

Relatório de Investimentos – Junho/2023

Processo: **2023.A.05947**
Destino: **DIRAF / PRESI**
Assunto: **Relatório de Investimentos – Junho/2023**
Data: **17/07/2023**

RELATÓRIO Nº. 028/2023-COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **junho/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 38);
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 39);
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 40);
- 14) Parecer do Comitê de Investimentos (página 41).

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:43:06
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1. SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID TP VII	R\$ 8.300.145,60	R\$ 8.387.349,47	0,9000	1,1018	1,0506	3,0835%	6,3672%	13,1154%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 360.457.653,38	R\$ 379.222.007,27	-	0,3888	1,0195	1,4123%	1,4123%	NC	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 360.920.082,51	R\$ 379.799.166,91	-	0,6306	1,0316	1,6687%	1,6687%	NC	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 56.060.851,76	R\$ 56.581.271,87	0,5100	(0,0100)	0,9300	1,4346%	5,5255%	8,3707%	
SAFRA SOBERANO REGIM PROP DI	R\$ 83.026.393,24	R\$ 83.916.350,59	0,8900	1,1100	1,0700	3,1014%	6,4042%	13,4205%	
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 868.765.126,49	R\$ 907.906.146,11							
BRADERCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 23.394.185,04	R\$ 55.745.136,39	0,8500	1,0900		1,9493%	5,0799%	11,7090%	
BRADERCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 344.237,37	R\$ 348.135,70	-	1,1600	1,1300	2,3031%	4,3696%	NC	
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R\$ 11.200.103,54	R\$ 11.325.028,10	0,9181	1,1800	1,1154	3,2479%	6,4228%	13,5517%	
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 50.132.309,54	R\$ 50.674.143,12	0,8900	1,1400	1,0800	3,1422%	6,4779%	13,4655%	
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 85.070.835,49	R\$ 118.092.443,31							
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 62.910.567,19	R\$ 63.611.481,79	0,6296	1,2775	1,1141	3,0506%	4,1571%	11,5374%	
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 93.659.117,83	R\$ 94.779.034,97	0,9200	1,1300	1,2000	3,2851%	6,4984%	14,1289%	
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 92.474.108,58	R\$ 93.730.995,63	0,6800	1,5400	1,3600	3,6208%	4,0643%	11,6748%	
MAG CRED PRIV FI RF LP	R\$ 21.072.015,88	R\$ 21.067.708,83	0,3300	0,7300	(0,0200)	1,0422%	1,0896%	8,3968%	
PORTO SEGURO FI REFER DI CRED PRIV	R\$ 93.763.102,25	R\$ 94.963.577,43	0,8711	1,2800	1,2803	3,4702%	5,5788%	12,9169%	
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REF CP	R\$ 99.595.534,04	R\$ 100.698.680,39	0,9059	1,1523	1,1074	3,1989%	6,5723%	13,8986%	
RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 11.634.539,76	R\$ 11.728.628,69	0,5500	0,8000	0,8100	2,1754%	4,2303%	NC	
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 475.108.985,53	R\$ 480.580.107,73							
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.428.944.947,51	R\$ 1.506.578.697,15							

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. 198/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 10.05.2023, constante do processo nº 2023.A.03295: **Item 3.1. FPREV Executivo: b) Recursos Atuais:** Aplicar os recursos no fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97), respeitando os limites estabelecidos pela legislação vigente.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 63.068.411,29	R\$ 68.525.892,14	0,9200	4,4700	8,6500	14,5509%	2,6914%	10,9193%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 70.736.426,76	R\$ 76.919.827,68	1,7500	4,5600	8,7400	15,6883%	9,3496%	13,4424%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 94.514.240,22	R\$ 102.243.150,63	1,2548	2,7082	8,1775	12,5013%	4,0601%	9,8147%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 48.034.215,22	R\$ 52.338.943,42	1,7443	3,0781	8,9617	14,2748%	5,1672%	12,5249%
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 109.879.851,60	R\$ 116.999.938,91	(0,8000)	9,6500	6,4800	15,8213%	4,2035%	9,7214%
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 40.821.464,22	R\$ 35.161.257,29	4,2000	8,3800	11,3900	25,7949%	18,8620%	29,8838%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 180.129.544,32	R\$ 197.035.350,99	(2,0600)	7,4400	9,3900	15,1075%	6,0176%	16,4508%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT	R\$ 12.736.271,98	R\$ 13.981.142,72	2,8902	6,2007	9,7742	19,9504%	13,7190%	20,9139%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.468.700,64	R\$ 18.979.869,05	0,1098	3,0050	8,6507	12,0385%	3,4186%	16,8624%
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 77.973.637,54	R\$ 84.312.227,89	0,4000	3,1500	8,1300	11,9822%	4,2900%	15,4513%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 48.606.262,00	R\$ 51.165.880,95	1,3300	0,6400	5,2700	7,3528%	-1,5532%	13,3772%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 72.116.797,58	R\$ 76.896.645,76	2,5800	11,3997	6,6300	21,8502%	11,1987%	17,6020%
OCCAM FIC FIA	R\$ 85.286.746,40	R\$ 93.939.981,36	1,1400	0,4400	10,1500	11,8959%	4,5568%	13,8604%
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 94.065.409,78	R\$ 103.779.733,79	1,8900	6,1400	10,3300	19,3175%	11,3308%	16,5892%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 65.659.710,95	R\$ 71.935.418,87	5,9131	10,2843	9,5579	27,9697%	20,8674%	39,2991%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 34.780.880,88	R\$ 37.823.485,48	1,8300	5,0200	8,7500	16,2993%	7,3651%	13,8934%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 42.194.226,70	R\$ 43.811.411,36	(4,2000)	14,3500	3,8300	13,7430%	5,7508%	25,1058%
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 4.905.123,55	R\$ 5.263.133,45	(2,9400)	10,5000	7,3000	15,0806%	10,7345%	30,3245%
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 68.126.929,54	R\$ 75.024.634,45	4,5679	13,2789	10,1248	30,4465%	24,8327%	48,5820%
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 42.529.081,08	R\$ 45.133.204,77	4,5600	17,6400	6,1200	30,5323%	13,4394%	17,2302%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 41.401.227,66	R\$ 44.779.656,17	3,0000	6,0300	8,1600	18,1225%	11,8460%	16,9982%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 13.766.993,20	R\$ 14.910.825,42	0,8700	5,4300	8,3100	15,1847%	5,7023%	14,5824%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 1.328.802.153,11	R\$ 1.430.961.612,55						
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.328.802.153,11	R\$ 1.430.961.612,55						

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 (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.770.917,45	R\$ 32.622.706,17	(2,0486)	(1,4173)	(0,4522)	-3,8736%	-2,4835%	0,5059%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 14.919.084,41	R\$ 15.518.494,98	(6,8984)	12,6836	4,0177	9,1253%	20,8700%	13,6232%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 45.601.214,73	R\$ 45.247.645,10	(0,1362)	1,0327	(0,7754)	0,1129%	1,0170%	7,2405%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 26.456.443,00	R\$ 25.776.558,64	(0,1000)	2,6100	(2,5700)	-0,1270%	2,8535%	10,0332%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exte	R\$ 119.747.659,59	R\$ 119.165.404,89						
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 60.152.059,98	R\$ 61.035.767,83	(0,5473)	3,1285	1,4691	4,0708%	7,6529%	10,3963%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 27.759.349,56	R\$ 27.743.207,23	0,7600	1,7104	(0,0600)	2,4219%	7,4439%	6,5967%
ITAU BDR NIVEL I AÇÕES FIC	R\$ 31.008.267,89	R\$ 30.692.376,07	1,6100	1,6200	(1,0200)	2,2029%	-0,1583%	2,3076%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 118.919.677,43	R\$ 119.471.351,13						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 238.667.337,02	R\$ 238.636.756,02						

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.



