Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

Processo: **2023.A.10814**
Destino: **DIRAF / PRESI**
Assunto: **Relatório de Investimentos – outubro/2023**
Data: **17/11/2023**

RELATÓRIO Nº. 040/2023-COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **outubro/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 25);

8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (páginas 26 a 27);

9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 28 a 29);

10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 30)**;**

11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 31 a 38);

12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 39);

13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 40);

14) Parecer do Comitê de Investimentos (página 41).

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1. SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID IDKA 2	R$ 391.533.945,79	R$ 390.242.905,80	0,7392	0,2117	(0,3297)	0,6196%	3,0032%	NC
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R$ 391.212.030,81	R$ 389.953.504,19	0,5971	0,1119	(0,3217)	0,3857%	3,0320%	NC
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R$ 42.418.223,76	R$ 91.727.140,00	-	(0,3000)	(0,2100)	-0,5094%	-0,5094%	NC
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R$ 56.847.357,45	R$ 57.094.334,95	0,8900	1,1000	0,4300	2,4384%	9,0200%	9,8900%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R$ 111.819.259,61	R$ 112.106.241,14	0,6307	0,4038	0,2566	1,2963%	2,2009%	NC
SAFRA SOBERANO REGIM PROP DI	R$ 86.580.177,21	R$ 87.429.437,53	1,1300	0,9700	0,9800	3,1116%	10,8561%	13,2187%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R$ 1.602.910,83	R$ 12.530.626,56	1,1000	0,9300	0,9400	2,9994%	10,5164%	12,7601%
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R$ 52.300.117,95	R$ 52.811.066,91	1,1400	0,9700	0,9800	3,1218%	10,9659%	13,3196%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	**R$ 1.134.314.023,41**	**R$ 1.193.895.257,08**						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R$ 111.223.404,33	R$ 84.021.117,34	1,2700	1,0500	1,0500	3,4078%	9,1998%	NC
CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP	R$ 11.720.564,02	R$ 11.839.757,09	1,2372	1,0263	1,0170	3,3163%	11,2068%	13,6530%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	**R$ 122.943.968,35**	**R$ 95.860.874,43**						
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R$ 35.749.468,90	R$ 36.180.169,40	1,6465	1,2112	1,2048	4,1171%	9,4187%	11,9058%
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R$ 98.191.459,42	R$ 99.338.260,76	1,3100	1,0700	1,1700	3,5920%	11,6367%	14,2417%
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R$ 98.439.245,28	R$ 99.603.625,90	1,9800	1,3300	1,1800	4,5557%	10,5787%	13,1478%
PORTO SEGURO FI REFER DI CRED PRIV	R$ 98.902.239,70	R$ 99.957.569,57	1,6117	1,1261	1,0670	3,8524%	11,1310%	13,6042%
BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REF CP	R$ 104.086.843,90	R$ 105.151.195,55	1,1800	1,0133	1,0226	3,2504%	11,2846%	13,7763%
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R$ 64.019.292,92	R$ 64.698.622,77	1,1900	1,0600	1,0600	3,3466%	4,4834%	NC
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	**R$ 499.388.550,12**	**R$ 504.929.443,95**						
TOTAL RENDA FIXA	**R$ 1.756.646.541,88**	**R$ 1.794.685.575,46**						

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. 203/2023**, devidamente aprovada pela Diretoria, através do Despacho de 29/09/2023, constante do processo nº 2023.A.08538: **Item 3.1. FPREV Executivo: a) Recursos Novos:** Aplicar no Itaú Alocação Dinâmica (21.838.150/0001-49). Na análise dos membros do Comitê, a opção por esse ativo está relacionada a estratégia do fundo, que é de gestão ativa em IMA, com maior alinhamento ao Cenário para a taxa de juros em ciclo de queda. Observa-se que tal produto possui correlação com o índice IMA, essa estratégia de gestão traz ótimo desempenho com menor risco. Dessa forma, a carteira da Amazonprev fica mais equilibrada do ponto de vista de fundos indexados à inflação com gestão ativa;

Nota 3: Considerando a impossibilidade de aplicar no fundo consignado em Ata, e para que o recurso não ficasse em conta corrente, o financeiro aplicou no fundo Maxi Poder Público, o valor de R$ 11.655.707,46 (onze milhões, seiscentos e cinquenta e cinco mil, setecentos e sete reais e quarenta e seis centavos), no dia 31/10/2023, sendo a referida operação desfeita nos primeiros dias de novembro/2023.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
TARPON GT INST I FIC FIA	R$ 83.712.757,48	R$ 78.655.361,88	(2,1346)	7,6550	(6,0414)	-1,0080%	30,8737%	11,8794%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 74.324.579,01	R$ 72.017.906,53	(3,3498)	1,5037	(3,1035)	-4,9411%	21,0061%	8,2066%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R$ 100.240.288,79	R$ 96.437.516,21	(5,8143)	0,2590	(3,7936)	-9,1526%	-1,8487%	-7,1508%
FUNDOS RENDA VARIÁVEL - AÇÕES VALOR	**R$ 258.277.625,28**	**R$ 247.110.784,62**						
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R$ 34.409.733,87	R$ 32.169.774,61	(6,8700)	(1,0600)	(6,5100)	-13,8557%	8,6491%	-0,0967%
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R$ 42.782.398,81	R$ 40.781.134,71	(4,8700)	(1,0000)	(4,6800)	-10,2289%	1,8613%	-8,6468%
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R$ 102.817.630,46	R$ 97.219.273,95	(4,6200)	(0,0300)	(5,4400)	-9,8357%	4,2954%	-9,6128%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R$ 36.916.150,07	R$ 35.344.982,72	(5,2200)	(0,2900)	(4,2560)	-9,5170%	0,3336%	-9,6940%
OCCAM FIC FIA	R$ 91.766.557,16	R$ 89.595.477,02	(5,7700)	0,7900	(2,3700)	-7,2765%	-0,2882%	-8,0458%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R$ 49.804.042,99	R$ 47.668.948,98	(4,9500)	(0,2000)	(4,2900)	-9,2096%	-8,2869%	-14,5907%
BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR FIC FI	R$ 51.971.934,92	R$ 50.463.329,61	(4,2990)	0,4703	(2,9027)	-6,6399%	1,3983%	-5,1587%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇOES LIVRE QUANT	R$ 13.745.076,30	R$ 12.956.841,52	(3,4032)	(0,1211)	(5,7347)	-9,0530%	5,3875%	-1,2120%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R$ 14.764.263,00	R$ 14.001.021,48	(4,1600)	(1,0800)	(5,1700)	-10,0965%	-0,7505%	-9,5085%
FUNDOS RENDA VARIÁVEL - AÇÕES LIVRE	**R$ 438.977.787,58**	**R$ 420.200.784,60**						
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R$ 84.067.000,93	R$ 81.630.340,32	(4,0100)	0,5800	(2,9000)	-6,2531%	0,9657%	-3,6354%
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R$ 5.726.706,12	R$ 5.221.211,81	2,2800	5,2500	(8,8300)	-1,8558%	9,8533%	5,6463%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 66.834.251,11	R$ 64.898.021,75	(5,7800)	(0,0900)	(2,9000)	-8,5947%	-2,7461%	-9,8525%
FUNDOS RENDA VARIÁVEL - DIVIDENDOS	**R$ 156.627.958,16**	**R$ 151.749.573,88**						
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R$ 74.303.361,76	R$ 69.618.759,62	(5,7900)	(1,0600)	(6,3000)	-12,6609%	-1,0283%	-11,7902%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R$ 105.359.085,41	R$ 97.284.002,91	(10,2800)	(2,4700)	(7,6600)	-19,1989%	-13,3523%	-24,5925%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R$ 71.770.718,05	R$ 66.252.649,94	(7,1100)	(2,2200)	(7,6900)	-16,1568%	-4,1942%	-15,4262%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R$ 47.384.848,42	R$ 43.781.265,78	2,4100	3,0200	(7,6000)	-2,5154%	5,6783%	1,9371%
FUNDOS RENDA VARIÁVEL - SMALL CAPS	**R$ 298.818.013,64**	**R$ 276.936.678,25**						
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇOES	R$ 18.582.849,61	R$ 18.008.050,77	(4,8859)	0,1922	(3,0900)	-7,6478%	-1,8735%	-8,2546%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R$ 189.659.027,89	R$ 182.337.222,67	(7,1800)	0,6200	(3,8600)	-10,2096%	-1,8934%	-12,5894%
FUNDOS RENDA VARIÁVEL - AÇÕES	**R$ 208.241.877,50**	**R$ 200.345.273,44**						
TOTAL RENDA VARIÁVEL - art. 8º, inciso I	**R$ 1.360.943.262,16**	**R$ 1.296.343.094,79**						

Quadro 2.

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

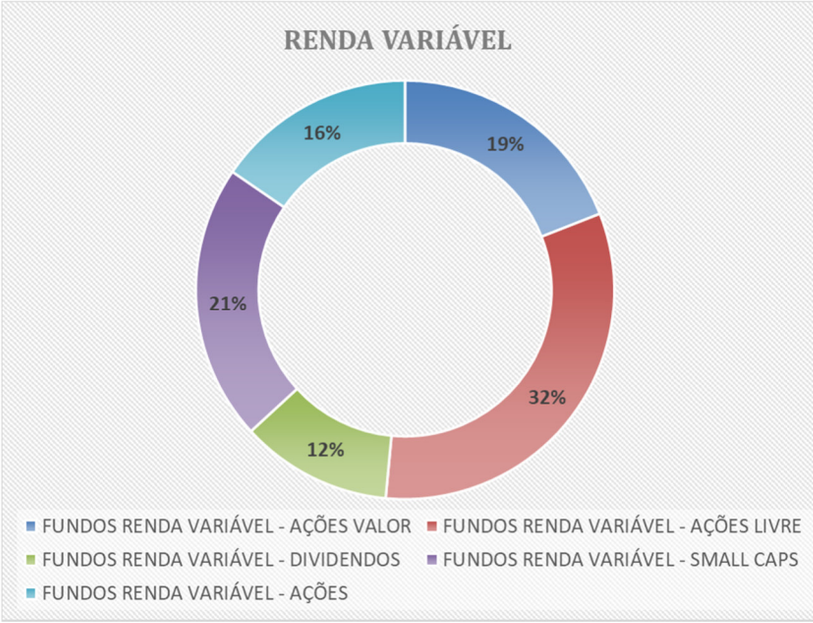

Gráfico 1. Estratégia de Alocação em Fundos de Ações – FPREV Executivo.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R$ 32.942.226,47	R$ 32.065.205,87	4,4251	(3,4471)	(2,6623)	-1,8588%	-4,1500%	2,9445%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R$ 15.081.471,21	R$ 13.605.636,51	(4,4987)	(3,0330)	(9,7857)	-16,4573%	6,5166%	-6,2012%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R$ 45.704.797,02	R$ 44.200.272,98	2,0950	(2,7892)	(3,2918)	-4,0197%	-1,3233%	3,4552%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R$ 25.798.114,17	R$ 24.778.444,02	1,3000	(2,9600)	(3,9500)	-5,5814%	-1,1294%	7,1523%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exte	**R$ 119.526.608,87**	**R$ 114.649.559,38**						
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R$ 62.035.889,79	R$ 61.057.682,53	2,8264	(3,2850)	(1,5768)	-2,1196%	7,7234%	9,1387%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R$ 28.415.764,23	R$ 27.832.347,93	3,7700	(2,8000)	(2,0500)	-1,2033%	7,7964%	9,4932%
ITAU BDR NIVEL I AÇÕES FIC	R$ 31.830.889,70	R$ 31.440.200,52	2,7200	(0,9200)	(1,2300)	0,5231%	2,2710%	2,7490%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	**R$ 122.282.543,72**	**R$ 120.330.230,98**						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	**R$ 241.809.152,59**	**R$ 234.979.790,36**						

Quadro 3.

