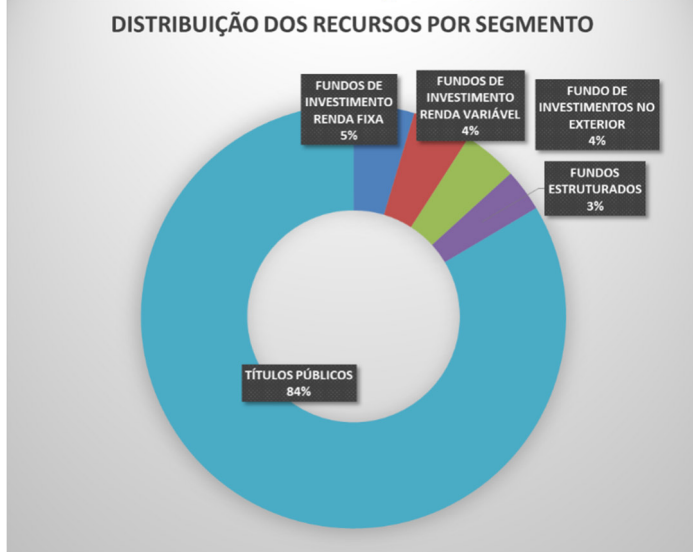


Gráfico 5.

6.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 08/2022		R\$ 562.643.611,74	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2022	R\$ 4.327.276,05	R\$ 353.459,00	R\$ 3.973.817,05
10/2022	R\$ 4.288.452,36	R\$ 351.916,60	R\$ 3.936.535,76
11/2022	R\$ 4.407.617,21	R\$ 355.001,41	R\$ 4.052.615,80
12/2022	R\$ 8.528.187,87	R\$ 425.895,65	R\$ 8.102.292,22
01/2023	R\$ 4.503.689,63	R\$ 316.298,28	R\$ 4.187.391,35
02/2023	R\$ 4.452.062,90	R\$ 386.831,46	R\$ 4.065.231,44
03/2023	R\$ 4.682.824,72	R\$ 954.025,73	R\$ 3.728.798,99
04/2023	R\$ 37.853,98	R\$ 416.120,94	R\$ -378.266,96
05/2023	R\$ 9.514.313,12	R\$ 826.562,19	R\$ 8.687.750,93
06/2023	R\$ 4.768.915,92	R\$ 398.809,96	R\$ 4.370.105,96
07/2023	R\$ 4.785.265,87	R\$ 584.156,10	R\$ 4.201.109,77
08/2023	R\$ 33.609,27	R\$ 678.500,13	R\$ -644.890,86
Saldo dos Investimentos em 08/2023		R\$ 672.786.524,19	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,6082 %	3,2312 %	0,2300 %
Juros	5,1200 %	3,3848 %	0,4170 %
Meta	9,9642 %	6,7254 %	0,6479 %
Rentabilidade em %	10,5435 %	8,4506 %	0,6195 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 61.860.421,00	R\$ 51.278.504,89	R\$ 4.146.106,03
Resultado em %	+0,5268 %	+1,6164 %	-0,0283 %
Resultado em R\$	R\$ +3.396.546,83	R\$ +10.465.412,54	R\$ -190.387,68

Quadro 29.



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.611.281,13	R\$ 3.093.143,11	1,0400	1,0100	1,1000	3,1832%	5,1945%	NC
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ -	R\$ 2.574.561,15	-	-	0,6307	0,6307%	0,6307%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 2.611.281,13	R\$ 5.667.704,26						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.611.281,13	R\$ 5.667.704,26						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 897.030,81	R\$ 836.104,99	11,3900	6,1100	(6,8700)	10,0759%	17,4597%	16,1093%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 11.026.765,14	R\$ 10.651.500,91	9,7742	1,8985	(3,4032)	8,0515%	11,9344%	28,3147%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.782.928,40	R\$ 1.723.203,12	9,5579	5,3187	(3,3498)	11,5198%	23,0363%	18,6272%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 954.925,73	R\$ 905.060,15	8,7500	3,2800	(5,2200)	6,4541%	5,0984%	-0,6940%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 14.661.650,08	R\$ 14.115.869,17						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 520.254,26	R\$ 533.923,65	(1,3941)	2,0435	2,6274	3,2646%	9,2203%	11,7131%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 520.254,26	R\$ 533.923,65						
FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/07/2023	31/08/2023	jun/23	jul/23	ago/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 4.094.087,01	R\$ 4.054.692,10	6,9200	3,5900	(0,9600)	9,6951%	22,9353%	23,1216%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 4.094.087,01	R\$ 4.054.692,10						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.042.213,18	R\$ -						
TOTAL	R\$ 22.929.485,66	R\$ 24.372.189,18						

Quadro 30.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. **201/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 24/07/2023. **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF.

7.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R\$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
12/07/2022	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2035	R\$ 16.999.871,84	3.946,4559030	6,2700%	4.308	BTG PACTUAL CTVM
13/12/2022	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2027	R\$ 10.000.000,00	3.958,6053090	6,3100%	2.526	BGC LIQUIDEZ
15/12/2022	TRIBUNAL DE CONTAS	15/08/2024	R\$ 49.998.121,72	4.008,1867660	6,9500%	12.474	XP INVESTIMENTOS CCTVM
28/02/2023	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2033	R\$ 18.999.690,80	4.043,3477691	6,2500%	4.699	BTG PACTUAL CTVM
06/03/2023	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2035	R\$ 29.999.802,85	3.988,2747740	6,4280%	7.522	BGC LIQUIDEZ
18/05/2023	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2025	R\$ 2.316.023,79	4.121,0387810	6,0530%	562	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	TRIBUNAL DE CONTAS	15/05/2025	R\$ 4.998.972,97	4.110,9975100	6,2150%	1.216	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			R\$ 133.312.483,97			33.307	

Quadro 31.