Relatório de Investimentos – Junho/2023

2.4 SALDOS E PERFORMANCE – FUNDOS ESTRUTURADOS

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 16.842.006,02	R\$ 18.033.385,29	2,0300	1,2300	7,0700	10,5872%	17,9198%	15,5700%	
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV FIM	R\$ 15.614.004,96	R\$ 16.276.148,26	0,2387	3,0202	4,2407	7,6453%	6,3658%	-6,1318%	
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 18.101.475,24	R\$ 18.962.569,02	1,3968	2,1240	4,7570	8,4764%	11,0100%	NC	
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MM	R\$ 15.554.966,25	R\$ 16.171.493,58	0,7700	1,7900	3,9600	6,6357%	5,5077%	6,1788%	
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 31.718.250,00	R\$ 32.303.631,07	0,6300	1,4000	1,8500	3,9265%	7,3709%	NC	
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MM	R\$ 10.499.779,76	R\$ 10.417.596,41	(0,8000)	0,4000	(0,7800)	-1,1801%	1,2610%	4,7951%	
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 108.330.482,23	R\$ 112.164.823,63							
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 41.070.100,00	R\$ 40.965.176,01	(0,0800)	(0,1004)	(0,2600)	-0,4399%	16,3126%	-2,2521%	
BTG PACTUAL INV DE IMPACTO CL A FIP MULT	R\$ 21.385.142,30	R\$ 21.339.788,71	0,4000	(0,2432)	(0,2100)	-0,0545%	10,9643%	5,5364%	
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA R II FIP MULT	R\$ 5.770.135,37	R\$ 7.167.922,72	-	(1,2100)	(3,3500)	-4,5195%	-4,5195%	NC	
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.401.087,84	R\$ 1.540.390,97	(3,3000)	1,0000	(2,4100)	-4,6868%	8,8177%	25,2800%	
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 23.178.587,78	R\$ 23.057.801,94	(2,2200)	8,4233	(0,5211)	5,4639%	-5,4060%	-10,0171%	
TOTAL art. 10º, inciso II	R\$ 92.805.053,29	R\$ 94.071.080,35							
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 201.135.535,52	R\$ 206.235.903,98							
TOTAL GERAL	R\$ 3.197.549.973,16	R\$ 3.382.412.969,70							
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 30.537.760,40	R\$ 10.887.895,31							
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -							
TOTAL RECURSOS	R\$ 3.228.087.733,56	R\$ 3.393.300.865,01							

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: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

5. DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	abr/23	mai/23	jun/23
BRASESCO	R\$ 107.546.661,27	R\$ 133.618.274,01	R\$ 173.093.211,00
BTG	R\$ 346.805.700,61	R\$ 357.671.036,59	R\$ 378.272.619,35
ITAÚ	R\$ 285.731.409,76	R\$ 295.522.754,84	R\$ 304.208.080,87
BANCO DO BRASIL	R\$ 205.158.808,88	R\$ 571.458.314,40	R\$ 603.227.218,62
CAIXA	R\$ 112.091.111,54	R\$ 474.632.789,99	R\$ 496.925.326,88
ICATU	R\$ 75.593.676,02	R\$ 77.973.637,54	R\$ 84.312.227,89
SANTANDER	R\$ 136.914.433,76	R\$ 108.511.781,92	R\$ 108.859.126,89
PORTO	R\$ 92.577.638,27	R\$ 93.763.102,25	R\$ 94.963.577,43
VINCI	R\$ 123.129.461,97	R\$ 130.247.378,50	R\$ 143.143.610,24
SAFRA	R\$ 109.404.576,70	R\$ 110.785.742,80	R\$ 111.659.557,82
OCCAM	R\$ 84.914.576,29	R\$ 85.286.746,40	R\$ 93.939.981,36
BNP	R\$ 68.786.133,72	R\$ 99.595.534,04	R\$ 100.698.680,39
AZ QUEST	R\$ 67.651.606,22	R\$ 70.736.426,76	R\$ 76.919.827,68
RIO BRAVO	R\$ 68.560.664,74	R\$ 69.407.535,77	R\$ 70.621.349,75
ARX	R\$ 60.369.974,14	R\$ 63.068.411,29	R\$ 68.525.892,14
MONGERAL	R\$ 56.712.123,77	R\$ 21.072.015,88	R\$ 21.067.708,83
TARPON	R\$ 60.140.861,77	R\$ 68.126.929,54	R\$ 75.024.634,45
GUEPARDO	R\$ 59.536.751,37	R\$ 65.659.710,95	R\$ 71.935.418,87
TRÍGONO	R\$ 41.337.770,65	R\$ 47.099.350,25	R\$ 49.074.544,81
PLURAL	R\$ 46.481.830,92	R\$ 47.690.001,86	R\$ 48.141.201,15
4UM	R\$ 40.319.199,41	R\$ 42.529.081,08	R\$ 45.133.204,77
CONSTANCIA	R\$ 39.048.412,73	R\$ 41.401.227,66	R\$ 44.779.656,17
BRASIL CAPITAL	R\$ 37.665.720,97	R\$ 40.821.464,22	R\$ 35.161.257,29
SCHRODER	R\$ 25.783.514,86	R\$ 26.456.443,00	R\$ 25.776.558,64
DAYCOVAL	R\$ 16.959.073,50	R\$ 17.468.700,64	R\$ 18.979.869,05
INTRAG	R\$ 14.795.514,65	R\$ 23.178.587,78	R\$ 23.057.801,94
CLARITAS	R\$ 13.057.834,21	R\$ 13.766.993,20	R\$ 14.910.825,42
TOTAL	R\$ 2.430.984.350,03	R\$ 2.397.075.042,70	R\$ 3.382.412.969,70

Quadro 5.

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC JUNHO/2023

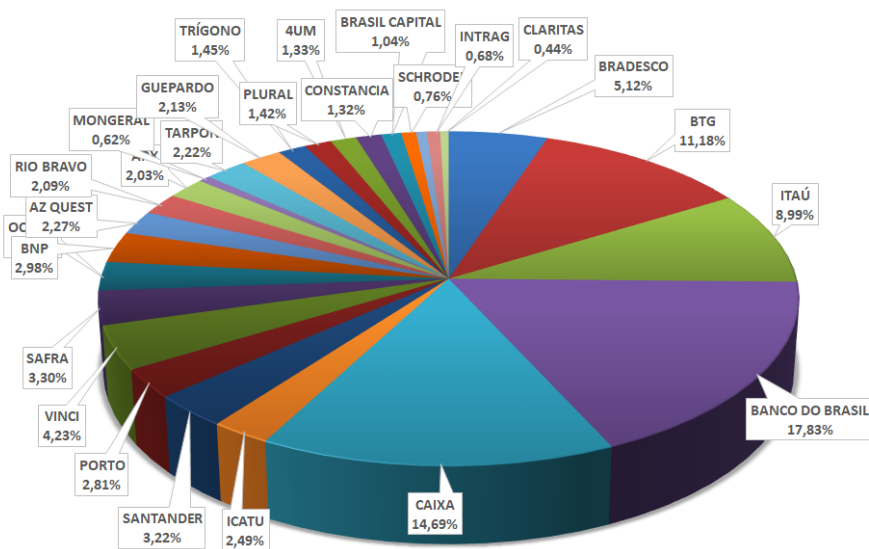


Gráfico 1.

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (RS)	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	15/02/2035	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: Referente as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos.

2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/05/2023	30/06/2023
CVS - A	R\$ 770.120,73	R\$ 753.565,33
CVS - B	R\$ 4.982.458,20	R\$ 4.875.426,60
CVS - C	R\$ 99.901,62	R\$ 97.754,02
CVS - D	R\$ 546.392,88	R\$ 534.655,44
TOTAL	R\$ 6.398.873,43	R\$ 6.261.401,39

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 – Junho/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
TOTAL	R\$ 117.295,68	R\$ 889.730,22	R\$ 1.007.025,90

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\$ 43.635,72	R\$ -	R\$ 43.635,72
TOTAL	R\$ 174.542,88	R\$ 401.457,53	R\$ 576.000,41

Quadro 9.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	31/05/2023	30/06/2023	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.197.549.973,16	R\$ 3.382.412.969,70	54,3643%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.742.823.034,63	R\$ 2.756.711.575,77	44,3076%
TÍTULOS CVS	R\$ 6.398.873,43	R\$ 6.261.401,39	0,1006%
IMÓVEIS	R\$ 65.484.778,63	R\$ 65.484.778,63	1,0525%
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -	0,0000%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 30.537.760,40	R\$ 10.887.895,31	0,1750%
TOTAL	R\$ 6.042.794.420,25	R\$ 6.221.758.620,80	100,00%

Quadro 10.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
mai/22	R\$ 5.288.544.931,25	1,17%	2,91%	6,07%
jun/22	R\$ 5.200.480.011,20	-1,67%	1,20%	3,00%
jul/22	R\$ 5.345.100.326,41	2,78%	4,01%	5,73%
ago/22	R\$ 5.480.240.218,85	2,53%	6,64%	8,98%
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%

Quadro 11.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nz4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 06/2022		R\$ 5.200.480.011,20	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
07/2022	R\$ 47.549.359,29	R\$ 10.900.524,10	R\$ 36.648.835,19
08/2022	R\$ 48.163.488,37	R\$ 12.302.988,95	R\$ 35.860.499,42
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
Saldo dos Investimentos em 06/2023		R\$ 6.221.758.620,81	

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)	3,1615 %	2,8709 %	-0,0800 %
Juros	5,1200 %	2,5280 %	0,4170 %
Meta	8,4434 %	5,4715 %	0,3366 %
Rentabilidade em %	10,3187 %	4,3835 %	2,4016 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 558.906.729,61	R\$ 256.455.437,73	R\$ 145.123.082,35
Resultado em %	+1,7293 %	-1,0315 %	+2,0580 %
Resultado em R\$	R\$ +101.518.843,17	R\$ -63.643.535,00	R\$ +124.780.836,29

Quadro 13.