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

2.4 SALDOS E PERFORMANCE – FUNDOS ESTRUTURADOS

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R$ 17.716.168,69	R$ 17.416.431,83	(0,8900)	(4,3900)	(1,6900)	-6,8424%	13,8939%	15,0648%
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV FIM	R$ 16.112.432,74	R$ 15.898.167,25	(3,2928)	0,1944	(1,3298)	-4,3933%	2,9063%	1,7566%
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R$ 19.475.103,86	R$ 19.139.102,40	(2,2423)	0,6633	(1,7253)	-3,2917%	12,0435%	14,8216%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MM	R$ 16.109.796,23	R$ 15.928.360,81	(2,6900)	0,3800	(1,1300)	-3,4240%	3,9228%	3,0403%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R$ 33.040.384,39	R$ 33.232.616,05	1,0700	0,3100	0,5800	1,9713%	10,4620%	10,8638%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MM	R$ 10.532.520,82	R$ 10.596.391,47	(0,0500)	0,3200	0,6100	0,8815%	3,0117%	1,6666%
TOTAL art. 10º, inciso I	**R$ 112.986.406,73**	**R$ 112.211.069,81**						
BTG ECONOMIA REAL FIP	R$ 40.957.376,01	R$ 40.886.351,99	(0,2000)	0,8600	(0,1700)	0,4872%	16,6805%	16,4356%
BTG PACTUAL INV DE IMPACTO CL A FIP MULT	R$ 22.842.115,97	R$ 22.791.084,44	(1,1800)	(0,1900)	(0,2200)	-1,5847%	8,9765%	6,1269%
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA R II FIP MULT	R$ 6.750.844,28	R$ 6.604.064,57	(2,3900)	(2,0300)	(2,1700)	-6,4466%	-12,0235%	-12,0235%
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R$ 1.613.231,92	R$ 1.534.714,24	0,1900	1,1000	(4,8700)	-3,6408%	8,4209%	22,3574%
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R$ 27.477.002,27	R$ 27.285.165,75	(0,6526)	2,7371	(0,6982)	1,3540%	-4,8895%	-8,2073%
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R$ 21.638.591,05	R$ 21.792.317,51	-	(3,2600)	0,7100	-2,5731%	-2,5731%	NC
TOTAL art. 10º, inciso II	**R$ 121.279.161,50**	**R$ 120.893.698,50**						
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	**R$ 234.265.568,23**	**R$ 233.104.768,31**						
TOTAL GERAL	**R$ 3.593.664.524,86**	**R$ 3.559.113.228,92**						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ -	R$ -						
TOTAL RECURSOS	**R$ 3.593.664.524,86**	**R$ 3.559.113.228,92**						

Quadro 4.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

2.5 CONTROLE DE EVOLUÇÃO DOS FIPS – FUNDO DE INVESTIMENTOS EM PARTICIPAÇÕES

APORTES/FUNDOS	VINCI STRATEGIC PARTNERS I FIP	KINEA PRIVATE EQUITY V FEEDER INSTITUCIONAL I FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	BTG PACTUAL ECONOMIA REAL II FIP	BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA III FEEDER FIP	Pátria PE VII Advisory FIP Multi - Classe C	TOTAL DE RECURSOS
1ª CHAMADA DE CAPITAL	R$ 268.453,31	R$ 2.875.000,00	R$ 5.671.011,85	R$ 5.840.901,39	R$ 9.515.813,90	R$ -	R$ 23.416.702,50	R$ 47.587.882,95
2ª CHAMADA DE CAPITAL	R$ 334.844,05	R$ 9.278.448,35	R$ 2.063.666,86	R$ 1.666.666,72	R$ 1.702.633,54	R$ -	R$ -	R$ 15.046.259,52
3ª CHAMADA DE CAPITAL	R$ 264.358,56	R$ 6.329.310,18	R$ 3.331.898,77	R$ -	R$ 690.979,79	R$ -	R$ -	R$ 10.616.547,30
4ª CHAMADA DE CAPITAL	R$ 87.385,16	R$ 1.013.353,25	R$ 1.325.970,49	R$ -	R$ 6.779.214,99	R$ -	R$ -	R$ 9.205.923,89
5ª CHAMADA DE CAPITAL	R$ 117.214,27	R$ 8.673.587,50	R$ 1.579.015,44	R$ -	R$ 1.635.358,51	R$ -	R$ -	R$ 12.005.175,72
6ª CHAMADA DE CAPITAL	R$ 139.146,78	R$ 4.983.567,55	R$ 6.028.436,59	R$ -	R$ -	R$ -	R$ -	R$ 11.151.150,92
7ª CHAMADA DE CAPITAL	R$ 153.285,87	R$ -	R$ -	R$ -	R$ -	**R$ -**	R$ -	R$ 153.285,87
TOTAL INTEGRALIZADO	**R$ 1.364.688,00**	**R$ 33.153.266,83**	**R$ 20.000.000,00**	**R$ 7.507.568,11**	**R$ 20.324.000,73**	**R$ -**	**R$ 23.416.702,50**	**R$ 105.766.226,17**
TOTAL SUBSCRITO	R$ 25.000.000,00	150.000.000,00	R$ 20.000.000,00	R$ 100.000.000,00	R$ 50.000.000,00	R$ 100.000.000,00	R$ 150.000.000,00	R$ 595.000.000,00
TOTAL BASE OUT/2023	1.534.714,24	27.285.165,75	R$ 40.886.351,99	R$ 6.604.064,57	R$ 22.791.084,44	R$ -	R$ 21.792.317,51	R$ 120.893.698,50
ATA/PARECER-COMIV	182/2021 ; Item 5.2	182/2021 ; Item 5.1	Parecer nº 2251/2020	187/2022 ; Item 6.1	Parecer nº 899/2021	Ata nº 198/2023 e Parecer nº 074/2023	Ata nº 198/2023 e Parecer nº 074/2023	
PROCESSO SISPREV	2022.A.00051	2022.A.00051	2021.A.22978	2022.A.03010	2021.A.21245	2023.A.03295	2023.A.03295	
DESPACHO DIRETORIA	07.01.2022	07.01.2022	04.09.2020	25.05.2022	18.05.2021	10.05.2023	10.05.2023	
PERÍODO INVEST /DESINVEST	4 / 6		3 / 4	4 / 4	3 / 4	5 / 5	6 / 4	
RETORNO PREVISTO	IPCA + 16% a.a.		IPCA + 20 % a.a.	IPCA + 20% a.a.	20% Bruto a.a.	IPCA + 15 % a.a.	35% bruto a.a.	
ADMINISTRADOR	BTG PACTUAL	INTRAG DTVM	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	XP INVEST	
GESTOR	VINCI PARTNERS	KINEA	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	PATRIA INVEST	
TOTAL A INTEGRALIZAR (R$)	**R$ 23.635.312,00**	**R$ 116.846.733,17**	**R$ -**	**R$ 92.492.431,89**	**R$ 29.675.999,27**	**R$ 100.000.000,00**	**R$ 126.583.297,50**	**R$ 489.233.773,83**
TOTAL A INTEGRALIZAR (%)	**94,54%**	**77,90%**	**0,00%**	**92,49%**	**59,35%**	**100,00%**	**84,39%**	**82,22%**

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

Quadro 5.

2.6 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	ago/23	set/23	out/23
BRADESCO	R$ 252.603.415,38	R$ 218.185.400,57	R$ 193.835.746,81
BTG	R$ 374.744.485,16	R$ 376.364.778,12	R$ 369.638.781,40
ITAÚ	R$ 304.382.602,90	R$ 346.315.451,87	R$ 389.238.267,11
BANCO DO BRASIL	R$ 606.559.696,98	R$ 605.782.059,29	R$ 598.201.434,15
CAIXA	R$ 619.166.684,38	R$ 620.931.824,79	R$ 618.987.948,54
ICATU	R$ 83.578.311,82	R$ 84.067.000,93	R$ 81.630.340,32
SANTANDER	R$ 112.265.581,40	R$ 81.454.265,92	R$ 80.380.442,38
PORTO	R$ 97.800.940,62	R$ 98.902.239,70	R$ 99.957.569,57
VINCI	R$ 141.466.746,91	R$ 141.347.012,45	R$ 134.098.970,91
SAFRA	R$ 148.426.883,81	R$ 179.015.234,36	R$ 179.960.408,23
OCCAM	R$ 91.051.529,84	R$ 91.766.557,16	R$ 89.595.477,02
BNP	R$ 103.042.726,92	R$ 104.086.843,90	R$ 105.151.195,55
AZ QUEST	R$ 75.096.168,64	R$ 74.303.361,76	R$ 69.618.759,62
RIO BRAVO	R$ 59.487.777,52	R$ 59.682.701,44	R$ 59.757.368,33
ARX	R$ 66.895.504,45	R$ 66.834.251,11	R$ 64.898.021,75
TARPON	R$ 77.760.238,83	R$ 83.712.757,48	R$ 78.655.361,88
GUEPARDO	R$ 73.223.532,46	R$ 74.324.579,01	R$ 72.017.906,53
TRÍGONO	R$ 51.437.133,50	R$ 53.111.554,54	R$ 49.002.477,59
GENIAL/PLURAL	R$ 49.671.523,23	R$ 48.023.697,68	R$ 45.670.842,38
CONSTANCIA	R$ 43.215.811,74	R$ 42.782.398,81	R$ 40.781.134,71
BRASIL CAPITAL	R$ 34.776.895,93	R$ 34.409.733,87	R$ 32.169.774,61
SCHRODER	R$ 26.585.690,73	R$ 25.798.114,17	R$ 24.778.444,02
DAYCOVAL	R$ 18.547.209,78	R$ 18.582.849,61	R$ 18.008.050,77
INTRAG/KINEA	R$ 22.724.698,78	R$ 27.477.002,27	R$ 27.285.165,75
CLARITAS	R$ 14.925.334,00	R$ 14.764.263,00	R$ 14.001.021,48
XP/PATRIA	R$ -	R$ 21.638.591,05	R$ 21.792.317,51
TOTAL	**R$ 3.549.437.125,71**	**R$ 3.593.664.524,86**	**R$ 3.559.113.228,92**

Quadro 6.