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



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

7.3 Total dos Recursos – TCE/AM-FPREV

RECURSOS TCE/AM FPREV	SALDO	
	31/07/2023	31/08/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.611.281,13	R\$ 5.667.704,26
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 14.661.650,08	R\$ 14.115.869,17
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 520.254,26	R\$ 533.923,65
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 137.617.959,06	R\$ 137.197.800,38
FUNDO DE INVESTIMENTOS - FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 4.094.087,01	R\$ 4.054.692,10
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.042.213,18	R\$ -
TOTAL	R\$ 160.547.444,72	R\$ 161.569.989,56

Quadro 32.

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

7.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

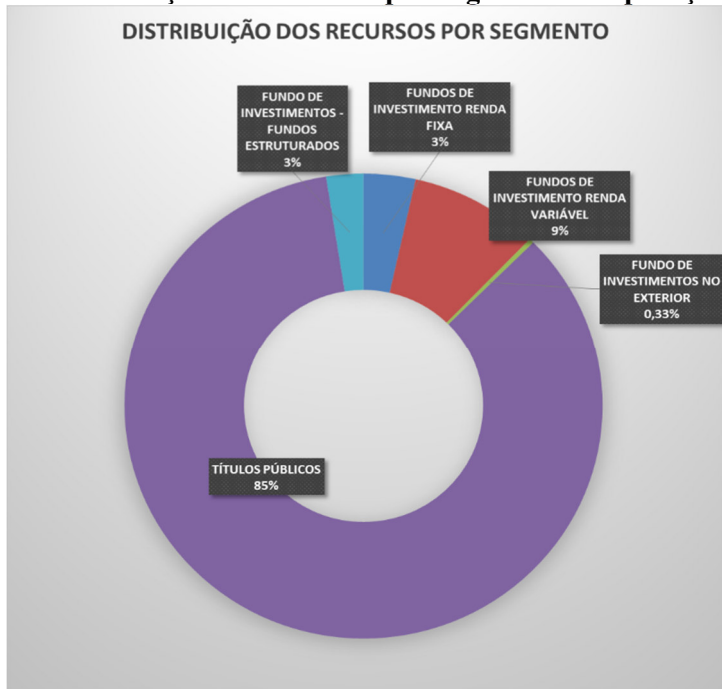


Gráfico 6.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 08/2022		R\$ 134.644.089,36	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2022	R\$ 980.772,84	R\$ 32.298,48	R\$ 948.474,36
10/2022	R\$ 817.771,29	R\$ 32.298,48	R\$ 785.472,81
11/2022	R\$ 957.070,80	R\$ 38.906,51	R\$ 918.164,29
12/2022	R\$ 1.730.199,65	R\$ 39.809,66	R\$ 1.690.389,99
01/2023	R\$ 818.311,18	R\$ 24.852,01	R\$ 793.459,17
02/2023	R\$ 840.406,80	R\$ 57.209,33	R\$ 783.197,47
03/2023	R\$ 868.020,15	R\$ 119.035,88	R\$ 748.984,27
04/2023	R\$ 884.821,56	R\$ 81.955,68	R\$ 802.865,88
05/2023	R\$ 893.485,01	R\$ 93.218,22	R\$ 800.266,79
06/2023	R\$ 906.009,82	R\$ 92.481,20	R\$ 813.528,62
07/2023	R\$ 1.039.877,59	R\$ 83.329,25	R\$ 956.548,34
08/2023	R\$ 542.924,76	R\$ 85.771,35	R\$ 457.153,41
Saldo dos Investimentos em 08/2023		R\$ 161.569.989,56	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)	
Item	Em 12 meses	No ano	No mês		
IPCA (IBGE)	4,6082 %	3,2312 %	0,2300 %		
Juros	5,1200 %	3,3848 %	0,4170 %		
Meta	9,9642 %	6,7254 %	0,6479 %		
Rentabilidade em %	11,7563 %	8,3382 %	0,3522 %		
Rentabilidade em R\$	R\$ 16.427.394,80	R\$ 12.171.619,43	R\$ 565.391,43		
Resultado em %	+1,6298 %	+1,5111 %	-0,2939 %		
Resultado em R\$	R\$ +2.502.791,72	R\$ +2.353.687,47	R\$ -474.842,05		

Quadro 33.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:08
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 08/2022		R\$ 6.461.067.633,72	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
09/2022	R\$ 56.937.314,05	R\$ 11.257.556,08	R\$ 45.679.757,97
10/2022	R\$ 56.154.596,15	R\$ 11.305.467,55	R\$ 44.849.128,60
11/2022	R\$ 55.977.403,03	R\$ 12.023.201,52	R\$ 43.954.201,51
12/2022	R\$ 124.106.593,11	R\$ 17.179.517,14	R\$ 106.927.075,97
01/2023	R\$ 45.327.600,28	R\$ 13.697.160,01	R\$ 31.630.440,27
02/2023	R\$ 56.872.067,81	R\$ 20.127.536,33	R\$ 36.744.531,48
03/2023	R\$ 56.586.892,72	R\$ 14.866.722,41	R\$ 41.720.170,31
04/2023	R\$ 53.436.002,70	R\$ 13.694.121,29	R\$ 39.741.881,41
05/2023	R\$ 63.975.354,09	R\$ 19.217.972,94	R\$ 44.757.381,15
06/2023	R\$ 58.204.827,71	R\$ 15.438.464,68	R\$ 42.766.363,03
07/2023	R\$ 64.141.055,50	R\$ 14.109.293,00	R\$ 50.031.762,50
08/2023	R\$ 55.130.943,32	R\$ 15.200.791,24	R\$ 39.930.152,08
Saldo dos Investimentos em 08/2023		R\$ 7.542.550.231,61	