Nota 1: Os valores de **Receita** referem-se às contribuições previdenciárias recebidas no período. Os valores de **Despesas** referem-se ao pagamento de inativos e pensionistas do Executivo FPREV, registrados sob Regime de Caixa.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:43:06
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/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					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 73.029,10	R\$ 74.653,34	1,2300	2,3500	2,2200	5,9090%	10,2679%	12,9390%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 73.029,10	R\$ 74.653,34						
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R\$ 59.945,42	R\$ 60.587,98	0,8900	1,1100	1,0700	3,1014%	5,2360%	NC
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 240.164,42	R\$ 449.544,93	0,0085	1,0900	1,0400	2,1500%	3,2839%	NC
ITAÚ SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 3.807,54	R\$ 3.848,70	-	1,1400	1,0800	2,2323%	2,2323%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 303.917,38	R\$ 513.981,61						
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 1.076.835,12	R\$ 1.091.471,23	0,6800	1,5400	1,3600	3,6208%	4,0643%	11,6748%
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 1.076.835,12	R\$ 1.091.471,23						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.453.781,60	R\$ 1.680.106,18						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 448.880,26	R\$ 485.370,39	0,4000	3,1500	8,1300	11,9822%	4,2900%	15,4513%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.020.244,23	R\$ 1.115.997,82	(2,0600)	7,4400	9,3900	15,1075%	6,0176%	16,4508%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 508.113,97	R\$ 557.778,13	2,8902	6,2007	9,7742	19,9504%	13,7190%	20,9139%
OCCAM FIC FIA	R\$ 894.662,51	R\$ 985.435,41	1,1400	0,4400	10,1500	11,8959%	4,5568%	13,8604%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 109.057,81	R\$ 121.484,69	4,2000	8,3800	11,3900	25,7949%	18,8620%	29,8838%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 2.980.958,78	R\$ 3.266.066,44						
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 2.980.958,78	R\$ 3.266.066,44						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 990.243,76	R\$ 989.667,92	0,7600	1,7100	(0,0600)	2,4215%	7,4435%	6,5963%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 990.243,76	R\$ 989.667,92						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 990.243,76	R\$ 989.667,92						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 466.761,29	R\$ 499.063,36	1,9700	1,1000	6,9200	10,2256%	19,8252%	27,8328%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 466.761,29	R\$ 499.063,36						
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 466.761,29	R\$ 499.063,36						
TOTAL GERAL	R\$ 5.891.745,43	R\$ 6.434.903,90						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 2.576,88						
VALORES EM TRANSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL DOS RECURSOS	R\$ 5.891.746,43	R\$ 6.437.480,78						

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 a Ata de reunião COMIV nº. **198/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 10.05.2023, constante do processo 2023.A.03295: **Item 3.2 FPREV ALE: a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97), respeitando os limites estabelecidos pela legislação vigente.



Relatório de Investimentos – Junho/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: Referente as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	31/05/2023	30/06/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 1.453.781,60	R\$ 1.680.106,18
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 2.980.958,78	R\$ 3.266.066,44
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 990.243,76	R\$ 989.667,92
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 466.761,29	R\$ 499.063,36
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 16.035.176,86	R\$ 16.115.402,30
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 2.576,88
TOTAL	R\$ 21.926.923,29	R\$ 22.552.883,08

Quadro 16.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

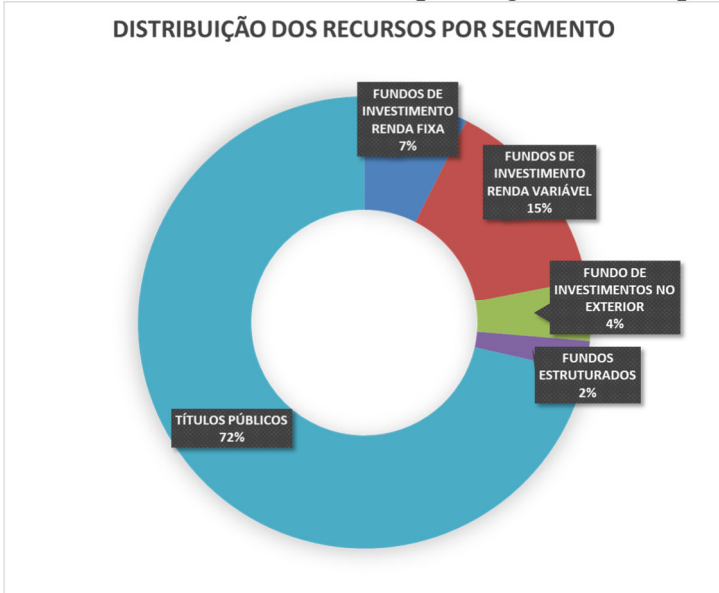


Gráfico 2.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 06/2022		R\$ 18.167.035,92	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
07/2022	R\$ 208.176,70	R\$ 0,00	R\$ 208.176,70
08/2022	R\$ 195.200,20	R\$ 0,00	R\$ 195.200,20
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
Saldo dos Investimentos em 06/2023		R\$ 22.552.883,08	

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)	3,1615 %	2,8709 %	-0,0800 %
Juros	5,1200 %	2,5280 %	0,4170 %
Meta	8,4434 %	5,4715 %	0,3366 %
Rentabilidade em %	9,1191 %	4,4931 %	1,9159 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.764.124,27	R\$ 937.726,14	R\$ 420.105,94
Resultado em %	+0,6231 %	-0,9277 %	+1,5740 %
Resultado em R\$	R\$ +130.609,34	R\$ -204.142,89	R\$ +346.291,93

Quadro 17.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.553.353,43	R\$ 4.884.786,84	-	1,0900	1,0400	2,1413%	2,1413%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 2.553.353,43	R\$ 4.884.786,84						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.553.353,43	R\$ 4.884.786,84						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.286.918,74	R\$ 1.433.560,15	4,2000	8,3800	11,3900	25,7949%	18,8620%	29,8838%
BB AÇÕES VALOR	R\$ 14.485.675,04	R\$ 15.670.242,41	1,2548	2,7082	8,1775	12,5013%	4,0601%	9,8147%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 7.589.159,83	R\$ 8.314.526,26	5,9131	10,2843	9,5579	27,9697%	20,7729%	39,1901%
OCCAM FIC FIA	R\$ 5.722.766,23	R\$ 6.303.400,89	1,1400	0,4400	10,1500	11,8959%	4,5568%	10,8191%
TARPON GT INST FIC FIA	R\$ 7.711.717,28	R\$ 8.492.512,04	4,5679	13,2789	10,1248	30,4465%	24,8327%	48,5820%
TRIGONO FLAGSHIP INST FI FIA	R\$ 5.978.665,82	R\$ 6.207.811,07	(4,2000)	14,3500	3,8300	13,7430%	5,7508%	25,1058%
TOTAL art. 8º, inciso I - RENDA VARIÁVEL	R\$ 42.774.902,94	R\$ 46.422.052,82						
FUNDO DE INVESTIMENTO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 7.446.261,97	R\$ 7.961.578,09	1,9700	1,1000	6,9200	10,2256%	19,8252%	27,8328%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 7.446.261,97	R\$ 7.961.578,09						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 11.553,98						
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL RECURSOS	R\$ 52.774.519,34	R\$ 59.279.971,73						

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 n.º 198/2023**, devidamente aprovada pela Diretoria, através do Despacho de 10.05.2023, constante do processo 2023.A.03295: **Item 3.3 OUTROS PODERES: MPE/DPE/TJA/TCE FPREV. a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97).

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

4.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (RS)	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: Referente as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos.

4.3 Total dos Recursos – MPE/FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	SALDO	
	31/05/2023	30/06/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.553.353,43	R\$ 4.884.786,84
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 42.774.902,94	R\$ 46.422.052,82
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 7.446.261,97	R\$ 7.961.578,09
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 194.131.075,01	R\$ 195.086.551,63
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 11.553,98
TOTAL	R\$ 246.905.594,35	R\$ 254.366.523,36

Quadro 20.