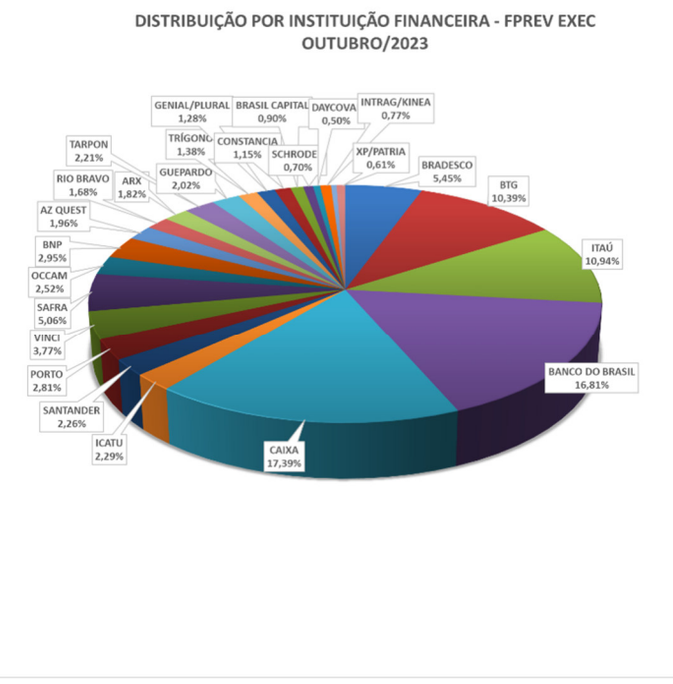

Gráfico 2

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

2.7 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

DATA DA LIQUIDAÇÃO	ORIGEM DO RECURSO / ÓRGÃO	VENCIMENTO	VALOR NA COMPRA	PU de compra (R$)	TAXA %	QUANTIDADE	INSTITUIÇÃO CEDENTE
14/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2030	R$ 99.437.031,23	2.288,5392690	6,5998%	**43.450**	BANCO BRADESCO
28/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2030	R$ 98.620.663,31	2.235,6371889	6,9000%	**44.113**	BANCO BRADESCO
14/01/2014	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 99.980.152,45	2.254,3439110	6,6000%	**44.350**	BANCO BRADESCO
26/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R$ 32.996.277,05	4.035,2546230	5,9080%	**8.177**	BTG PACTUAL CTVM
26/05/2022	EXECUTIVO	15/05/2025	R$ 32.996.442,13	3.995,2103320	5,7700%	**8.259**	ITAU UNIBANCO S/A
26/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R$ 32.999.881,95	4.101,4021820	5,7600%	**8.046**	ITAU UNIBANCO S/A
27/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R$ 99.996.790,45	4.042,2342330	5,8400%	**24.738**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
30/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R$ 99.996.581,53	4.045,3328020	5,8300%	**24.719**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R$ 99.996.708,44	4.032,4505380	6,0200%	**24.798**	BRADESCO
31/05/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R$ 60.469.094,79	4.031,2729860	6,0350%	**15.000**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
07/07/2022	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 49.997.001,46	4.077,3936930	6,0348%	**12.262**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
07/07/2022	EXECUTIVO	15/05/2035	R$ 49.997.851,49	4.023,0006030	6,0300%	**12.428**	BANCO BRADESCO
18/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R$ 99.997.037,06	3.988,7130860	6,7000%	**25.070**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2024	R$ 99.998.464,79	3.977,3472590	7,0100%	**25.142**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2028	R$ 44.998.285,53	3.983,9119550	6,3100%	**11.295**	BGC LIQUIDEZ
24/11/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R$ 44.998.054,42	3.955,8729160	6,3100%	**11.375**	BGC LIQUIDEZ
15/12/2022	EXECUTIVO	15/08/2032	R$ 30.000.634,84	3.947,4519530	6,4350%	**7.600**	BGC LIQUIDEZ
20/12/2022	EXECUTIVO	15/08/2026	R$ 43.796.819,33	3.997,5191060	6,5830%	**3.656**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
02/01/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R$ 49.999.402,21	4.002,5137860	6,3300%	**12.492**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
04/01/2023	EXECUTIVO	15/08/2026	R$ 49.998.898,46	4.042,6017520	6,3700%	**12.368**	BANCO BRADESCO
02/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2032	R$ 49.999.079,97	4.050,1482360	6,3230%	**12.345**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
02/02/2023	EXECUTIVO	15/05/2033	R$ 50.001.797,93	3.967,7668570	6,3890%	**12.602**	BGC LIQUIDEZ
07/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 99.998.414,72	3.945,3331780	6,4990%	**25.346**	BGC LIQUIDEZ
10/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 50.000.319,67	3.989,4933110	6,4000%	**12.533**	BGC LIQUIDEZ
10/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 49.996.382,76	3.992,6834980	6,3920%	**12.522**	BRADESCO
13/02/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R$ 49.996.084,50	3.970,4641440	6,3800%	**12.592**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
27/02/2023	EXECUTIVO	15/05/2033	R$ 49.999.200,55	4.029,5938550	6,2900%	**12.408**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
27/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 49.998.484,59	3.900,3420380	6,3800%	**12.819**	BTG PACTUAL CTVM
28/02/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 45.001.168,51	3.914,5066550	6,3500%	**11.496**	BTG PACTUAL CTVM
01/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 49.998.152,56	3.876,7273440	6,4510%	**12.897**	BTG PACTUAL CTVM
03/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 33.278.800,15	3.870,0663039	6,4810%	**8.599**	BTG PACTUAL CTVM
28/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 80.401.529,70	4.032,7797410	6,1900%	**19.937**	BGC LIQUIDEZ
29/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 24.998.990,87	4.025,6023950	6,2130%	**6.210**	BTG PACTUAL CTVM
29/03/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R$ 15.002.435,16	4.134,0411010	6,1230%	**3.629**	BTG PACTUAL CTVM
30/03/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R$ 25.002.106,94	4.140,7928030	6,1100%	**6.038**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
30/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 15.005.470,96	4.047,8745510	6,1650%	**3.707**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/03/2023	EXECUTIVO	15/08/2040	R$ 20.000.649,11	4.035,6434850	6,2001%	**4.956**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
31/03/2023	EXECUTIVO	15/05/2035	R$ 10.078.203,03	4.135,4957040	6,1330%	**2.437**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
20/04/2023	EXECUTIVO	15/05/2045	R$ 80.001.923,16	4.159,1849840	6,1076%	**19.235**	BGC LIQUIDEZ
24/04/2023	EXECUTIVO	15/05/2045	R$ 19.990.851,03	4.164,7606320	6,1005%	**4.800**	BGC LIQUIDEZ
15/05/2023	EXECUTIVO	15/08/2024	R$ 14.166.225,80	4.131,2993880	6,9900%	**3.429**	BRADESCO
15/05/2023	EXECUTIVO	15/08/2024	R$ 66.001.441,62	4.131,2870320	6,9902%	**15.976**	BGC LIQUIDEZ
18/05/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R$ 84.534.868,51	4.121,0387810	6,0530%	**20.513**	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R$ 76.731.768,52	4.110,9975100	6,2150%	**18.665**	BGC LIQUIDEZ
24/05/2023	EXECUTIVO	15/05/2025	R$ 17.682.335,73	4.112,1711020	6,2770%	**4.300**	BGC LIQUIDEZ
24/11/2022	EXECUTIVO - LTN	01/01/2025	R$ 10.005.811,97	758,0160580	14,0800%	**13.200**	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			**R$ 2.459.144.570,95**			**1.191.348**	

Quadro 7.

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

2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	29/09/2023	31/10/2023
CVS - A	R$ 703.169,57	R$ 685.870,58
CVS - B	R$ 4.549.529,10	R$ 4.437.694,80
CVS - C	R$ 91.216,58	R$ 88.972,52
CVS - D	R$ 498.916,44	R$ 486.652,32
TOTAL	**R$ 5.842.831,69**	**R$ 5.699.190,22**

Quadro 8.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/23	R$ 20.548,63	R$ 147.749,14	R$ 168.297,77
fev/23	R$ 20.137,49	R$ 147.891,88	R$ 168.029,37
mar/23	R$ 19.756,14	R$ 148.193,21	R$ 167.949,35
abr/23	R$ 19.342,87	R$ 148.335,95	R$ 167.678,82
mai/23	R$ 18.953,86	R$ 148.637,28	R$ 167.591,14
jun/23	R$ 18.556,69	R$ 148.922,76	R$ 167.479,45
jul/23	R$ 18.154,01	R$ 149.208,24	R$ 167.362,25
ago/23	R$ 17.760,31	R$ 149.509,57	R$ 167.269,88
set/23	R$ 17.347,06	R$ 149.652,31	R$ 166.999,37
out/23	R$ 16.931,61	R$ 149.795,05	R$ 166.726,66
TOTAL	**R$ 187.488,67**	**R$ 1.487.895,39**	**R$ 1.675.384,06**

FONTE: COFIN / COMIV - Relatório CETIP.

Quadro 9.

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2023			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/23	R$ -	R$ -	R$ -
fev/23	R$ -	R$ 200.728,73	R$ 200.728,73
mar/23	R$ 87.271,44	R$ 100.364,40	R$ 187.635,84
abr/23	R$ 43.635,72	R$ 100.364,40	R$ 144.000,12
mai/23	R$ -	R$ -	R$ -
jun/23	R$ 87.271,44	R$ -	R$ 87.271,44
jul/23	R$ -	R$ -	R$ -
ago/23	R$ 43.635,72	R$ 200.728,80	R$ 244.364,52
set/23	R$ -	R$ -	R$ -
out/23	R$ 43.635,72	R$ -	R$ 43.635,72
TOTAL	**R$ 305.450,04**	**R$ 602.186,33**	**R$ 907.636,37**

FONTE: COMAP/GERAF

Quadro 10.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		
	29/09/2023	31/10/2023	% dos Recursos
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R$ 3.593.664.524,86	R$ 3.559.113.228,92	55,6014%
TÍTULOS PÚBLICOS	R$ 2.749.936.225,22	R$ 2.770.822.579,90	43,2865%
TÍTULOS CVS	R$ 5.842.831,69	R$ 5.699.190,22	0,0890%
IMÓVEIS	R$ 65.484.778,63	R$ 65.484.778,63	1,0230%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R$ -	R$ -	0,0000%
TOTAL	**R$ 6.414.928.360,40**	**R$ 6.401.119.777,67**	**100,00%**

Quadro 11.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
nov/22	R$ 5.675.963.312,47	-0,52%	10,45%	14,00%
dez/22	R$ 5.780.297.494,50	1,84%	12,48%	12,48%
jan/23	R$ 5.771.604.745,47	-0,15%	-0,15%	12,56%
fev/23	R$ 5.742.296.217,39	-0,51%	-0,66%	10,78%
mar/23	R$ 5.791.959.003,03	0,86%	0,20%	8,86%
abr/23	R$ 5.880.428.580,01	1,53%	1,73%	12,49%
mai/23	R$ 6.042.794.420,25	2,76%	4,54%	14,26%
jun/23	R$ 6.221.758.620,80	2,96%	7,64%	19,64%
jul/23	R$ 6.349.177.301,02	2,05%	9,84%	18,78%
ago/23	R$ 6.350.604.433,59	0,02%	9,87%	15,88%
set/23	R$ 6.414.928.360,40	1,01%	10,98%	16,39%
out/23	**R$ 6.401.119.777,67**	**-0,22%**	**10,91%**	**12,78%**

Quadro 12.