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %		Índice de Inflação	IPCA (IBGE)
Item	Em 12 meses	No ano	No mês	
IPCA (IBGE)	4,6082 %	3,2312 %	0,2300 %	
Juros	5,1200 %	3,3848 %	0,4170 %	
Meta	9,9642 %	6,7254 %	0,6479 %	
Rentabilidade em %	7,6177 %	5,7029 %	-0,4102 %	
Rentabilidade em R\$	R\$ 512.749.751,61	R\$ 396.473.318,43	R\$ -30.899.014,94	
Resultado em %	-2,1338 %	-0,9581 %	-1,0513 %	
Resultado em R\$	R\$ -157.833.733,44	R\$ -71.071.973,32	R\$ -79.710.870,98	

Quadro 34.

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

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:08
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

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

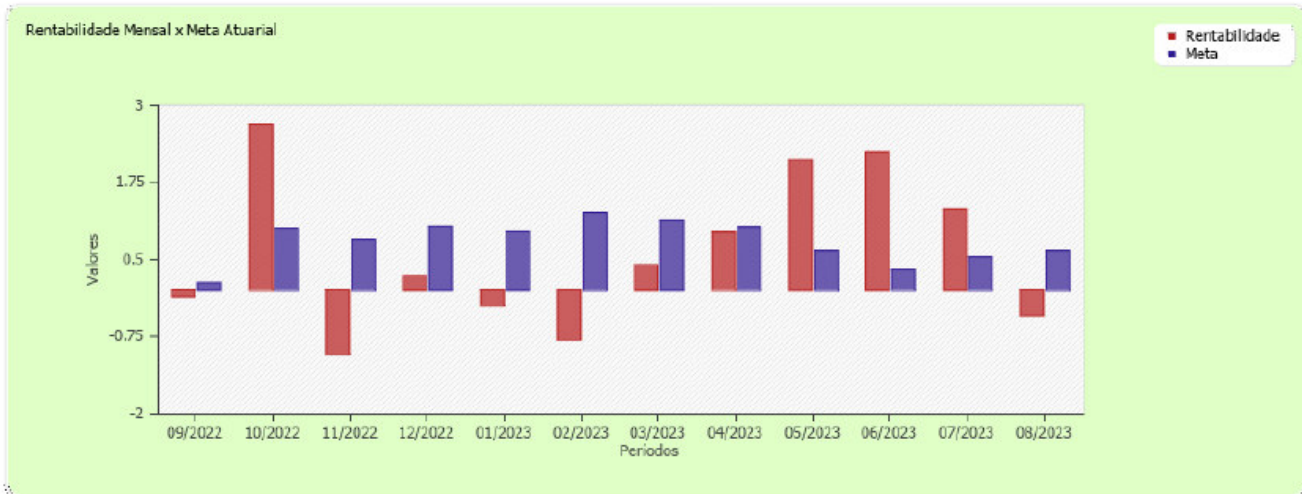


Gráfico 7.

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

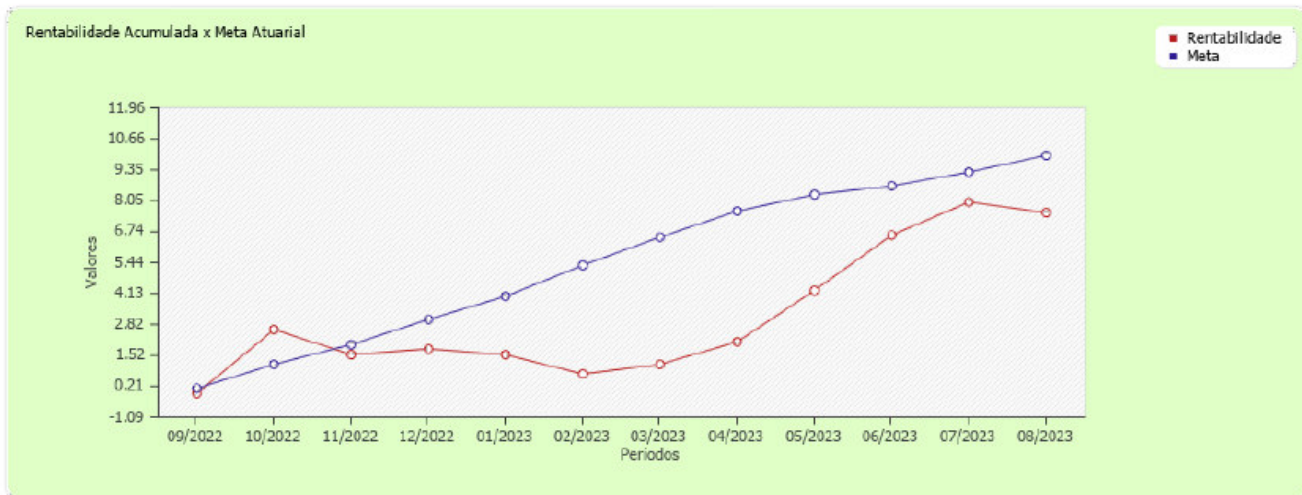


Gráfico 8.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/07/2023	31/08/2023
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.134.446,21	R\$ 1.044.211,10
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 33.030.638,48	R\$ 51.699.572,39
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 5.155,96	R\$ 5.155,96
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 3.045.949,52	R\$ 2.895.027,43
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 237.972,51	R\$ 237.972,51
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ -	R\$ 1.123,39
TOTAL	R\$ 37.454.162,68	R\$ 55.883.062,78

Quadro 35.