4.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

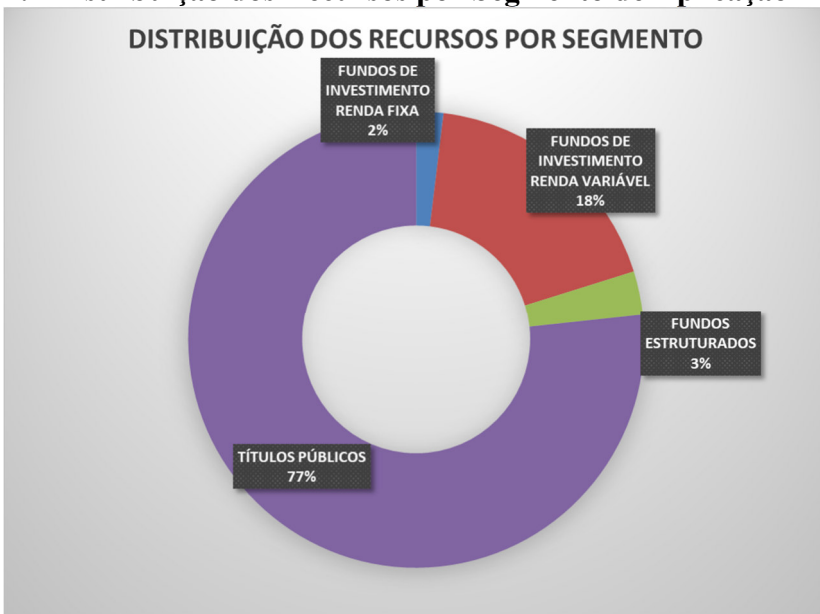


Gráfico 3.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz/M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

4.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 06/2022		R\$ 202.903.619,29	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
07/2022	R\$ 1.640.438,74	R\$ 33.562,04	R\$ 1.606.876,70
08/2022	R\$ 1.630.533,84	R\$ 33.562,04	R\$ 1.596.971,80
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
Saldo dos Investimentos em 06/2023		R\$ 254.366.523,36	

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)	3,1615 %	2,8709 %	-0,0800 %
Juros	5,1200 %	2,5280 %	0,4170 %
Meta	8,4434 %	5,4715 %	0,3366 %
Rentabilidade em %	13,7297 %	7,1971 %	2,0911 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 29.123.159,29	R\$ 16.574.082,02	R\$ 5.162.936,97
Resultado em %	+4,8747 %	+1,6360 %	+1,7485 %
Resultado em R\$	R\$ +11.206.023,86	R\$ +3.972.929,46	R\$ +4.331.762,85

Quadro 21.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/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 (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.304.372,98	R\$ 3.572.396,87	0,8500	1,0900	1,0400	3,0095%	4,1529%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 2.304.372,98	R\$ 3.572.396,87						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.304.372,98	R\$ 3.572.396,87						
FUNDOS DE AÇÕES	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 865.334,65	R\$ 963.937,52	4,2000	8,3800	11,3900	25,7949%	18,8620%	29,8838%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 15.647,59	R\$ 17.177,01	2,8902	6,2007	9,7742	19,9504%	13,7190%	24,6618%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.062.147,88	R\$ 3.354.825,77	5,9131	10,2843	9,5579	27,9697%	20,5223%	30,4321%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 3.943.130,12	R\$ 4.335.940,30						
FUNDO ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.713.648,34	R\$ 3.970.650,16	1,9700	1,1000	6,9200	10,2256%	19,8252%	27,8328%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 3.713.648,34	R\$ 3.970.650,16						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 3.621,70						
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL RECURSOS	R\$ 9.961.151,44	R\$ 11.882.609,03						

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. 198/2023**, devidamente aprovada pela Diretoria, através do Despacho de 10.05.2023, constante do processo 2023.A.03295: **Item 3.3 OUTROS PODERES: MPE/DPE/TJA/TCE FPREV. a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97).

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

5.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (RS)	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: Referente as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos.

5.3 Total dos Recursos – DPE/FPREV

RECURSOS DPE FPREV	SALDO	
	31/05/2023	30/06/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 2.304.372,98	R\$ 3.572.396,87
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 3.943.130,12	R\$ 4.335.940,30
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 3.713.648,34	R\$ 3.970.650,16
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 58.034.773,52	R\$ 58.325.770,64
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 3.621,70
TOTAL	R\$ 67.995.924,96	R\$ 70.208.379,67

Quadro 24.

5.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

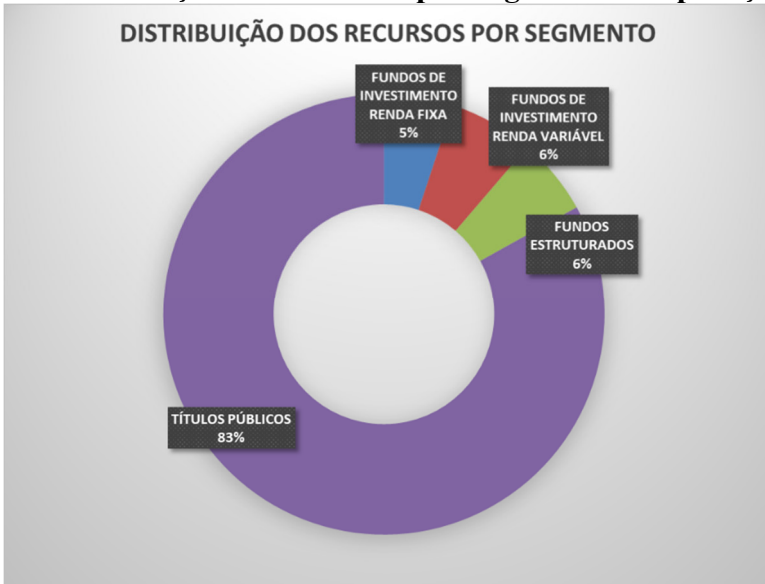


Gráfico 4.



Relatório de Investimentos – Junho/2023

5.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

Saldo dos Investimentos em 06/2022		R\$ 46.352.902,76	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
07/2022	R\$ 1.314.247,49	R\$ 6.039,13	R\$ 1.308.208,36
08/2022	R\$ 1.289.382,39	R\$ 102.141,21	R\$ 1.187.241,18
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
Saldo dos Investimentos em 06/2023		R\$ 70.208.379,67	

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)	3,1615 %	2,8709 %	-0,0800 %		
Juros	5,1200 %	2,5280 %	0,4170 %		
Meta	8,4434 %	5,4715 %	0,3366 %		
Rentabilidade em %	14,2104 %	7,7834 %	1,4335 %		
Rentabilidade em R\$	R\$ 7.616.959,52	R\$ 4.740.631,20	R\$ 974.690,36		
Resultado em %	+5,3180 %	+2,1920 %	+1,0931 %		
Resultado em R\$	R\$ +3.085.081,14	R\$ +1.407.294,42	R\$ +745.791,32		

Quadro 25.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:48:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/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 (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO FI RFI DI PREMIUM	R\$ 61.988.202,22	R\$ 529.416,67	-	1,1600	1,1300	2,3031%	4,3696%	12,7764%
BRANCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 14.366.937,43	R\$ 14.115.915,61	0,8500	1,0900	1,0400	3,0095%	3,0095%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 76.355.139,65	R\$ 14.645.332,28						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 76.355.139,65	R\$ 14.645.332,28						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.808.956,46	R\$ 3.129.030,56	4,2000	8,3800	11,3900	25,7949%	18,8620%	13,4665%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 9.857.795,27	R\$ 10.821.317,48	2,8902	6,2007	9,7742	19,9504%	13,7190%	8,1884%
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.021.033,28	R\$ 1.124.627,82	1,1400	0,4400	10,1500	11,8959%	4,5568%	3,7040%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 1.246.762,74	R\$ 1.294.547,61	(4,2000)	14,3500	3,8300	13,7430%	5,7508%	7,3516%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.383.357,75	R\$ 1.523.419,74	4,5679	13,2789	10,1248	30,4465%	24,8327%	33,1596%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 6.671.046,54	R\$ 7.308.660,35	5,9131	10,2843	9,5579	27,9697%	20,8674%	18,3791%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 4.562.594,43	R\$ 4.961.726,66	1,8300	5,0200	8,7500	16,2993%	7,3651%	3,4608%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 27.551.546,47	R\$ 30.163.330,22						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 27.034.094,20	R\$ 26.657.202,88	(1,2283)	2,1459	(1,3941)	-0,5153%	4,2929%	11,8602%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 27.034.094,20	R\$ 26.657.202,88						

FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 19.811.005,74	R\$ 21.182.019,91	1,9700	1,1038	6,9200	10,2298%	19,8297%	17,9813%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 19.811.005,74	R\$ 21.182.019,91						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 4.768.893,25						
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 150.751.786,06	R\$ 97.416.778,54						

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. 198/2023**, devidamente aprovada pela Diretoria, através do Despacho de 10.05.2023, constante do processo 2023.A.03295: **Item 3.3 OUTROS PODERES: MPE/DPE/TJA/TCE FPREV.** a) Novos Recursos: aplicar no fundo BRANCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97).

Nota 3: Realizadas novas aquisições de Títulos Públicos Federais, NTN B, **no valor total de R\$ 62.001.520,92** (sessenta e dois milhões, um mil, quinhentos e vinte reais e noventa e dois centavos), **em junho/2023**, com recursos disponíveis nos fundos indexados ao CDI, conforme Estratégia aprovada na Política de Investimentos para 2023, bem como, registrado na Ata nº 198/2023.



Relatório de Investimentos – Junho/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	BRDESCO
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: Referente as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos.

6.3 Total dos Recursos – TJ/AM-FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	SALDO	
	31/05/2023	30/06/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 76.355.139,65	R\$ 14.645.332,28
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 27.551.546,47	R\$ 30.163.330,22
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 27.034.094,20	R\$ 26.657.202,88
FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 19.811.005,74	R\$ 21.182.019,91
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 497.430.959,00	R\$ 562.039.661,42
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 4.768.893,25
TOTAL	R\$ 648.182.745,06	R\$ 659.456.439,96

Quadro 28.

6.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação



Gráfico 5.