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 10/2022	R$ 5.705.635.877,49

Período	Receitas (R$)	Despesas (R$)	Resultado (R$)
11/2022	R$ 47.465.381,12	R$ 11.535.636,72	R$ 35.929.744,40
12/2022	R$ 110.680.756,99	R$ 16.540.401,56	R$ 94.140.355,43
01/2023	R$ 33.677.075,44	R$ 13.128.151,27	R$ 20.548.924,17
02/2023	R$ 48.396.223,00	R$ 19.336.309,60	R$ 29.059.913,40
03/2023	R$ 47.844.489,27	R$ 13.501.061,49	R$ 34.343.427,78
04/2023	R$ 48.529.359,82	R$ 12.897.196,53	R$ 35.632.163,29
05/2023	R$ 49.523.530,80	R$ 17.943.389,07	R$ 31.580.141,73
06/2023	R$ 48.501.155,60	R$ 14.660.037,39	R$ 33.841.118,21
07/2023	R$ 54.934.340,93	R$ 13.180.680,80	R$ 41.753.660,13
08/2023	R$ 51.193.351,70	R$ 14.114.289,57	R$ 37.079.062,13
09/2023	R$ 51.455.681,82	R$ 13.840.342,71	R$ 37.615.339,11
10/2023	R$ 52.036.725,22	R$ 19.901.437,80	R$ 32.135.287,42

Saldo dos Investimentos em 10/2023	R$ 6.401.119.777,67

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	**Índice de Inflação**	IPCA (IBGE)

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,8192 %	3,7480 %	0,2400 %
Juros	5,1200 %	4,2488 %	0,4170 %
Meta	10,1860 %	8,1561 %	0,6580 %
Rentabilidade em %	3,9078 %	4,8526 %	-0,7162 %
Rentabilidade em R$	R$ 231.824.762,98	R$ 287.233.245,80	R$ -45.943.870,15
Resultado em %	-5,6978 %	-3,0543 %	-1,3652 %
Resultado em R$	R$ -372.228.577,85	R$ -195.465.574,26	R$ -88.152.219,94

Quadro 13.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/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					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R$ 629.618,15	R$ 631.234,05	0,6307	0,4038	0,2566	1,2963%	2,2009%	2,2009%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R$ 288.481,71	R$ 501.096,55	0,3700	(0,3000)	(0,2100)	-0,1413%	11,1032%	9,5520%
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	**R$ 918.099,86**	**R$ 1.132.330,60**						
SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF	R$ 62.511,27	R$ 63.124,44	1,1300	0,9700	0,9800	3,1116%	9,6391%	11,9758%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R$ 428.008,35	R$ 420.451,34	1,1000	0,9300	0,9400	2,9994%	7,4562%	NC
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R$ 3.972,19	R$ 4.011,00	1,1400	0,9700	0,9800	3,1218%	6,5413%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	**R$ 494.491,81**	**R$ 487.586,78**						
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R$ 1.146.297,46	R$ 1.159.856,35	1,9800	1,3300	1,1800	4,5557%	10,5787%	14,4490%
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	**R$ 1.146.297,46**	**R$ 1.159.856,35**						
TOTAL RENDA FIXA	**R$ 2.558.889,13**	**R$ 2.779.773,73**						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R$ 483.958,66	R$ 469.931,24	(4,0100)	0,5800	(2,9000)	-6,2531%	0,9657%	-3,6354%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R$ 1.074.218,72	R$ 1.032.748,40	(7,1800)	0,6200	(3,8600)	-10,2096%	-1,3000%	-12,0600%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R$ 548.360,25	R$ 516.913,60	(3,4032)	(0,1211)	(5,7347)	-9,0530%	5,3875%	-1,2120%
OCCAM FIC FIA	R$ 962.636,08	R$ 939.861,32	(5,7700)	0,7900	(2,3700)	-7,2765%	-0,2882%	-8,0458%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 118.888,13	R$ 111.148,90	(6,8700)	(1,0600)	(6,5100)	-13,8557%	8,6491%	-0,0967%
TOTAL art. 8º, inciso I	**R$ 3.188.061,84**	**R$ 3.070.603,46**						
TOTAL RENDA VARIÁVEL	**R$ 3.188.061,84**	**R$ 3.070.603,46**						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R$ 1.013.659,68	R$ 992.847,79	3,7700	(2,8000)	(2,0500)	-1,2033%	7,7960%	9,4928%
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	**R$ 1.013.659,68**	**R$ 992.847,79**						
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	**R$ 1.013.659,68**	**R$ 992.847,79**						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R$ 489.476,24	R$ 480.972,88	(0,9600)	(4,4000)	(1,7400)	-6,9652%	15,4812%	16,4562%
TOTAL art. 10º, inciso I	**R$ 489.476,24**	**R$ 480.972,88**						
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	**R$ 489.476,24**	**R$ 480.972,88**						
TOTAL GERAL	**R$ 7.250.086,89**	**R$ 7.324.197,86**						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ -	R$ -						
TOTAL DOS RECURSOS	**R$ 7.250.086,89**	**R$ 7.324.197,86**						

Quadro 14.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base as **Ata de reunião do COMIV nº. 203/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 29/09/2023, constante do processo nº 2023.A.08538: **Item 3.2. FPREV ALE: a) Recursos Novos:** Aplicar no Itaú Alocação Dinâmica (21.838.150/0001-49), considerando o exposto no item 3.1.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

3.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

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

Quadro 15.

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

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	29/09/2023	31/10/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R$ 2.558.889,13	R$ 2.779.773,73
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R$ 3.188.061,84	R$ 3.070.603,46
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R$ 1.013.659,68	R$ 992.847,79
FUNDOS ESTRUTURADOS	R$ 489.476,24	R$ 480.972,88
TÍTULOS PÚBLICOS	R$ 16.255.905,99	R$ 16.378.539,53
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R$ -	R$ -
TOTAL	**R$ 23.505.992,88**	**R$ 23.702.737,39**

Quadro 16.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

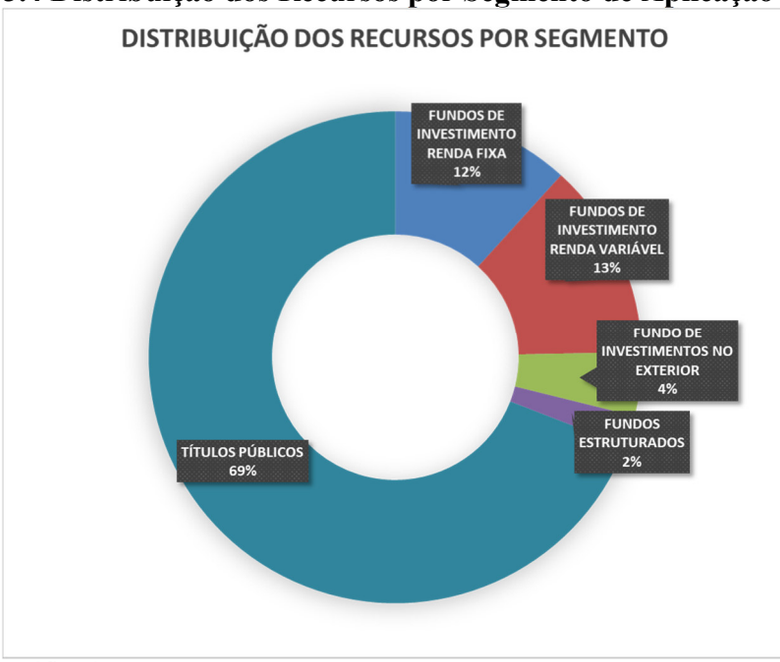

Gráfico 3.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 10/2022	R$ 20.057.640,86

Período	Receitas (R$)	Despesas (R$)	Resultado (R$)
11/2022	R$ 208.368,70	R$ 0,00	R$ 208.368,70
12/2022	R$ 215.348,54	R$ 0,00	R$ 215.348,54
01/2023	R$ 415.713,96	R$ 50.378,58	R$ 365.335,38
02/2023	R$ 206.662,34	R$ 10.022,51	R$ 196.639,83
03/2023	R$ 205.889,22	R$ 10.391,50	R$ 195.497,72
04/2023	R$ 206.002,88	R$ 12.482,71	R$ 193.520,17
05/2023	R$ 228.539,50	R$ 11.441,00	R$ 217.098,50
06/2023	R$ 217.377,92	R$ 11.524,07	R$ 205.853,85
07/2023	R$ 217.377,92	R$ 10.805,73	R$ 206.572,19
08/2023	R$ 216.019,28	R$ 11.691,42	R$ 204.327,86
09/2023	R$ 214.375,56	R$ 11.596,40	R$ 202.779,16
10/2023	R$ 213.182,16	R$ 11.534,70	R$ 201.647,46

Saldo dos Investimentos em 10/2023	R$ 23.702.737,39

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	**Índice de Inflação**	IPCA (IBGE)

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,8192 %	3,7480 %	0,2400 %
Juros	5,1200 %	4,2488 %	0,4170 %
Meta	10,1860 %	8,1561 %	0,6580 %
Rentabilidade em %	4,8466 %	5,9775 %	-0,0209 %
Rentabilidade em R$	R$ 1.032.107,17	R$ 1.272.253,78	R$ -4.902,95
Resultado em %	-4,8458 %	-2,0143 %	-0,6744 %
Resultado em R$	R$ -1.135.936,41	R$ -463.403,54	R$ -159.565,50

Quadro 17.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R$ 5.421.380,88	R$ 7.226.981,52	0,6307	0,4038	0,2566	1,5293%	2,2009%	NC
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R$ 4.629.631,32	R$ 4.534.451,77	1,1000	1,0500	0,9400	3,1832%	5,2467%	NC
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	**R$ 10.051.012,20**	**R$ 11.761.433,29**						
BRADESCO RF DI PREMIUM	R$ 4.151.617,75	R$ 4.195.391,32	1,2700	1,0500	1,0500	3,3567%	6,6889%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	**R$ 4.151.617,75**	**R$ 4.195.391,32**						
TOTAL RENDA FIXA	**R$ 14.202.629,95**	**R$ 15.956.824,61**						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 1.402.919,78	R$ 1.311.594,37	(6,8700)	(1,0600)	(6,5100)	10,0759%	8,6491%	-0,0967%
BB AÇOES VALOR	R$ 15.363.274,85	R$ 14.780.444,92	(5,8143)	0,2590	(3,7936)	5,7843%	-1,8488%	-7,1508%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 8.590.673,05	R$ 8.324.060,45	(3,5500)	1,5037	(3,1035)	11,2888%	20,6610%	7,8980%
OCCAM FIC FIA	R$ 6.157.563,48	R$ 6.011.883,35	(5,7700)	0,7900	(2,3700)	6,7525%	-0,2882%	-10,5020%
TARPON GT INST FIC FIA	R$ 9.475.975,54	R$ 8.903.497,01	(2,1346)	7,6550	(6,0414)	14,1402%	30,8737%	11,8794%
TRIGONO FLAGSHIP INST FI FIA	R$ 6.714.145,41	R$ 6.203.539,62	2,4100	3,0200	(7,6000)	9,0012%	5,6783%	1,9371%
TOTAL art. 8º, inciso I - RENDA VARIAVEL	**R$ 47.704.552,11**	**R$ 45.535.019,72**						

FUNDO DE INVESTIMENTO - FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R$ 7.808.634,63	R$ 7.672.979,94	(0,9600)	(4,4000)	(1,7400)	9,6951%	15,4812%	16,4562%
TOTAL art. 10º, inciso I	**R$ 7.808.634,63**	**R$ 7.672.979,94**						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ -	R$ -						
TOTAL RECURSOS	**R$ 69.715.816,69**	**R$ 69.164.824,27**						

Quadro 18.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. **203/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 29/09/2023, constante do processo nº 2023.A.08538, **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF, mantido o entendimento pela estratégia de gestão ativa com menor volatilidade para o momento.