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

9.2 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/07/2023	31/08/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 5.423.803,38	R\$ 5.533.179,43
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ -	R\$ 3.786,19
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.420,53	R\$ 24.389,18
TOTAL	R\$ 5.448.223,91	R\$ 5.561.354,80

Quadro 36.

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

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/07/2023	31/08/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ -

Quadro 37.



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/07/2023	31/08/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 2.075,62	R\$ 2.075,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.718,82	R\$ 3.076,75
TOTAL	R\$ 5.794,44	R\$ 5.152,37

Quadro 39.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/07/2023	31/08/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.141.772,31	R\$ 111.248,22
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 1.141.772,31	R\$ 111.248,22

Quadro 40.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/07/2023	31/08/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 5.964.030,36	R\$ 2.160,99
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 702.137,41	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1.050,60
TOTAL	R\$ 6.666.167,77	R\$ 3.211,59

Quadro 41.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/07/2023	31/08/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 1.152.163,86
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 1.575.725,05	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.618.734,80	R\$ -
TOTAL	R\$ 3.194.459,85	R\$ 1.152.163,86
TOTAL GERAL FFIN	R\$ 53.910.580,96	R\$ 62.716.193,62

Quadro 42

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:55 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: MzcsMjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Evolução do Saldo de Taxa de Administração

DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	30/06/2023	31/07/2023	31/08/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.143,62	R\$ 149.696,87	R\$ 741.212,88	R\$ 850.207,07
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 40.560.407,77	R\$ 21.411.710,00	R\$ 19.004.623,91	R\$ 19.239.753,29
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 108.159,48	R\$ 1.159.696,10	R\$ -
TOTAL PODER EXECUTIVO	R\$ 40.561.552,39	R\$ 21.669.566,35	R\$ 20.905.532,89	R\$ 20.089.960,36
DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/12/2022	31/07/2023	31/08/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 35.718,27	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL - ALE	R\$ 35.718,27	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/12/2022	31/07/2023	31/08/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 61.970,46	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL - TCE	R\$ 61.971,46	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/12/2022	31/07/2023	31/08/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 605.835,00	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL TJ/AM	R\$ 605.835,00	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/12/2022	31/07/2023	31/08/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 199.434,03	R\$ -	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL PGJ/AM	R\$ 199.434,03	R\$ -	R\$ -	R\$ -
TOTAL GERAL	R\$ 41.464.511,15	R\$ 21.669.566,35	R\$ 20.905.532,89	R\$ 20.089.960,36

Quadro 43.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 379259/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

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 2023		Resolução CMN nº 4.963/21				
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR					
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL	R\$ 3.697.422.550,99	48,97%	34,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"				
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 3.697.422.550,99								
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 390.774.705,71	15,45%	29,00%	100,00%	art. 7º, Inciso I, "b"				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 390.706.815,26								
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 56.231.267,91								
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 125.834.902,91								
SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 85.814.350,80								
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 75.602,71								
ITAÚ SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 51.799.058,33								
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 65.152.433,63								
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.166.389.137,26								
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 181.844.095,64	2,82%	5,00%	70,00%	art. 7º, inciso III, "a"				
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 30.841.254,70								
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 212.685.350,34								
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 65.249.383,50	6,56%	10,00%	10,00%	art 7º, inciso V, "b"				
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 97.155.975,99								
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 98.273.763,17								
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 97.800.940,62								
BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 103.042.726,92								
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 33.441.491,33								
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 494.964.281,53								
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 5.571.461.320,12					73,79%			

Quadro 44.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:08
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzcs5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 66.895.504,45	19,26%	15,00%	44,00%	art. 8º, inciso I
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 75.096.168,64				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 115.304.838,92				
BB SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 51.728.605,22				
BRANCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 108.030.379,88				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 41.199.273,21				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 189.551.254,78				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 35.630.674,03				
DAYCOVAL IBOVESA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.547.209,78				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.059.457,19				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 49.905.253,70				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 73.400.955,09				
OCCAM FIC FIA	R\$ 99.206.298,11				
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 102.848.280,07				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 94.264.578,29				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 42.784.547,56				
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 53.872.423,88				
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 88.141.379,02				
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.441.157,73				
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 43.215.811,74				
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.925.334,80				
TOTAL art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 1.454.049.386,09				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.454.049.386,09	19,26%			

Quadro 45.

11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 28.450.608,72	2,01%	1,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.118.323,80				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 15.553.199,43				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 47.016.197,90				
SCHRÖDER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 26.585.690,73				
TOTAL art 9º, inciso II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 151.724.020,58				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 64.143.013,05	1,68%	1,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 30.275.766,20				
ITAÚ BDR NIVEL I AÇÕES	R\$ 32.125.293,63				
TOTAL art 9º, inciso III - BDR Nivel I	R\$ 126.544.072,88				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 278.268.093,46	3,69%			

Quadro 46.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:08 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 379259/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

11.4 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Fundos Estruturados

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023		Resolução CMN nº 4.963/21
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 38.541.328,07	2,01%	2,00%	10,00%	art. 10º, inciso I, a
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 18.528.958,11				
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.081.169,80				
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 19.346.783,74				
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM	R\$ 10.499.239,27				
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 32.939.464,57				
RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 16.049.073,68				
TOTAL art. 10º, inciso I, "a"	R\$ 151.986.017,24				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.813.196,00	1,26%	2,00%	5,00%	art. 10º, inciso I, b
BTG PACTUAL INV DE IMPACTO CL A FIP MULT	R\$ 22.885.503,63				
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$ 6.890.569,14				
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.595.670,77				
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 22.724.698,78				
TOTAL art. 10º, inciso I, "b"	R\$ 94.909.638,32				
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 246.895.655,56	3,27%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 7.550.674.455,23	100%			

Quadro 47.