Relatório de Investimentos – Junho/2023

6.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 06/2022		R\$ 544.444.701,56	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
07/2022	R\$ 4.283.886,16	R\$ 333.045,61	R\$ 3.950.840,55
08/2022	R\$ 4.331.931,11	R\$ 455.010,26	R\$ 3.876.920,85
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
Saldo dos Investimentos em 06/2023		R\$ 659.456.439,96	

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)	3,1615%	2,8709%	-0,0800%	
Juros	5,1200%	2,5280%	0,4170%	
Meta	8,4434%	5,4715%	0,3366%	
Rentabilidade em %	11,0047%	6,8881%	1,0651%	
Rentabilidade em R\$	R\$ 62.457.704,46	R\$ 41.504.639,57	R\$ 6.903.588,94	
Resultado em %	+2,3619%	+1,3431%	+0,7260%	
Resultado em R\$	R\$ +14.528.303,16	R\$ +8.534.379,23	R\$ +4.721.569,83	

Quadro 29.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:43:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/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 (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 957.554,00	R\$ 1.766.798,52	0,8500	1,0900	1,0400	1,9493%	1,9493%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 957.554,00	R\$ 1.766.798,52						
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 957.554,00	R\$ 1.766.798,52						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 758.873,88	R\$ 845.345,80	4,2000	8,3800	11,3900	10,0183%	6,7080%	1,7451%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 9.857.795,27	R\$ 10.821.317,48	2,8902	6,2007	9,7742	6,5074%	3,5935%	-1,4446%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.545.200,22	R\$ 1.692.889,35	5,9131	10,2843	9,5579	15,5942%	10,3268%	14,7770%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 850.254,24	R\$ 924.633,82	1,8300	5,0200	8,7500	3,3058%	-1,2735%	-4,8637%
TOTAL art. 8º, inciso I	R\$ 13.012.123,61	R\$ 14.284.186,45						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 517.043,56	R\$ 509.835,28	(1,2283)	2,1459	(1,3941)	0,5700%	5,7674%	13,4416%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 517.043,56	R\$ 509.835,28						
FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/05/2023	30/06/2023	abr/23	mai/23	jun/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.696.217,34	R\$ 3.952.012,85	1,9700	1,1000	6,9200	7,2050%	12,0700%	10,3413%
TOTAL art. 10º, inciso I	R\$ 3.696.217,34	R\$ 3.952.012,85						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 878.447,14	R\$ 905.061,62						
VALORES EM TRANSITO	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 19.061.385,65	R\$ 21.417.894,72						

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. 198/2023**, devidamente aprovada pela Diretoria, através do Despacho de 10.05.2023, constante do processo 2023.A.03295: **Item 3.3 OUTROS PODERES: MPE/DPE/TJA/TCE FPREV. a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97).

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:43:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

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: Referente as operações de Compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo, quantidade de papéis adquiridos e instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos.

7.3 Total dos Recursos – TJ/AM-FPREV

RECURSOS TCE/AM FPREV	SALDO	
	31/05/2023	30/06/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 957.554,00	R\$ 1.766.798,52
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 13.012.123,61	R\$ 14.284.186,45
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 517.043,56	R\$ 509.835,28
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 136.180.031,08	R\$ 136.887.183,23
FUNDO DE INVESTIMENTOS - FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 3.696.217,34	R\$ 3.952.012,85
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 878.447,14	R\$ 905.061,62
TOTAL	R\$ 155.241.416,73	R\$ 158.305.077,95

Quadro 32.

7.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

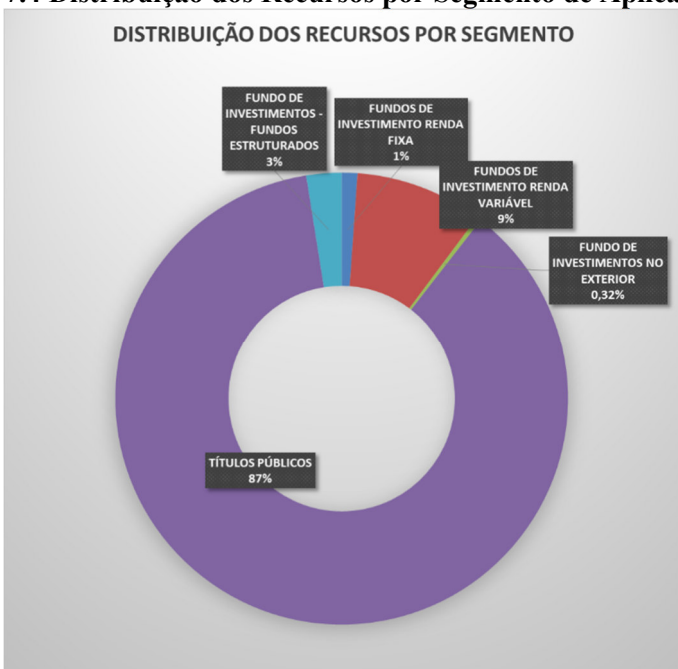


Gráfico 6.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 06/2022		R\$ 129.326.580,06	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
07/2022	R\$ 743.489,44	R\$ 7.489,13	R\$ 736.000,31
08/2022	R\$ 820.598,04	R\$ 106.726,53	R\$ 713.871,51
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
Saldo dos Investimentos em 06/2023		R\$ 158.305.077,95	

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)	3,1615 %	2,8709 %	-0,0800 %
Juros	5,1200 %	2,5280 %	0,4170 %
Meta	8,4434 %	5,4715 %	0,3366 %
Rentabilidade em %	13,7565 %	7,1089 %	1,4494 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 18.443.822,42	R\$ 10.320.409,57	R\$ 2.250.132,60
Resultado em %	+4,8995 %	+1,5525 %	+1,1091 %
Resultado em R\$	R\$ +7.119.823,42	R\$ +2.376.843,87	R\$ +1.727.533,47

Quadro 33.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 06/2022		R\$ 6.141.674.850,79	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
07/2022	R\$ 55.739.597,82	R\$ 11.280.660,01	R\$ 44.458.937,81
08/2022	R\$ 56.431.133,95	R\$ 13.000.428,99	R\$ 43.430.704,96
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
Saldo dos Investimentos em 06/2023		R\$ 7.386.647.924,83	

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)	3,1615 %	2,8709 %	-0,0800 %
Juros	5,1200 %	2,5280 %	0,4170 %
Meta	8,4434 %	5,4715 %	0,3366 %
Rentabilidade em %	10,5934 %	4,7832 %	2,2391 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 678.312.499,57	R\$ 330.532.926,23	R\$ 160.834.537,16
Resultado em %	+1,9826 %	-0,6526 %	+1,8961 %
Resultado em R\$	R\$ +137.588.684,09	R\$ -47.556.230,90	R\$ +136.653.785,69

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: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

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

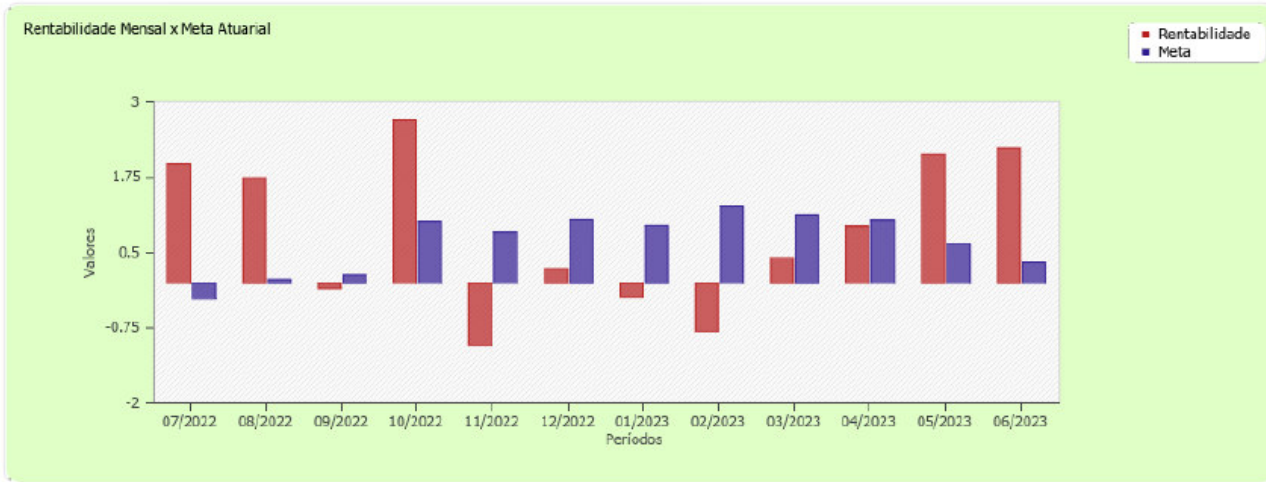


Gráfico 7.