4.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

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

Quadro 19.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MjI5

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

4.3 Total dos Recursos – MPE/FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	SALDO	
	29/09/2023	31/10/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R$ 14.202.629,95	R$ 15.956.824,61
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R$ 47.704.552,11	R$ 45.535.019,72
FUNDOS ESTRUTURADOS	R$ 7.808.634,63	R$ 7.672.979,94
TÍTULOS PÚBLICOS	R$ 194.835.802,09	R$ 196.289.916,14
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R$ -	R$ -
TOTAL	**R$ 264.551.618,78**	**R$ 265.454.740,41**

Quadro 20.

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

4.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

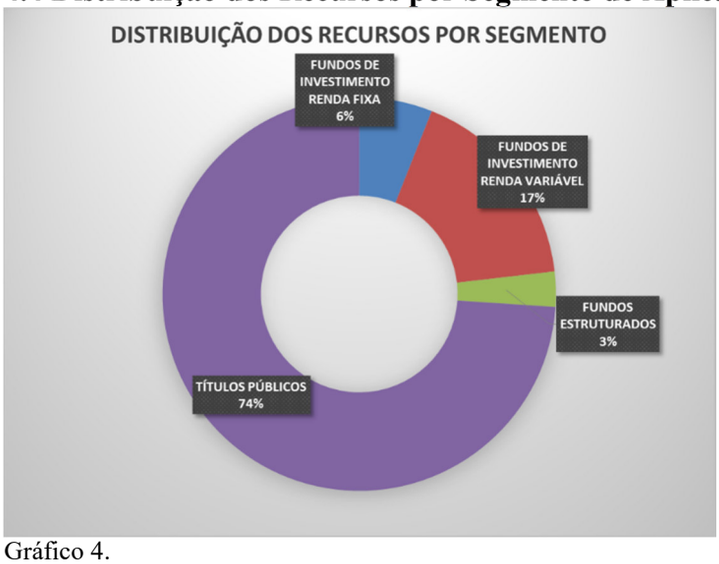

Gráfico 4.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

4.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 10/2022	R$ 223.151.521,12

Período	Receitas (R$)	Despesas (R$)	Resultado (R$)
11/2022	R$ 1.613.014,95	R$ 45.605,84	R$ 1.567.409,11
12/2022	R$ 1.611.566,90	R$ 89.462,79	R$ 1.522.104,11
01/2023	R$ 3.260.425,74	R$ 136.113,27	R$ 3.124.312,47
02/2023	R$ 1.613.129,15	R$ 145.358,74	R$ 1.467.770,41
03/2023	R$ 1.623.976,36	R$ 160.693,65	R$ 1.463.282,71
04/2023	R$ 2.424.596,60	R$ 178.605,05	R$ 2.245.991,55
05/2023	R$ 2.448.819,76	R$ 170.907,83	R$ 2.277.911,93
06/2023	R$ 2.450.779,10	R$ 152.787,06	R$ 2.297.992,04
07/2023	R$ 1.803.152,02	R$ 144.209,32	R$ 1.658.942,70
08/2023	R$ 1.789.593,08	R$ 190.978,30	R$ 1.598.614,78
09/2023	R$ 1.799.649,08	R$ 156.703,67	R$ 1.642.945,41
10/2023	R$ 1.843.142,32	R$ 192.262,07	R$ 1.650.880,25

Saldo dos Investimentos em 10/2023	R$ 265.454.740,41

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	**Índice de Inflação**	IPCA (IBGE)

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,8192 %	3,7480 %	0,2400 %
Juros	5,1200 %	4,2488 %	0,4170 %
Meta	10,1860 %	8,1561 %	0,6580 %
Rentabilidade em %	8,4722 %	9,0151 %	-0,2827 %
Rentabilidade em R$	R$ 19.785.061,82	R$ 21.110.915,93	R$ -747.758,62
Resultado em %	-1,5554 %	+0,7942 %	-0,9345 %
Resultado em R$	R$ -3.999.221,26	R$ +2.010.541,07	R$ -2.488.430,79

Quadro 21.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/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 (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R$ 4.176.312,39	R$ 5.527.371,08	0,6307	0,4038	0,2566	1,2963%	1,2963%	NC
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	**R$ 4.176.312,39**	**R$ 5.527.371,08**						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R$ 3.331.143,07	R$ 3.244.021,43	-	1,0500	1,0500	2,1110%	4,1736%	4,3076%
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	**R$ 3.331.143,07**	**R$ 3.244.021,43**						
TOTAL RENDA FIXA	**R$ 7.507.455,46**	**R$ 8.771.392,51**						

FUNDOS DE AÇÕES	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 943.334,69	R$ 881.926,73	(6,8700)	(1,0600)	(6,5100)	-21,6543%	8,6491%	-13,1172%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇOES LIVRE QUA	R$ 16.886,99	R$ 15.918,57	(3,4032)	(0,1211)	(5,7347)	-13,5468%	5,3875%	-11,1318%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 3.466.248,16	R$ 3.358.672,72	(3,3498)	1,5037	(3,1035)	-4,9411%	20,6607%	-15,7816%
TOTAL art. 8º, inciso I	**R$ 4.426.469,84**	**R$ 4.256.518,02**						

FUNDO ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R$ 3.894.373,20	R$ 3.826.718,60	(0,9600)	(4,4000)	(1,7400)	-6,9652%	15,4812%	9,6269%
TOTAL art. 10º, inciso I	**R$ 3.894.373,20**	**R$ 3.826.718,60**						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ 17.170,72	R$ 6.883,23						
TOTAL RECURSOS	**R$ 15.845.469,22**	**R$ 16.861.512,36**						

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. **203/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 29/09/2023, constante do processo nº 2023.A.08538, **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF, mantido o entendimento pela estratégia de gestão ativa com menor volatilidade para o momento.

5.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

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

Quadro 23.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

5.3 Total dos Recursos – DPE/FPREV

RECURSOS DPE FPREV	SALDO	
	29/09/2023	31/10/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R$ 7.507.455,46	R$ 8.771.392,51
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R$ 4.426.469,84	R$ 4.256.518,02
FUNDOS ESTRUTURADOS	R$ 3.894.373,20	R$ 3.826.718,60
TÍTULOS PÚBLICOS	R$ 59.432.082,41	R$ 59.881.194,37
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R$ 17.170,72	R$ 6.883,23
TOTAL	**R$ 75.277.551,63**	**R$ 76.742.706,73**

Quadro 24.

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

5.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

Gráfico 5.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

5.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

Saldo dos Investimentos em 10/2022	R$ 53.811.764,79

Período	Receitas (R$)	Despesas (R$)	Resultado (R$)
11/2022	R$ 1.325.950,25	R$ 48.051,04	R$ 1.277.899,21
12/2022	R$ 1.340.533,16	R$ 83.947,48	R$ 1.256.585,68
01/2023	R$ 2.652.384,33	R$ 41.366,60	R$ 2.611.017,73
02/2023	R$ 1.363.583,62	R$ 191.804,69	R$ 1.171.778,93
03/2023	R$ 1.361.693,00	R$ 121.514,16	R$ 1.240.178,84
04/2023	R$ 1.353.367,86	R$ 107.760,38	R$ 1.245.607,48
05/2023	R$ 1.366.665,90	R$ 172.454,63	R$ 1.194.211,27
06/2023	R$ 1.360.589,35	R$ 122.825,00	R$ 1.237.764,35
07/2023	R$ 1.361.041,17	R$ 106.111,80	R$ 1.254.929,37
08/2023	R$ 1.355.445,23	R$ 119.560,47	R$ 1.235.884,76
09/2023	R$ 1.340.191,95	R$ 108.101,04	R$ 1.232.090,91
10/2023	R$ 1.341.254,81	R$ 135.537,65	R$ 1.205.717,16

Saldo dos Investimentos em 10/2023	R$ 76.742.706,73

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	**Índice de Inflação**	IPCA (IBGE)

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,8192 %	3,7480 %	0,2400 %
Juros	5,1200 %	4,2488 %	0,4170 %
Meta	10,1860 %	8,1561 %	0,6580 %
Rentabilidade em %	11,0024 %	10,0090 %	0,3446 %
Rentabilidade em R$	R$ 6.767.276,25	R$ 6.346.336,06	R$ 259.437,94
Resultado em %	+0,7409 %	+1,7132 %	-0,3113 %
Resultado em R$	R$ +501.110,54	R$ +1.173.369,62	R$ -235.866,30