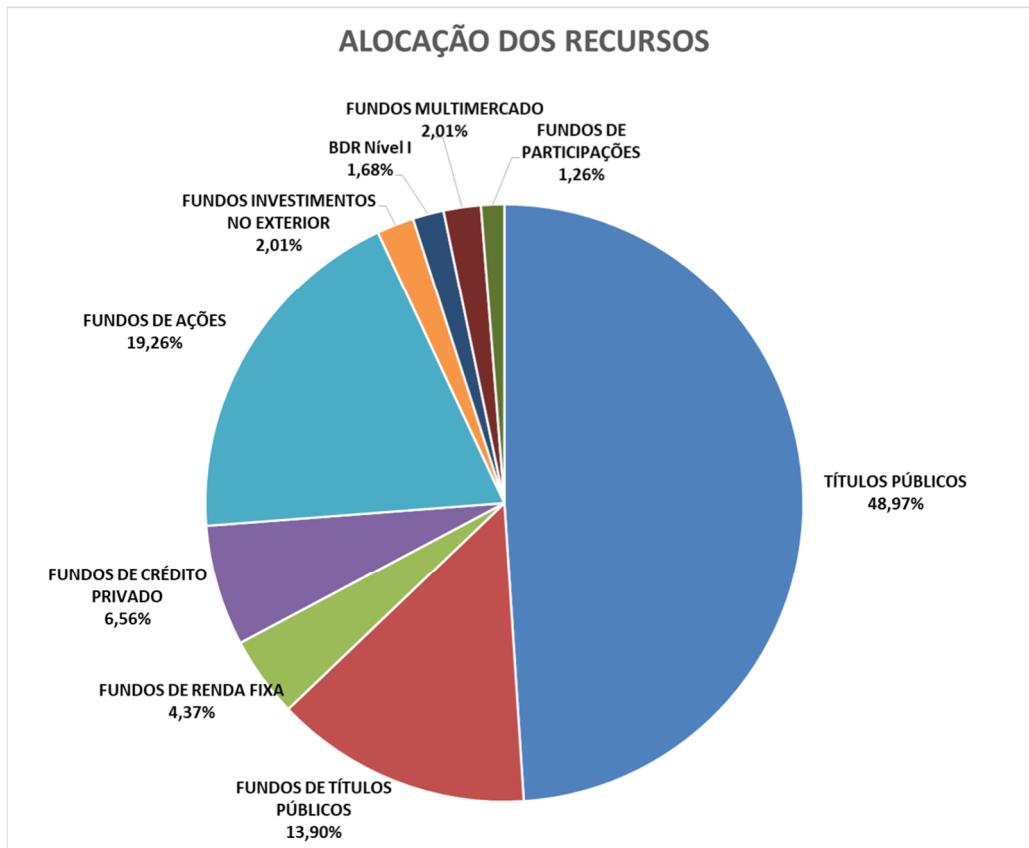


Gráfico 9.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzcs5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

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\$ -	0,00%	100%
	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 56.231.267,91	0,74%	
FI RENDA FIXA	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 65.152.433,63	0,85%	100%
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC - FUNDO NOVO	R\$ 51.799.058,33	0,68%	
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 125.834.902,91	1,65%	
	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ -	0,00%	
	BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ -	0,00%	
	BB PREVID RF PERFIL	R\$ -	0,00%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 390.706.815,26	5,12%	
	ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 75.602,71	0,00%	
	ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP - FUNDO NOVO	R\$ -	0,00%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 85.814.350,80	1,13%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 390.774.705,71	5,12%	
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 30.841.254,70	0,40%	
	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 181.844.095,64	2,38%	
FI RF CREDITO PRIVADO	ICATU VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ -	0,00%	20%
	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 65.249.383,50	0,86%	
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 97.155.975,99	1,27%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 98.273.763,17	1,29%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 97.800.940,62	1,28%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 103.042.726,92	1,35%	
	RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ -	0,00%	
	SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 33.441.491,33	0,44%	
MAG CRED PRIV FI RF LONGO PRAZO	R\$ -	0,00%		
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 66.895.504,45	0,88%	20%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 75.096.168,64	0,98%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 115.304.838,92	1,51%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 51.728.605,22	0,68%	
	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 108.030.379,88	1,42%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 41.199.273,21	0,54%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 189.551.254,78	2,49%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 35.630.674,03	0,47%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.547.209,78	0,24%	
	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.059.457,19	1,10%	
	ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 49.905.253,70	0,65%	
	ITAU SMALL CAP VALUATION	R\$ 73.400.955,09	0,96%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 99.206.298,11	1,30%	
	VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 102.848.280,07	1,35%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 94.264.578,29	1,24%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 42.784.547,56	0,56%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 53.872.423,88	0,71%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 88.141.379,02	1,16%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.441.157,73	0,07%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 43.215.811,74	0,57%	
	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ -	0,00%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.925.334,80	0,20%	
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ -	0,00%		
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIO	R\$ 28.450.608,72	0,37%	20%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.118.323,80	0,45%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 15.553.199,43	0,20%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 47.016.197,90	0,62%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 26.585.690,73	0,35%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 64.143.013,05	0,84%	20%
	ITAU BDR NIVE 1 AÇÕES	R\$ 32.125.293,63	0,42%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 30.275.766,20	0,40%	

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:08
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
 Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 379259/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$	38.541.328,07	0,51%	20%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$	18.528.958,11	0,24%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$	16.081.169,80	0,21%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$	19.346.783,74	0,25%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$	10.499.239,27	0,14%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$	32.939.464,57	0,43%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$	16.049.073,68	0,21%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$	40.813.196,00	0,54%	20%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$	22.724.698,78	0,30%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$	6.890.569,14	0,09%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$	1.595.670,77	0,02%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$	22.885.503,63	0,30%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$	3.853.251.904,24		