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

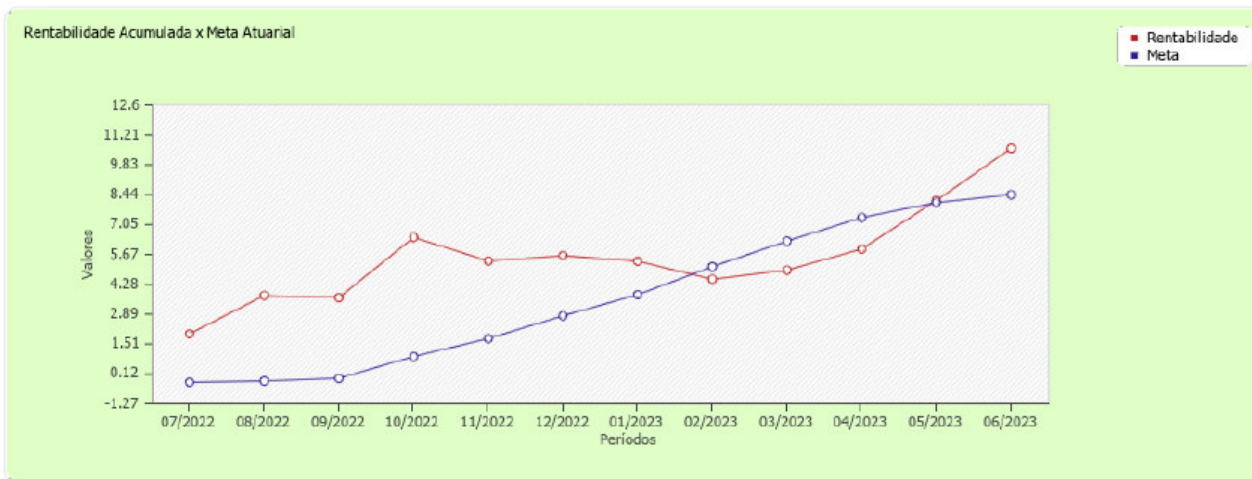


Gráfico 8.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MzMNzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/05/2023	30/06/2023
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 943.041,78	R\$ 3.661.978,71
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 13.385.114,65	R\$ 13.987.453,37
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 5.055,96	R\$ 7.389,76
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 190.305,94	R\$ 2.907.928,67
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 220.559,73	R\$ 237.971,91
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.255,94	R\$ 190.186,30
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ 283,05	R\$ 142,14
TOTAL	R\$ 14.745.617,05	R\$ 20.993.050,86

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	
	31/05/2023	30/06/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 5.532.731,99	R\$ 6.187.459,27
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 1,00	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.483,23	R\$ 24.451,88
TOTAL	R\$ 5.557.216,22	R\$ 6.211.911,15

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	
	31/05/2023	30/06/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 265.505,07	R\$ -
TOTAL	R\$ 265.505,07	R\$ -

Quadro 37.



Relatório de Investimentos – Junho/2023

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/05/2023	30/06/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.910,66	R\$ -
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 18.660,42	R\$ 88.454,41
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 239.095,94
TOTAL	R\$ 23.572,08	R\$ 327.550,35

Quadro 39.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/05/2023	30/06/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.522.048,59	R\$ 1.684.610,79
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 886.530,20
TOTAL	R\$ 2.522.049,59	R\$ 2.571.140,99

Quadro 40.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/05/2023	30/06/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 5.768.100,35	R\$ 2.854,77
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ -	R\$ 642.578,70
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 7.214.731,96
TOTAL	R\$ 5.768.100,35	R\$ 7.860.165,43

Quadro 41.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/05/2023	30/06/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.390,91	R\$ 1.378,23
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ -	R\$ 1.415.917,60
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.490.966,75	R\$ 1.553.492,52
TOTAL	R\$ 1.492.357,66	R\$ 2.970.788,35
TOTAL GERAL FFIN	R\$ 30.374.418,02	R\$ 40.934.607,13

Quadro 42



Relatório de Investimentos – Junho/2023

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Evolução do Saldo de Taxa de Administração

DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/12/2022	31/05/2023	30/06/2023
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.143,62	R\$ 961.974,54	R\$ 202.778,03	R\$ 149.696,87
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 40.560.407,77	R\$ 22.023.255,82	R\$ 21.174.862,66	R\$ 21.411.710,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -	R\$ 660,36	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -	R\$ 755.692,01	R\$ 108.159,48
TOTAL PODER EXECUTIVO	R\$ 40.561.552,39	R\$ 22.986.209,34	R\$ 22.133.993,06	R\$ 21.669.566,35
DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/12/2022	28/04/2023	28/04/2023
BRDESCO 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	28/04/2023	28/04/2023
BRDESCO 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	28/04/2023	28/04/2023
BRDESCO 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	28/04/2023	28/04/2023
BRDESCO 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\$ 22.986.209,34	R\$ 22.133.993,06	R\$ 21.669.566,35

Quadro 43.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAPÁ
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/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 TESOUREO NACIONAL	R\$ 3.725.166.144,99	50,71%	34,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 3.725.166.144,99				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 8.387.349,47				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 379.799.166,91				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 379.222.007,27	12,36%	29,00%	100,00%	art. 7º, Inciso I, "b"
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 56.581.271,87				
SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 83.976.938,57				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 74.653,34				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 908.041.387,43				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 99.233.964,37				
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 7.853.599,17	2,59%	5,00%	70,00%	art. 7º, inciso III, "a"
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 50.677.991,82				
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 32.736.738,10				
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	R\$ 190.502.293,46				
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 63.611.481,79				
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 94.779.034,97				
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 94.822.466,86				
MAG CRED PRIV FI RF LONGO PRAZO	R\$ 21.067.708,83	6,56%	10,00%	10,00%	art 7º, inciso V, "b"
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 94.963.577,43				
BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 100.698.680,39				
RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 11.728.628,69				
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	R\$ 481.671.578,96				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 5.305.381.404,84	72,23%			

Quadro 44.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz3M3NzK4



Relatório de Investimentos – Junho/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\$ 68.525.892,14	20,82%	15,00%	44,00%	art. 8º, inciso I
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.919.827,68				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 117.913.393,04				
BB SELEÇÃO FATOR FIC FI	R\$ 52.338.943,42				
BRANCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 116.999.938,91				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 41.654.616,00				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 198.151.348,81				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 36.198.732,82				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.979.869,05				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.797.598,28				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 51.165.880,95				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 76.896.645,76				
OCCAM FIC FIA	R\$ 102.353.445,48				
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 103.779.733,79				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 92.606.320,61				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 43.709.845,96				
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 51.313.770,04				
TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 85.040.566,23				
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 45.133.204,77				
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.263.133,45				
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 44.779.656,17				
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.910.825,42				
TOTAL art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 1.529.433.188,78				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.529.433.188,78	20,82%			

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\$ 27.167.038,16	1,99%	1,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.622.706,16				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 15.518.494,98				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 45.247.645,10				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.776.558,64				
TOTAL art 9º, inciso II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 146.332.443,04				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 61.035.767,83	1,64%	1,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 28.732.875,15				
ITAÚ BDR NIVEL I AÇÕES	R\$ 30.692.376,07				
TOTAL art 9º, inciso III - BDR Nível I	R\$ 120.461.019,05				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 266.793.462,09	3,63%			

Quadro 46.



Relatório de Investimentos – Junho/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\$ 37.565.324,37	2,04%	2,00%	10,00%	art. 10º, inciso I, a
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 18.033.385,29				
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.276.148,26				
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 18.962.569,02				
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM	R\$ 10.417.596,41				
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 32.303.631,07				
RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 16.171.493,58				
TOTAL art. 10º, inciso I, "a"	R\$ 149.730.148,00				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.965.176,01	1,28%	2,00%	5,00%	art. 10º, inciso I, b
BTG PACTUAL INV DE IMPACTO CL A FIP MULT	R\$ 21.339.788,71				
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$ 7.167.922,72				
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.540.390,97				
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 23.057.801,94				
TOTAL art. 10º, inciso I, "b"	R\$ 94.071.080,35				
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	R\$ 243.801.228,35	3,32%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 7.345.409.284,06	100%			

Quadro 47.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/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\$ 8.387.349,47	0,11%	100%
	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 56.581.271,87	0,76%	
FI RENDA FIXA	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 99.233.964,37	1,33%	20%
	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 7.853.599,17	0,11%	
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 32.736.738,10	0,44%	
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC - FUNDO NOVO	R\$ 50.677.991,82	0,68%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 83.976.938,57	1,13%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 379.799.166,91	5,10%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 379.222.007,27	5,09%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 74.653,34	0,00%		
FI RF CREDITO PRIVADO	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 63.611.481,79	0,85%	20%
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 94.779.034,97	1,27%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 94.822.466,86	1,27%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 94.963.577,43	1,27%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 100.698.680,39	1,35%	
	RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 11.728.628,69	0,16%	
	MAG CRED PRIV FI RF LONGO PRAZO	R\$ 21.067.708,83	0,28%	
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 68.525.892,14	0,92%	20%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.919.827,68	1,03%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 117.913.393,04	1,58%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 52.338.943,42	0,70%	
	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 116.999.938,91	1,57%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 41.654.616,00	0,56%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 198.151.348,81	2,66%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 36.198.732,82	0,49%	
	DAYCOVAL IBOVSPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.979.869,05	0,25%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.797.598,28	1,14%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 51.165.880,95	0,69%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 76.896.645,76	1,03%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 102.353.445,48	1,37%	
	VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 103.779.733,79	1,39%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 92.606.320,61	1,24%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 43.709.845,96	0,59%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 51.313.770,04	0,69%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 85.040.566,23	1,14%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.263.133,45	0,07%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 44.779.656,17	0,60%	
	4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ -	0,00%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.910.825,42	0,20%	
	4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 45.133.204,77	0,61%	
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIO	R\$ 27.167.038,16	0,36%	20%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.622.706,16	0,44%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 15.518.494,98	0,21%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 45.247.645,10	0,61%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.776.558,64	0,35%		
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 61.035.767,83	0,82%	20%
	ITAU BDR NIVE I AÇÕES	R\$ 30.692.376,07	0,41%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 28.732.875,15	0,39%	