Quadro 25.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/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 (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R$ 9.664.536,41	R$ 14.467.692,29	0,6307	0,4038	0,2566	1,2963%	1,2963%	NC
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	**R$ 9.664.536,41**	**R$ 14.467.692,29**						
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R$ 25.871.765,57	R$ 26.144.550,67	1,2700	1,0500	1,0500	4,6280%	3,4078%	11,6485%
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R$ 4.852.251,68	R$ 4.229.235,77	1,1000	0,9300	0,9400	4,0397%	2,9994%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	**R$ 30.724.017,25**	**R$ 30.373.786,44**						
TOTAL RENDA FIXA	**R$ 40.388.553,66**	**R$ 44.841.478,73**						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 3.062.151,83	R$ 2.862.815,93	(6,8700)	(1,0600)	(6,5100)	-13,8557%	8,6491%	-0,0967%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇOES LIVRE QUA	R$ 10.638.603,55	R$ 10.028.514,73	(3,4032)	(0,1211)	(5,7347)	-9,0530%	5,3875%	-1,2120%
OCCAM FIC FIA	R$ 1.098.608,08	R$ 1.072.616,41	(5,7700)	0,7900	(2,3700)	-7,2765%	-0,2882%	-8,0458%
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R$ 1.400.136,18	R$ 1.293.656,86	2,4100	3,0200	(7,6000)	-2,5154%	5,6783%	1,9371%
TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 1.699.837,23	R$ 1.597.143,81	(2,1346)	7,6550	(6,0414)	-1,0080%	30,8737%	11,8794%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 7.551.399,76	R$ 7.317.041,14	(3,3498)	1,5037	(3,1035)	-4,9411%	21,0062%	8,2067%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R$ 4.842.701,40	R$ 4.636.593,93	(5,2200)	(0,2900)	(4,2560)	-9,5170%	0,3336%	-9,6940%
TOTAL art. 8º, inciso I	**R$ 30.293.438,03**	**R$ 28.808.382,81**						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R$ 27.399.633,17	R$ 26.937.798,66	2,6274	(1,8521)	(1,6855)	-0,9711%	5,3906%	12,3230%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	**R$ 27.399.633,17**	**R$ 26.937.798,66**						

FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R$ 20.775.109,17	R$ 20.414.195,78	(0,9600)	(4,4000)	(1,7400)	-6,9652%	15,4856%	16,4606%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	**R$ 20.775.109,17**	**R$ 20.414.195,78**						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ -	R$ -						
TOTAL	**R$ 118.856.734,03**	**R$ 121.001.855,98**						

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. **203/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 29/09/2023, constante do processo nº 2023.A.08538, **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF, mantido o entendimento pela estratégia de gestão ativa com menor volatilidade para o momento.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/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**	BRADESCO
15/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2024	R$ 99.998.388,61	4.127,5596900	7,0700%	**24.227**	XP INVESTIMENTOS CCTVM
18/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R$ 9.997.640,08	4.121,0387810	6,0530%	**2.426**	BGC LIQUIDEZ
19/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R$ 9.973.279,95	4.110,9975100	6,2150%	**2.426**	BGC LIQUIDEZ
24/05/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/05/2025	R$ 82.317.441,11	4.112,1711020	6,2770%	**20.018**	BGC LIQUIDEZ
26/06/2023	TRIBUNAL DE JUSTIÇA	15/08/2024	R$ 62.001.520,92	4.156,7123700	7,3820%	**14.916**	BGC LIQUIDEZ
TOTAL			**R$ 793.497.201,03**			**196.725**	

Quadro 27.

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

6.3 Total dos Recursos – TJ/AM-FPREV

RECURSOS TJ/AM FPREV	SALDO	
	29/09/2023	31/10/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R$ 40.388.553,66	R$ 44.841.478,73
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R$ 30.293.438,03	R$ 28.808.382,81
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R$ 27.399.633,17	R$ 26.937.798,66
FUNDOS ESTRUTURADOS	R$ 20.775.109,17	R$ 20.414.195,78
TÍTULOS PÚBLICOS	R$ 566.233.167,02	R$ 570.637.149,20
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R$ -	R$ -
TOTAL	**R$ 685.089.901,05**	**R$ 691.639.005,18**

Quadro 28.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

6.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

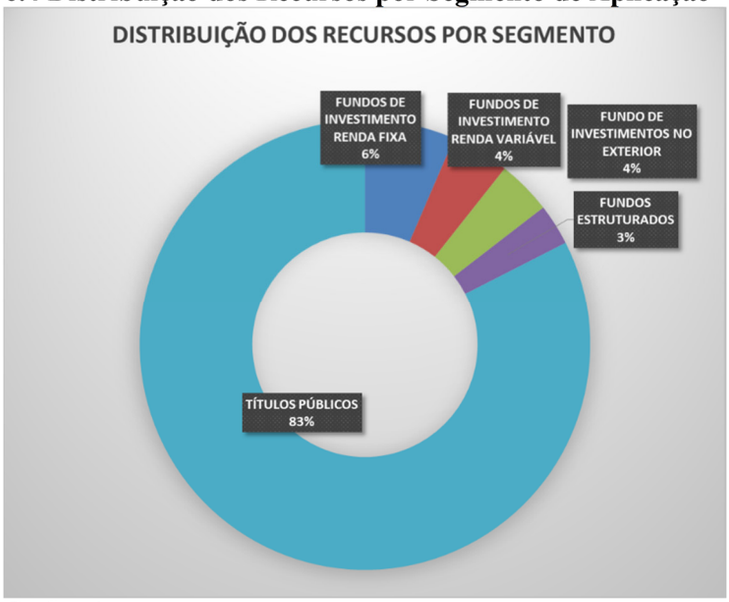

Gráfico 6

6.5 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 10/2022	R$ 579.332.811,55

Período	Receitas (R$)	Despesas (R$)	Resultado (R$)
11/2022	R$ 4.407.617,21	R$ 355.001,41	R$ 4.052.615,80
12/2022	R$ 8.528.187,87	R$ 425.895,65	R$ 8.102.292,22
01/2023	R$ 4.503.689,63	R$ 316.298,28	R$ 4.187.391,35
02/2023	R$ 4.452.062,90	R$ 386.831,46	R$ 4.065.231,44
03/2023	R$ 4.682.824,72	R$ 954.025,73	R$ 3.728.798,99
04/2023	R$ 37.853,98	R$ 416.120,94	R$ -378.266,96
05/2023	R$ 9.514.313,12	R$ 826.562,19	R$ 8.687.750,93
06/2023	R$ 4.768.915,92	R$ 398.809,96	R$ 4.370.105,96
07/2023	R$ 4.785.265,87	R$ 584.156,10	R$ 4.201.109,77
08/2023	R$ 33.609,27	R$ 678.500,13	R$ -644.890,86
09/2023	R$ 9.554.818,39	R$ 572.787,56	R$ 8.982.030,83
10/2023	R$ 4.778.352,07	R$ 665.888,73	R$ 4.112.463,34

Saldo dos Investimentos em 10/2023	R$ 691.639.005,18

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	**Índice de Inflação**	IPCA (IBGE)

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,8192 %	3,7480 %	0,2400 %
Juros	5,1200 %	4,2488 %	0,4170 %
Meta	10,1860 %	8,1561 %	0,6580 %
Rentabilidade em %	9,7414 %	9,3422 %	0,3557 %
Rentabilidade em R$	R$ 58.839.560,82	R$ 57.036.491,71	R$ 2.436.640,79
Resultado em %	-0,4035 %	+1,0967 %	-0,3003 %
Resultado em R$	R$ -2.683.474,51	R$ +7.238.782,30	R$ -2.071.050,11

Quadro 29.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R$ 4.084.082,74	R$ 4.048.979,76	1,1000	0,9300	0,9400	2,9994%	7,1708%	NC
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R$ 3.176.247,30	R$ 3.754.493,37	0,6307	0,4038	0,2566	1,2963%	1,2963%	NC
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	**R$ 7.260.330,04**	**R$ 7.803.473,13**						
TOTAL RENDA FIXA	**R$ 7.260.330,04**	**R$ 7.803.473,13**						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 827.277,69	R$ 773.424,67	(6,8700)	(1,0600)	(6,5100)	-13,8557%	8,6491%	-0,0967%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇOES LIVRE QUANTIT.	R$ 10.638.603,55	R$ 10.028.514,73	(3,4032)	(0,1211)	(5,7347)	-9,0530%	5,3875%	-1,2120%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 1.749.114,55	R$ 1.694.830,57	(3,3498)	1,5037	(3,1035)	-4,9411%	21,0106%	8,2106%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R$ 902.453,08	R$ 864.044,28	(5,2200)	(0,2900)	(4,2560)	-9,5170%	0,3336%	-9,6940%
TOTAL art. 8º, inciso I	**R$ 14.117.448,87**	**R$ 13.360.814,25**						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R$ 524.034,72	R$ 515.201,85	2,6274	(1,8521)	(1,6855)	-0,9711%	5,3906%	12,3230%
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	**R$ 524.034,72**	**R$ 515.201,85**						

FUNDOS ESTRUTURADOS	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/09/2023	31/10/2023	ago/23	set/23	out/23	TRIMESTRE	2023	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R$ 3.876.093,92	R$ 3.808.756,88	(0,9600)	(4,4000)	(1,7400)	-6,9652%	15,4812%	16,4562%
TOTAL art. 10º, inciso I	**R$ 3.876.093,92**	**R$ 3.808.756,88**						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ -	R$ -						
TOTAL	**R$ 25.777.907,55**	**R$ 25.488.246,11**						

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. **203/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria, através do Despacho de 29/09/2023, constante do processo nº 2023.A.08538, **3.3 OUTROS PODERES: MPE / DPE / TJA / TCE FPREV. a) Novos Recursos:** Aplicar no fundo Caixa BRASIL FIC Gestão Estratégica RF, mantido o entendimento pela estratégia de gestão ativa com menor volatilidade para o momento.

7.2 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

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

Quadro 31.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MjI5

7.3 Total dos Recursos – TCE/AM-FPREV

RECURSOS TCE/AM FPREV	SALDO	
	29/09/2023	31/10/2023
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R$ 7.260.330,04	R$ 7.803.473,13
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R$ 14.117.448,87	R$ 13.360.814,25
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R$ 524.034,72	R$ 515.201,85
TÍTULOS PÚBLICOS	R$ 138.232.945,29	R$ 139.301.731,68
FUNDO DE INVESTIMENTOS - FUNDOS ESTRUTURADOS	R$ 3.876.093,92	R$ 3.808.756,88
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R$ -	R$ -
TOTAL	**R$ 164.010.852,84**	**R$ 164.789.977,79**

Quadro 32.