Quadro 48.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:28 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	LIMITE RESOL. CMN 4.963/21
FI RF - 100% TPF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 56.231.267,91	R\$ 229.478.681,29	24,50%	100%
	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 65.152.433,63	R\$ 559.442.765,97	11,65%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 390.774.705,71	R\$ 8.195.443.440,71	4,77%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 390.706.815,26	R\$ 6.160.923.946,07	6,34%	
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 125.834.902,91	R\$ 5.643.739.686,42	2,23%	
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 51.799.058,33	R\$ 39.669.959.126,67	0,13%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 85.814.350,80	R\$ 5.478.324.181,39	1,57%	
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 75.602,71	R\$ 2.203.872.085,49	0,00%	
FI RENDA FIXA	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 181.844.095,64	R\$ 9.013.672.474,30	2,02%	15%
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 30.841.254,70	R\$ 14.797.589.893,96	0,21%	
FI RF CREDITO PRIVADO	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 65.249.383,50	R\$ 1.259.839.805,46	5,18%	5%
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 97.155.975,99	R\$ 6.366.908.858,01	1,53%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 98.273.763,17	R\$ 2.608.104.218,67	3,77%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 97.800.940,62	R\$ 3.473.055.743,33	2,82%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 103.042.726,92	R\$ 10.848.275.865,60	0,95%	
	SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R\$ 33.441.491,33	R\$ 2.094.567.917,17	1,60%	
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 66.895.504,45	R\$ 465.488.479,68	14,37%	15%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 75.096.168,64	R\$ 1.275.799.220,44	5,89%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 115.304.838,92	R\$ 880.642.275,17	13,09%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 51.728.605,22	R\$ 1.338.682.696,87	3,86%	
	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 108.030.379,88	R\$ 681.339.924,33	15,86%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 41.199.273,21	R\$ 282.112.215,20	14,60%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 189.551.254,78	R\$ 1.370.470.559,17	13,83%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 35.630.674,03	R\$ 639.741.562,95	5,57%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.547.209,78	R\$ 138.312.189,45	13,41%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.059.457,19	R\$ 646.477.640,57	13,00%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 49.905.253,70	R\$ 1.414.031.639,81	3,53%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 73.400.955,09	R\$ 553.524.912,06	13,26%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 99.206.298,11	R\$ 823.703.571,61	12,04%	
	VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 102.848.280,07	R\$ 679.403.683,67	15,14%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 94.264.578,29	R\$ 1.214.171.436,31	7,76%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 42.784.547,56	R\$ 538.649.866,95	7,94%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 53.872.423,88	R\$ 979.545.284,24	5,50%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 88.141.379,02	R\$ 786.608.043,15	11,21%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.441.157,73	R\$ 110.351.322,63	4,93%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 43.215.811,74	R\$ 1.290.669.768,49	3,35%	
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.925.334,80	R\$ 725.801.620,70	2,06%		
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 28.450.608,72	R\$ 1.215.627.989,81	2,34%	15%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 34.118.323,80	R\$ 112.215.586.951,70	0,03%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 15.553.199,43	R\$ 15.566.014.099,58	0,10%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 47.016.197,90	R\$ 630.406.686,67	7,46%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 26.585.690,73	R\$ 25.467.885.980,62	0,10%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 64.143.013,05	R\$ 1.329.667.917,72	4,82%	15%
	ITAÚ BDR NIVEL I AÇÕES	R\$ 32.125.293,63	R\$ 257.475.669,19	12,48%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 30.275.766,20	R\$ 732.547.750,88	4,13%	

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:55 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 379259/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzcs5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 38.541.328,07	R\$ 583.410.718,64	6,61%	15%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 18.528.958,11	R\$ 528.109.144,51	3,51%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.081.169,80	R\$ 115.828.483,62	13,88%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 19.346.783,74	R\$ 182.063.758,36	10,63%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$ 10.499.239,27	R\$ 164.636.024,67	6,38%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 32.939.464,57	R\$ 226.291.720,75	14,56%	
FIP	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 16.049.073,68	R\$ 135.091.004,95	11,88%	15%
	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.813.196,00	R\$ 3.029.387.061,97	1,35%	
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 22.724.698,78	R\$ 332.412.095,08	6,84%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$ 6.890.569,14	R\$ 120.928.944,37	5,70%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.595.670,77	R\$ 11.498.400,09	13,88%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP		R\$ 22.885.503,63	R\$ 476.514.169,82	4,80%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 3.853.251.904,24			

Quadro 49.

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

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

CONTROLE DE PRAZO DE DESENQUADRAMENTO	DT. DESENQ.	EM 15.09.23	PRAZO (180 DIAS)	MEDIDA TOMADA
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	21/08/2023	26 DIAS	16/02/2024	ANALISE DE EVOLUÇÃO DE COTAS
BRASESCO FI MID SMALL CAPS	19/06/2023	89 DIAS	15/12/2023	ANALISE DE EVOLUÇÃO DE COTAS
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	14/07/2023	33 DIAS	09/01/2024	REDUZIR POSIÇÃO