Documento assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
Documento assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz/M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$	37.565.324,37	0,50%	20%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$	18.033.385,29	0,24%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$	16.276.148,26	0,22%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$	18.962.569,02	0,25%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$	10.417.596,41	0,14%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$	32.303.631,07	0,43%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$	16.171.493,58	0,22%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$	40.965.176,01	0,55%	20%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$	23.057.801,94	0,31%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$	7.167.922,72	0,10%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$	1.540.390,97	0,02%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$	21.339.788,71	0,29%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$	3.620.243.139,07		

Quadro 48.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:48:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MzM3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/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	BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 8.387.349,47	R\$ 12.858.761.791,29	0,07%	100%
	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 56.581.271,87	R\$ 230.907.040,34	24,50%	
FI RENDA FIXA	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 99.233.964,37	R\$ 585.520.683,28	16,95%	15%
	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 7.853.599,17	R\$ 8.773.662.957,45	0,09%	
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R\$ 32.736.738,10	R\$ 15.331.819.820,88	0,21%	
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R\$ 50.677.991,82	R\$ 39.378.624.159,13	0,13%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R\$ 83.976.938,57	R\$ 5.492.803.682,31	1,53%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 379.799.166,91	R\$ 8.254.253.931,25	4,60%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 379.222.007,27	R\$ 6.483.473.627,64	5,85%	
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 74.653,34	R\$ 2.099.537.000,43	0,00%	
FI RF CREDITO PRIVADO	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 63.611.481,79	R\$ 1.274.304.607,19	4,99%	5%
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 94.779.034,97	R\$ 4.674.950.720,48	2,03%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 94.822.466,86	R\$ 2.478.746.928,99	3,83%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R\$ 94.963.577,43	R\$ 3.056.181.443,80	3,11%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R\$ 100.698.680,39	R\$ 9.499.167.371,20	1,06%	
	RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF	R\$ 11.728.628,69	R\$ 235.462.643,86	4,98%	
	MAG CRED PRIV FI RF LONGO PRAZO	R\$ 21.067.708,83	R\$ 441.665.330,61	4,77%	
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 68.525.892,14	R\$ 538.021.738,96	12,74%	15%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.919.827,68	R\$ 1.325.173.539,32	5,80%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 117.913.393,04	R\$ 876.317.823,44	13,46%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 52.338.943,42	R\$ 1.365.623.732,74	3,83%	
	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 116.999.938,91	R\$ 759.747.191,78	15,40%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 41.654.616,00	R\$ 291.233.340,43	14,30%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 198.151.348,81	R\$ 1.451.994.845,07	13,65%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 36.198.732,82	R\$ 611.430.231,25	5,92%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.979.869,05	R\$ 143.339.856,02	13,24%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.797.598,28	R\$ 697.736.662,34	12,15%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 51.165.880,95	R\$ 1.502.509.907,38	3,41%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 76.896.645,76	R\$ 493.394.381,64	15,59%	
	OCCAM FIC FIA	R\$ 102.353.445,48	R\$ 925.420.855,31	11,06%	
	VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 103.779.733,79	R\$ 762.294.187,16	13,61%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 92.606.320,61	R\$ 1.085.597.293,67	8,53%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 43.709.845,96	R\$ 570.091.876,05	7,67%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R\$ 51.313.770,04	R\$ 934.649.493,54	5,49%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R\$ 85.040.566,23	R\$ 776.438.636,95	10,95%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R\$ 5.263.133,45	R\$ 117.611.394,65	4,48%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R\$ 44.779.656,17	R\$ 1.312.877.349,58	3,41%	
4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA	R\$ -	R\$ 318.520.475,19	0,00%		
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R\$ 14.910.825,42	R\$ 668.758.447,90	2,23%		
4UM SMALL CAPS FIA	R\$ 45.133.204,77	R\$ 318.520.475,19	14,17%		
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 27.167.038,16	R\$ 1.150.092.211,82	2,36%	15%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 32.622.706,16	R\$ 107.717.560.554,06	0,03%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 15.518.494,98	R\$ 14.663.568.097,97	0,11%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 45.247.645,10	R\$ 635.463.967,91	7,12%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 25.776.558,64	R\$ 24.471.928.030,24	0,11%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 61.035.767,83	R\$ 1.281.910.332,14	4,76%	15%
	ITAÚ BDR NIVEL I AÇÕES	R\$ 30.692.376,07	R\$ 172.982.982,93	17,74%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 28.732.875,15	R\$ 726.616.425,21	3,95%	



Relatório de Investimentos – Junho/2023

FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 37.565.324,37	R\$ 573.296.511,87	6,55%	15%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 18.033.385,29	R\$ 491.326.352,47	3,67%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R\$ 16.276.148,26	R\$ 117.232.808,80	13,88%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R\$ 18.962.569,02	R\$ 178.448.115,96	10,63%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R\$ 10.417.596,41	R\$ 163.355.810,60	6,38%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R\$ 32.303.631,07	R\$ 221.923.590,47	14,56%	
FIP	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R\$ 16.171.493,58	R\$ 136.121.465,50	11,88%	15%
	BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 40.965.176,01	R\$ 2.946.784.943,23	1,39%	
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R\$ 23.057.801,94	R\$ 332.412.095,08	6,94%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R\$ 7.167.922,72	R\$ 77.006.429,96	9,31%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R\$ 1.540.390,97	R\$ 11.498.400,09	13,40%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP		R\$ 21.339.788,71	R\$ 443.399.486,05	4,81%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R\$ 3.620.243.139,07			

Quadro 49.

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.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/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 MAIO/2023 EM R\$ MI)	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (JUNHO/2023)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 4.963/21
BB DTVM S.A	R\$ 1.459.866,61	R\$ 646.064.499,19	0,0443%	5%
CAIXA	R\$ 491.932,25	R\$ 540.554.626,98	0,1099%	
ITAU	R\$ 821.809,77	R\$ 304.286.582,91	0,0370%	
SAFRA	R\$ 99.803,93	R\$ 150.275.138,09	0,1506%	
BRADESCO	R\$ 592.766,00	R\$ 224.087.502,45	0,0378%	
ICATÚ	R\$ 41.610,37	R\$ 84.797.598,28	0,2038%	
BTG PACTUAL	R\$ 297.766,01	R\$ 380.480.088,40	0,1278%	
SANTANDER	R\$ 311.994,25	R\$ 108.859.126,89	0,0349%	
VINCI	R\$ 49.934,23	R\$ 149.029.970,72	0,2985%	
OCCAM	R\$ 7.076,50	R\$ 102.353.445,48	1,4464%	
PLURAL INVEST	R\$ 56.403,98	R\$ 48.141.201,14	0,0854%	
AZ QUEST	R\$ 20.217,34	R\$ 76.919.827,68	0,3805%	
BC GESTAO	R\$ 3.089,97	R\$ 41.654.616,00	1,3481%	
ARX	R\$ 26.584,72	R\$ 68.525.892,14	0,2578%	
SCHRODER	R\$ 22.921,97	R\$ 25.776.558,64	0,1125%	
MONGERAL	R\$ 9.767,23	R\$ 21.067.708,83	0,2157%	
DAYCOVAL	R\$ 11.941,75	R\$ 18.979.869,05	0,1589%	
GUEPARDO	R\$ 2.690,41	R\$ 92.606.320,61	3,4421%	
4UM	R\$ 1.875,67	R\$ 45.133.204,77	2,4062%	
TRIGONO	R\$ 2.583,13	R\$ 56.576.903,49	2,1902%	
TARPON	R\$ 5.561,46	R\$ 85.040.566,23	1,5291%	
RIO BRAVO	R\$ 9.643,01	R\$ 70.621.349,75	0,7324%	
PORTO SEGURO	R\$ 20.380,81	R\$ 94.963.577,43	0,4659%	
CONSTANCIA	R\$ 1.656,13	R\$ 44.779.656,17	2,7039%	
BNP PARIBAS	R\$ 63.264,05	R\$ 100.698.680,39	0,1592%	
KINEA	R\$ 83.330,84	R\$ 23.057.801,94	0,0277%	
CLARITAS	R\$ 7.389,20	R\$ 14.910.825,42	0,2018%	

Quadro 50.