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

7.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

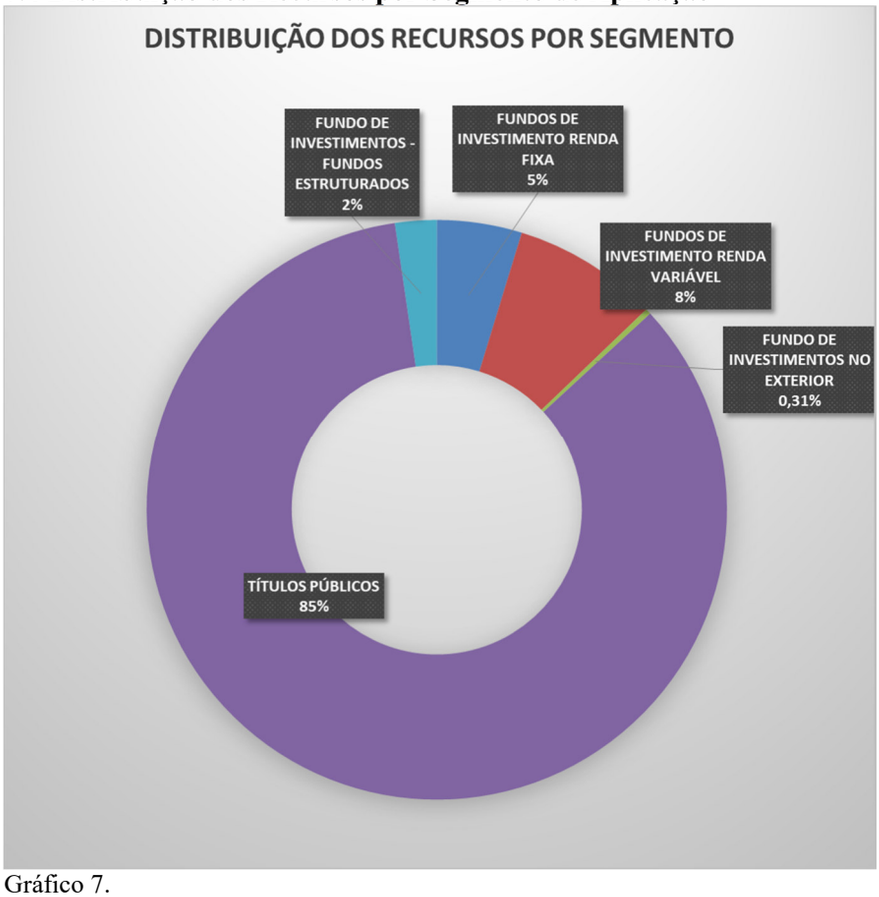

Gráfico 7.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 10/2022	R$ 139.225.277,87

Período	Receitas (R$)	Despesas (R$)	Resultado (R$)
11/2022	R$ 957.070,80	R$ 38.906,51	R$ 918.164,29
12/2022	R$ 1.730.199,65	R$ 39.809,66	R$ 1.690.389,99
01/2023	R$ 818.311,18	R$ 24.852,01	R$ 793.459,17
02/2023	R$ 840.406,80	R$ 57.209,33	R$ 783.197,47
03/2023	R$ 868.020,15	R$ 119.035,88	R$ 748.984,27
04/2023	R$ 884.821,56	R$ 81.955,68	R$ 802.865,88
05/2023	R$ 893.485,01	R$ 93.218,22	R$ 800.266,79
06/2023	R$ 906.009,82	R$ 92.481,20	R$ 813.528,62
07/2023	R$ 1.039.877,59	R$ 83.329,25	R$ 956.548,34
08/2023	R$ 542.924,76	R$ 85.771,35	R$ 457.153,41
09/2023	R$ 1.698.028,43	R$ 145.941,45	R$ 1.552.086,98
10/2023	R$ 605.784,29	R$ 108.651,95	R$ 497.132,34

Saldo dos Investimentos em 10/2023	R$ 164.789.977,79

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	**Índice de Inflação**	IPCA (IBGE)

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,8192 %	3,7480 %	0,2400 %
Juros	5,1200 %	4,2488 %	0,4170 %
Meta	10,1860 %	8,1561 %	0,6580 %
Rentabilidade em %	10,2156 %	9,0895 %	0,1719 %
Rentabilidade em R$	R$ 14.750.922,37	R$ 13.342.388,34	R$ 281.992,61
Resultado em %	+0,0269 %	+0,8630 %	-0,4829 %
Resultado em R$	R$ +42.791,82	R$ +1.369.687,25	R$ -797.150,77

Quadro 33.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 10/2022	R$ 6.721.214.893,68

Período	Receitas (R$)	Despesas (R$)	Resultado (R$)
11/2022	R$ 55.977.403,03	R$ 12.023.201,52	R$ 43.954.201,51
12/2022	R$ 124.106.593,11	R$ 17.179.517,14	R$ 106.927.075,97
01/2023	R$ 45.327.600,28	R$ 13.697.160,01	R$ 31.630.440,27
02/2023	R$ 56.872.067,81	R$ 20.127.536,33	R$ 36.744.531,48
03/2023	R$ 56.586.892,72	R$ 14.866.722,41	R$ 41.720.170,31
04/2023	R$ 53.436.002,70	R$ 13.694.121,29	R$ 39.741.881,41
05/2023	R$ 63.975.354,09	R$ 19.217.972,94	R$ 44.757.381,15
06/2023	R$ 58.204.827,71	R$ 15.438.464,68	R$ 42.766.363,03
07/2023	R$ 64.141.055,50	R$ 14.109.293,00	R$ 50.031.762,50
08/2023	R$ 55.130.943,32	R$ 15.200.791,24	R$ 39.930.152,08
09/2023	R$ 66.062.745,23	R$ 14.835.472,83	R$ 51.227.272,40
10/2023	R$ 60.818.440,87	R$ 21.015.312,90	R$ 39.803.127,97

Saldo dos Investimentos em 10/2023	R$ 7.623.448.945,17

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

Taxa de Juros Anual	5,1200 %	**Índice de Inflação**	IPCA (IBGE)

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA (IBGE)	4,8192 %	3,7480 %	0,2400 %
Juros	5,1200 %	4,2488 %	0,4170 %
Meta	10,1860 %	8,1561 %	0,6580 %
Rentabilidade em %	4,7590 %	5,5228 %	-0,5732 %
Rentabilidade em R$	R$ 332.999.691,41	R$ 386.341.631,62	R$ -43.718.460,38
Resultado em %	-4,9253 %	-2,4347 %	-1,2231 %
Resultado em R$	R$ -379.503.307,67	R$ -184.136.597,57	R$ -93.904.283,40

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: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

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

Gráfico 8.

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

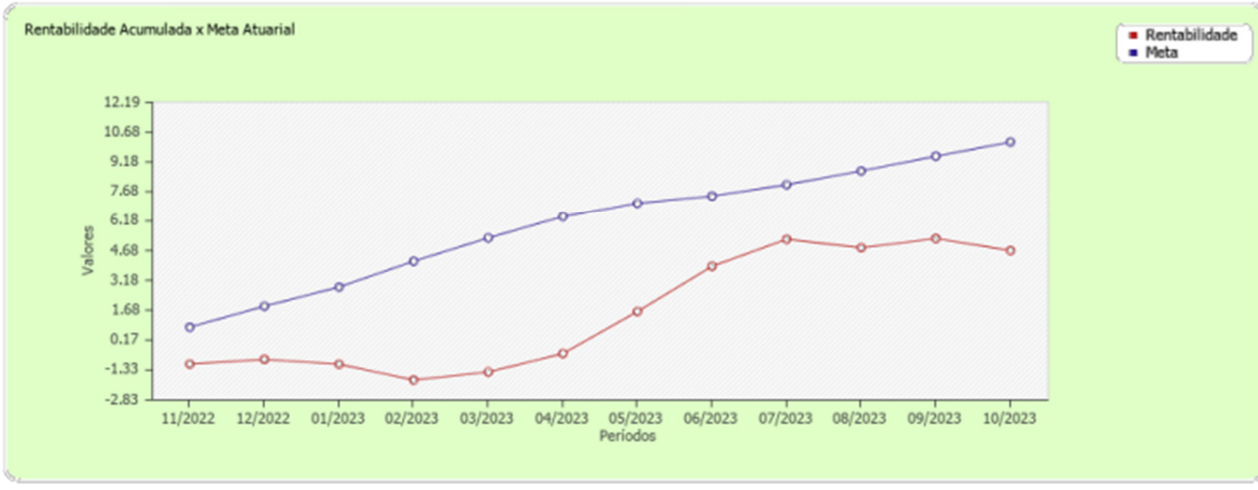

Gráfico 9.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	29/09/2023	31/10/2023
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$ 1.052.225,76	R$ 486.450,00
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R$ 74.422.483,43	R$ 15.049.322,93
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R$ 2.830.535,64	R$ 5.155,96
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R$ 14.463.946,17	R$ 205.834,68
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R$ 237.972,91	R$ 236.200,51
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R$ -	R$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R$ 5.602,64	R$ -
TOTAL	**R$ 93.012.766,55**	**R$ 15.982.964,08**

Quadro 35.

Nota 1: Os valores recebidos de Contribuição no FFIN são utilizados no pagamento das folhas de aposentados e pensionistas dessa massa previdenciária.

Nota 2: Observa-se a variação de R$ 59.373.160,5, no FUNDO BRADESCO RF - COMPREV, pertencente a conta de compensação previdenciária, utilizado para a cobertura da insuficiência financeira da folha de aposentados e pensionistas do FFIN do Poder Executivo, conforme consta no Processo nº. 2023.A.09030.

9.2 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	29/09/2023	31/10/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R$ 6.436.662,53	R$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R$ 4.614,35	R$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R$ 24.357,83	R$ 24.326,48
TOTAL	**R$ 6.465.634,71**	**R$ 24.326,48**

Quadro 36.

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

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	29/09/2023	31/10/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$ -	R$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ -	R$ -
TOTAL	**R$ -**	**R$ -**

Quadro 37.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS			
	29/09/2023		31/10/2023	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$	245.375,33	R$	-
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R$	71.557,39	R$	2.432,32
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$	-	R$	3.570,65
TOTAL	**R$**	**316.932,72**	**R$**	**6.002,97**

Quadro 39.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS			
	29/09/2023		31/10/2023	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$	750.347,81	R$	115.306,60
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R$	-	R$	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$	-	R$	-
TOTAL	**R$**	**750.347,81**	**R$**	**115.306,60**

Quadro 40.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS			
	29/09/2023		31/10/2023	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$	6.974.745,73	R$	7.732.482,33
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R$	656.540,21	R$	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$	-	R$	-
TOTAL	**R$**	**7.631.285,94**	**R$**	**7.732.482,33**

Quadro 41.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS			
	29/09/2023		31/10/2023	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$	1.121.960,84	R$	472.599,61
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R$	1.557.129,69	R$	-
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$	17.076,40	R$	-
TOTAL	**R$**	**2.696.166,93**	**R$**	**472.599,61**

Quadro 42

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Evolução do Saldo de Taxa de Administração

DESCRIÇÃO	SALDOS			
	31/12/2021	31/08/2023	29/09/2023	31/10/2023
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$ 1.143,62	R$ 850.207,07	R$ 2.172.585,41	R$ 1.654.839,82
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R$ 40.560.407,77	R$ 19.239.753,29	R$ 15.917.419,57	R$ 16.079.292,84
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ -	R$ -	R$ -	R$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ 1,00	R$ -	R$ -	R$ -
TOTAL PODER EXECUTIVO	**R$ 40.561.552,39**	**R$ 20.089.960,36**	**R$ 18.090.004,98**	**R$ 17.734.132,66**
DESCRIÇÃO	**SALDOS**			
	31/12/2021	**31/08/2023**	**29/09/2023**	**31/10/2023**
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$ -	R$ -	R$ -	R$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ 35.718,27	R$ -	R$ -	R$ -
TOTAL - ALE	**R$ 35.718,27**	**R$ -**	**R$ -**	**R$ -**
DESCRIÇÃO	**SALDOS**			
	31/12/2021	**31/08/2023**	**29/09/2023**	**31/10/2023**
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$ 61.970,46	R$ -	R$ -	R$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ 1,00	R$ -	R$ -	R$ -
TOTAL - TCE	**R$ 61.971,46**	**R$ -**	**R$ -**	**R$ -**
DESCRIÇÃO	**SALDOS**			
	31/12/2021	**31/08/2023**	**29/09/2023**	**31/10/2023**
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$ 605.835,00	R$ -	R$ -	R$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ -	R$ -	R$ -	R$ -
TOTAL TJ/AM	**R$ 605.835,00**	**R$ -**	**R$ -**	**R$ -**
DESCRIÇÃO	**SALDOS**			
	31/12/2021	**31/08/2023**	**29/09/2023**	**31/10/2023**
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$ 199.434,03	R$ -	R$ -	R$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R$ -	R$ -	R$ -	R$ -
TOTAL PGJ/AM	**R$ 199.434,03**	**R$ -**	**R$ -**	**R$ -**
TOTAL GERAL	**R$ 41.464.511,15**	**R$ 20.089.960,36**	**R$ 18.090.004,98**	**R$ 17.734.132,66**