Quadro 50.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:08 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mzcs5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA JULHO/2023 EM R\$ MI)	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (AGOSTO/2023)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 4.963/21
BB DTVM S.A	R\$ 1.489.683,52	R\$ 650.333.881,17	0,0437%	5%
CAIXA	R\$ 500.470,90	R\$ 674.740.758,80	0,1348%	
ITAU	R\$ 840.986,72	R\$ 304.462.139,45	0,0362%	
SAFRA	R\$ 104.041,01	R\$ 188.072.936,40	0,1808%	
BRASESCO	R\$ 615.214,72	R\$ 355.026.909,15	0,0577%	
ICATÚ	R\$ 43.184,55	R\$ 84.059.457,19	0,1947%	
BTG PACTUAL	R\$ 323.685,73	R\$ 376.943.244,83	0,1165%	
SANTANDER	R\$ 311.865,11	R\$ 112.265.581,40	0,0360%	
VINCI	R\$ 48.802,01	R\$ 147.228.498,40	0,3017%	
OCCAM	R\$ 6.254,06	R\$ 99.206.298,11	1,5863%	
PLURAL INVEST	R\$ 57.169,96	R\$ 49.671.523,23	0,0869%	
AZ QUEST	R\$ 20.064,40	R\$ 75.096.168,64	0,3743%	
BC GESTAO	R\$ 3.562,90	R\$ 41.199.273,21	1,1563%	
ARX	R\$ 25.859,98	R\$ 66.895.504,45	0,2587%	
SCHRODER	R\$ 25.383,15	R\$ 26.585.690,73	0,1047%	
DAYCOVAL	R\$ 13.205,14	R\$ 18.547.209,78	0,1405%	
GUEPARDO	R\$ 3.217,01	R\$ 94.264.578,29	2,9302%	
TRIGONO	R\$ 2.835,28	R\$ 59.313.581,61	2,0920%	
TARPON	R\$ 6.651,32	R\$ 88.141.379,02	1,3252%	
RIO BRAVO	R\$ 9.878,46	R\$ 59.487.777,52	0,6022%	
PORTO SEGURO	R\$ 21.446,08	R\$ 97.800.940,62	0,4560%	
CONSTANCIA	R\$ 1.894,90	R\$ 43.215.811,74	2,2806%	
BNP PARIBAS	R\$ 65.660,20	R\$ 103.042.726,92	0,1569%	
KINEA	R\$ 92.686,68	R\$ 22.724.698,78	0,0245%	
CLARITAS	R\$ 7.503,78	R\$ 14.925.334,80	0,1989%	

Quadro 51.

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

DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

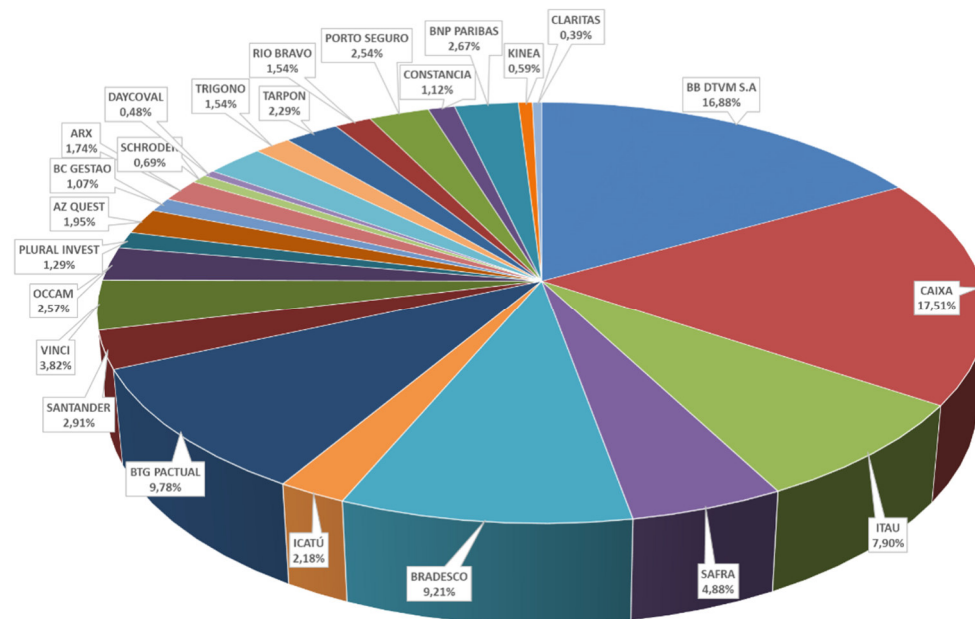


Gráfico 7.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:08 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS Acesso: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.853.251.903,55
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 3.697.422.550,99
TÍTULOS - CVS	R\$ 5.985.727,76
IMÓVEIS	R\$ 65.484.778,63
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 3.211.424,66
TOTAL	R\$ 7.625.356.385,59

Quadro 51.