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



Relatório de Investimentos – Junho/2023

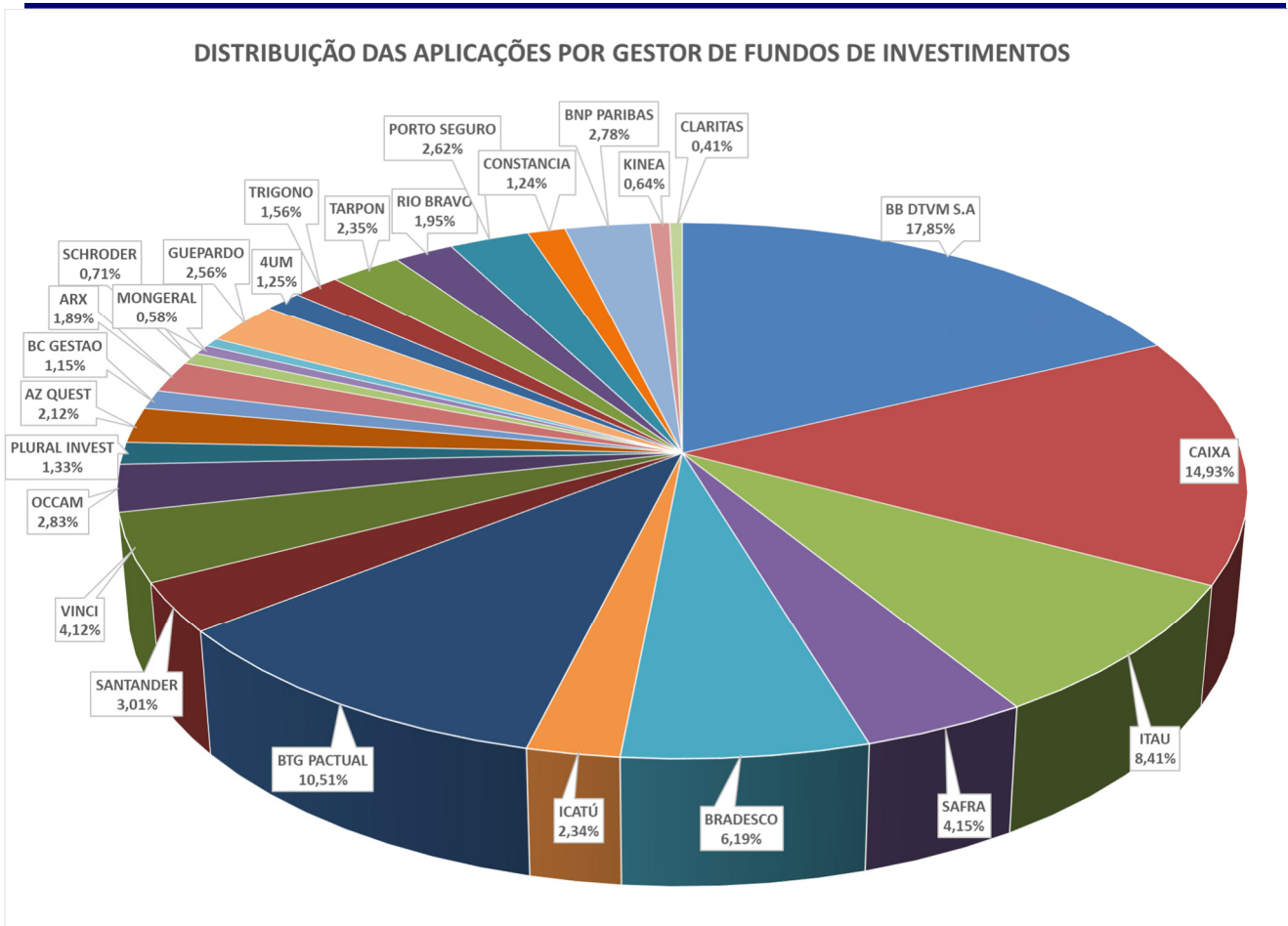


Gráfico 7.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:48:06
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
 Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MzM3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.620.243.139,08
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 3.725.166.144,99
TÍTULOS - CVS	R\$ 6.261.401,39
IMÓVEIS	R\$ 65.484.778,63
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 32.096.634,22
TOTAL	R\$ 7.449.252.098,31

Quadro 51.

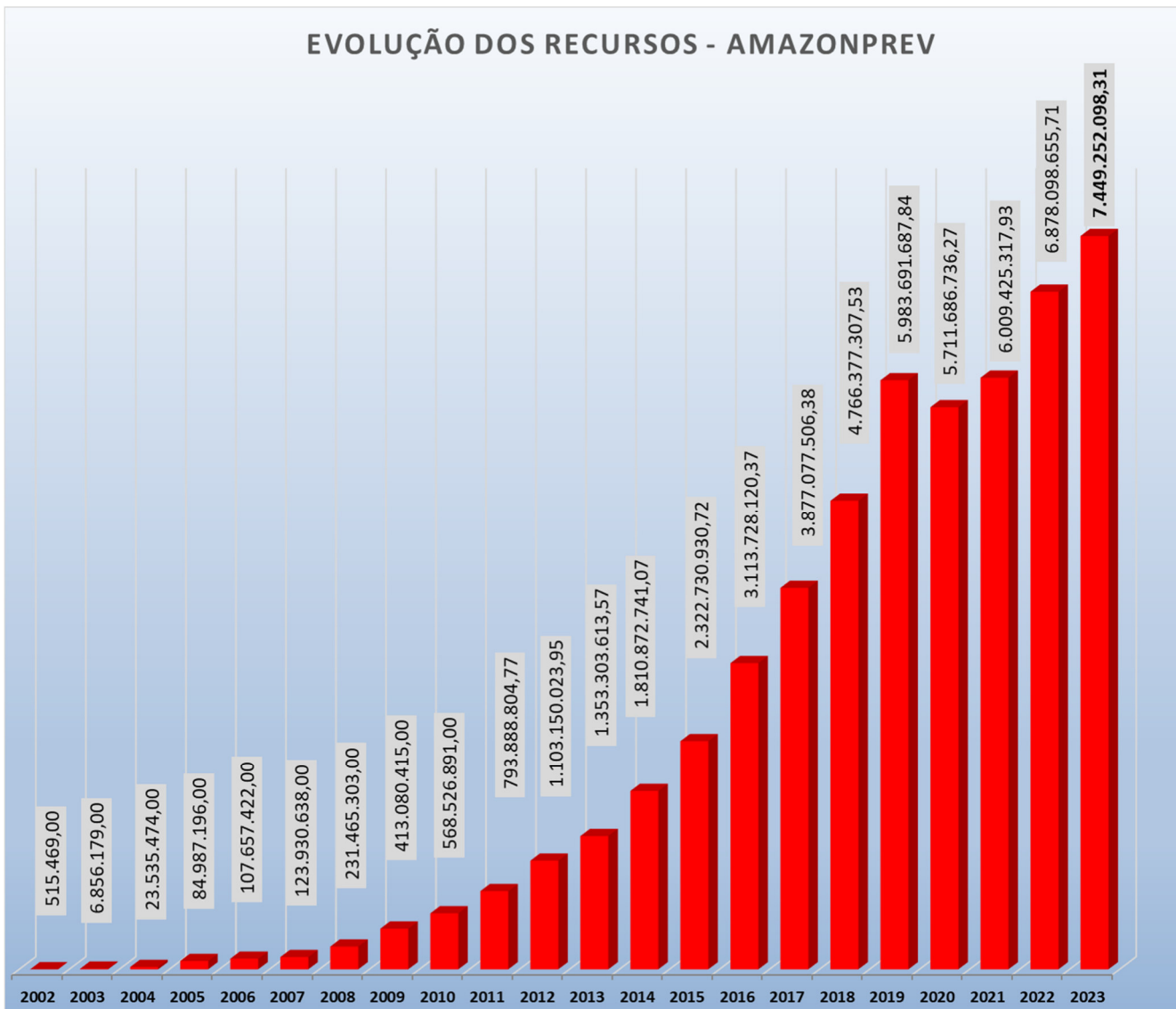


Gráfico 8.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:45:06
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV/EXECUTIVO	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	15/08/2023
FPREV/ASSEMBLEIA	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	15/08/2023
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	15/08/2023
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. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/08/2023
RECURSOS COMPREV	Novos recursos aplicar no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/08/2023
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/08/2023
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	15/08/2023

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: CLAUDINEI SOARES em 19/07/2023 11:21:21
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/07/2023 12:59:27

Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/07/2023 10:36:39
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/07/2023 10:43:06
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 19/07/2023 10:53:54
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/07/2023 10:56:41
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/07/2023 11:04:06

Documento assinado eletronicamente 337798/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: Mz3M3Nzk4



Relatório de Investimentos – Junho/2023

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente **no dia 17 de julho de 2023**, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de **junho/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.

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.

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

Manaus – AM, 17 de julho de 2023.

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Claudinei Soares
Membro

Leonardo Cavalcanti
Membro

Wellington Guimaraes
Membro

Bruno Barroso
Membro

Marcos Souza
Membro