Quadro 43.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023		Resolução CMN nº 4.963/21
			ESTRATÉGIA ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL	R$ 3.753.311.110,83	49,43%	34,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	**R$ 3.753.311.110,83**				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R$ 389.953.504,19	16,56%	29,00%	100,00%	art. 7º, Inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R$ 390.242.905,80				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R$ 57.094.334,95				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R$ 143.714.013,45				
SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R$ 87.492.561,97				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R$ 92.228.236,55				
ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R$ 52.815.077,91				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$ 43.975.551,72				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	**R$ 1.257.516.186,54**				
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R$ 124.904.275,53	2,01%	5,00%	70,00%	art. 7º, inciso III, "a"
CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R$ 27.919.049,93				
TOTAL art. 7º, inciso III, "a"	**R$ 152.823.325,46**				
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R$ 36.180.169,40	6,66%	10,00%	10,00%	art 7º, inciso V, "b"
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R$ 99.338.260,76				
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R$ 100.763.482,25				
PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R$ 99.957.569,57				
BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R$ 105.151.195,55				
SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R$ 64.698.622,77				
TOTAL art 7º, inciso V, "b"	**R$ 506.089.300,30**				
TOTAL RENDA FIXA	**R$ 5.669.739.923,13**	**74,66%**			

Quadro 44.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/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$ 64.898.021,75	18,32%	15,00%	44,00%	art. 8º, inciso I
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R$ 69.618.759,62				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R$ 111.217.961,13				
BB SELEÇÃO FATOR FIC FI	R$ 50.463.329,61				
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R$ 97.284.002,91				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 38.110.685,21				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R$ 183.369.971,07				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇOES LIVRE QUANTITATIVO	R$ 33.546.703,15				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇOES	R$ 18.008.050,77				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R$ 82.100.271,56				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R$ 47.668.948,98				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R$ 66.252.649,94				
OCCAM FIC FIA	R$ 97.619.838,10				
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R$ 97.219.273,95				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 92.712.511,40				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R$ 40.845.620,93				
TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R$ 51.278.462,26				
TARPON GT 30 FIC FIA	R$ 89.156.002,70				
TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R$ 5.221.211,81				
CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R$ 40.781.134,71				
CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R$ 14.001.021,48				
TOTAL art. 8º, inciso I, "a"	**R$ 1.391.374.433,04**				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	**R$ 1.391.374.433,04**	**18,32%**			

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$ 27.453.000,51	1,87%	1,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R$ 32.065.205,87				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R$ 13.605.636,51				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R$ 44.200.272,98				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R$ 24.778.444,02				
TOTAL art 9º, inciso II - Sufixo Investimento no Exterior	**R$ 142.102.559,89**				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R$ 61.057.682,53	1,60%	1,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R$ 28.825.195,72				
ITAU BDR NIVEL 1 AÇÕES	R$ 31.440.200,52				
TOTAL art 9º, inciso III - BDR Nível I	**R$ 121.323.078,77**				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	**R$ 263.425.638,66**	**3,47%**			

Quadro 46.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

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$ 36.203.624,08	1,95%	2,00%	10,00%	art. 10º, inciso I, a
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R$ 17.416.431,83				
FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R$ 15.898.167,25				
CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R$ 19.139.102,40				
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM	R$ 10.596.391,47				
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R$ 33.232.616,05				
RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R$ 15.928.360,81				
TOTAL art. 10º, inciso I, "a"	**R$ 148.414.693,89**				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R$ 40.886.351,99	1,59%	2,00%	5,00%	art. 10°, inciso I, b
BTG PACTUAL INV DE IMPACTO CL A FIP MULT	R$ 22.791.084,44				
BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R$ 6.604.064,57				
CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R$ 1.534.714,24				
KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R$ 27.285.165,75				
PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R$ 21.792.317,51				
TOTAL art. 10º, inciso I, "b"	**R$ 120.893.698,50**				
TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS	**R$ 269.308.392,39**	**3,55%**			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	**R$ 7.593.848.387,22**	**100%**			

Quadro 47.

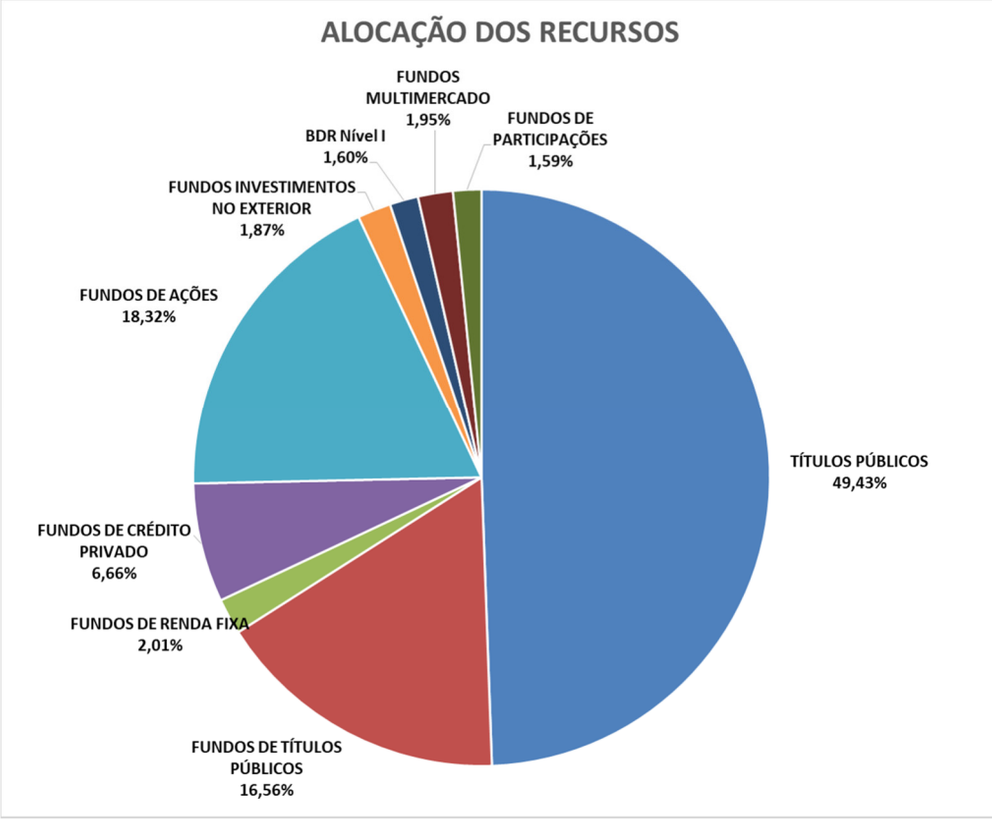

Gráfico 10.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/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	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R$	57.094.334,95	0,74%	100%
FI RENDA FIXA	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$	43.975.551,72	0,57%	100%
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC - FUNDO NOVO	R$	52.815.077,91	0,69%	
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R$	143.714.013,45	1,87%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R$	390.242.905,80	5,09%	
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R$	92.228.236,55	1,20%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R$	87.492.561,97	1,14%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R$	389.953.504,19	5,09%	
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R$	27.919.049,93	0,36%	20%
	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R$	124.904.275,53	1,63%	
FI RF CREDITO PRIVADO	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R$	36.180.169,40	0,47%	20%
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R$	99.338.260,76	1,30%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R$	100.763.482,25	1,31%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R$	99.957.569,57	1,30%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R$	105.151.195,55	1,37%	
	SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R$	64.698.622,77	0,84%	
FUNDOS DE AÇÕES	ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R$	64.898.021,75	0,85%	20%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R$	69.618.759,62	0,91%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R$	111.217.961,13	1,45%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R$	50.463.329,61	0,66%	
	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R$	97.284.002,91	1,27%	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R$	38.110.685,21	0,50%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R$	183.369.971,07	2,39%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇOES LIVRE QUANTITATIVO	R$	33.546.703,15	0,44%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇOES	R$	18.008.050,77	0,23%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R$	82.100.271,56	1,07%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R$	47.668.948,98	0,62%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R$	66.252.649,94	0,86%	
	OCCAM FIC FIA	R$	97.619.838,10	1,27%	
	VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R$	97.219.273,95	1,27%	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R$	92.712.511,40	1,21%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R$	40.845.620,93	0,53%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R$	51.278.462,26	0,67%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R$	89.156.002,70	1,16%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R$	5.221.211,81	0,07%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R$	40.781.134,71	0,53%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R$	14.001.021,48	0,18%	
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIO	R$	27.453.000,51	0,36%	20%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R$	32.065.205,87	0,42%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R$	13.605.636,51	0,18%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R$	44.200.272,98	0,58%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R$	24.778.444,02	0,32%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R$	61.057.682,53	0,80%	20%
	ITAU BDR NIVE 1 AÇÕES	R$	31.440.200,52	0,41%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R$	28.825.195,72	0,38%	

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R$	36.203.624,08	0,47%	20%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R$	17.416.431,83	0,23%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R$	15.898.167,25	0,21%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R$	19.139.102,40	0,25%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R$	10.596.391,47	0,14%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R$	33.232.616,05	0,43%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R$	15.928.360,81	0,21%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R$	40.886.351,99	0,53%	20%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R$	27.285.165,75	0,36%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R$	6.604.064,57	0,09%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R$	1.534.714,24	0,02%	
	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R$	21.792.317,51	0,28%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R$	22.791.084,44	0,30%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		**R$**	**3.840.537.276,39**		

Quadro 48.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO		TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R$	% DO PL DO FUNDO	LIMITE RESOL. CMN 4.963/21
FI RF - 100% TPF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R$ 57.094.334,95	R$ 233.000.840,39	24,50%	100%
	BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R$ 43.975.551,72	R$ 545.666.371,46	8,06%	
	CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R$ 389.953.504,19	R$ 7.787.487.970,57	5,01%	
	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R$ 390.242.905,80	R$ 5.824.441.376,72	6,70%	
	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R$ 143.714.013,45	R$ 5.136.324.306,86	2,80%	
	ITAU SOBERANO SIMPLES FIC	R$