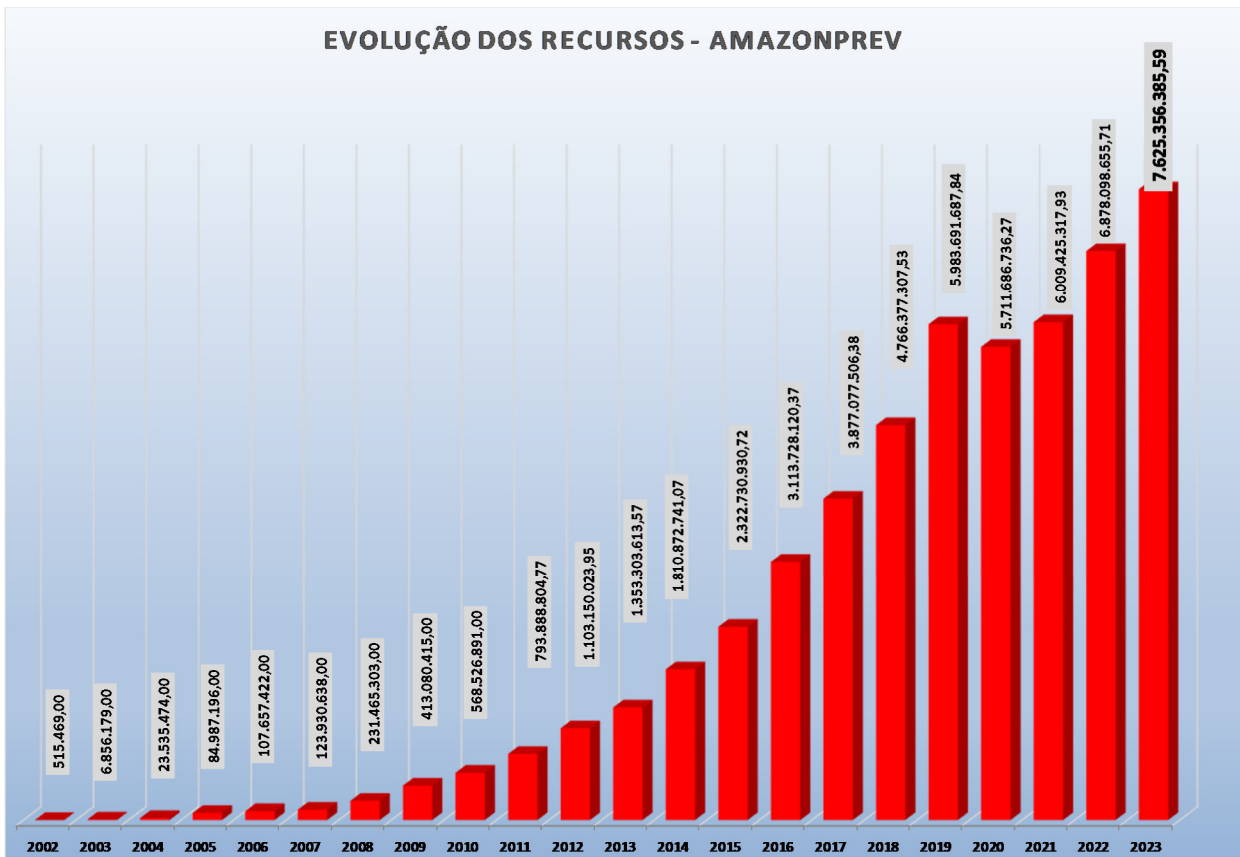


Gráfico 8.

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:28 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV/EXECUTIVO	Novos Recursos Executivo: Aplicar no fundo Itau Alocação Dinâmica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2023
	Fundos com desenquadramento: Realizar acompanhamento, verificando os prazos limites para regularização, sinalizando à Diretoria sobre as providências cabíveis		15/10/2023
FPREV/ASSEMBLEIA	Novos Recursos Executivo: Aplicar no fundo Itau Alocação Dinâmica	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2023
FPREV/TCE, TJA, MPE, DPE	Novos Recursos Executivo: Devem ser aplicados no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF (23.215.097/0001-55)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2023
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.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2023
RECURSOS COMPREV	Novos recursos aplicar no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2023
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/10/2023
REUNIÕES COM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS	19/09 CAIXA ECONÔMICA	COMIV	15/10/2023
	20/09 KINEA		
	21/09 TRIGONO		
	22/09 TARPON		
	03/10 SANTANDER		
04/10 ICATU			
AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS	Mantida a estratégia de Aquisição de Títulos Públicos Federais, conforme registrada na Ata 201/2023, bem como na Política de Investimentos 2023. Devem ser utilizados recursos aplicados em fundos indexados ao CDI, em todos os Poderes do FPREV.	COMIV / DIRAF / PRESI / GERAF / COFIN	15/10/2023
REUNIÃO COFIS/CONAD	Participação nas reuniões dos Conselhos Fiscal e de Administração, conforme definido nos Normativos Internos.	COMIV / DIRAF / PRESI / GERAF / COFIN	15/10/2023
PREENCHIMENTO E ENVIO DE INFORMAÇÕES - CADPREV	Atualização das informações sobre a Carteira do RPPS, via sistema DAIR/CADPREV	COMIV / DIRAF / PRESI / GERAF / COFIN	29/09/2023

Quadro 52.

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: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mz55MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do estado do Amazonas, reunido ordinariamente **no dia 15 de setembro de 2023**, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de **agosto/2023**, 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.

O mês de agosto/2023 teve um desempenho desfavorável para a Carteira, principalmente, pela redução do ritmo de recuperação da economia chinesa, aliada a percepção de que o FED deve levar mais tempo do que o esperado para começar a reduzir a taxa de juros americana, que impactou nos ativos de maior risco de mercado além dos resultados de ativos indexados ao exterior.

Registra-se que a atualização dos Títulos Públicos em carteira passou a ser realizada pela instituição Custodiante XP Investimentos, de forma que a Posição dos ativos adquiridos anteriormente, cujos pagamentos de cupom foram efetuados nesse período, sofreram ajuste conforme orientação da STN.

O Comitê vem acompanhando os registros de Desenquadramento passivo para alguns fundos de Investimentos, conforme registrado no quadro 49, pág. 36 deste Relatório. Trata-se de limite com base no Patrimônio Líquido do fundo de Investimentos, e que nesse caso, é permitido manter em carteira, conforme decisão colegiada, por até 180 (cento e oitenta dias).

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

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50

Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 379259/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: Mzc5MjU5



Relatório de Investimentos – Agosto/2023

Assinado Eletronicamente

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Claudinei Soares
Membro

Leonardo Cavalcanti
Membro

Wellington Guimaraes
Membro

Bruno Barroso
Membro

Marcos Souza
Membro

Assinado Eletronicamente

Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 26/09/2023 10:55:58 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 28/09/2023 08:18:22
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 26/09/2023 10:58:08
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 26/09/2023 12:57:43
Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 26/09/2023 13:32:50
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 27/09/2023 10:30:42

Documento assinado eletronicamente 3792559/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMÁZONAS

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

e valide o código: Mzc5MjU5

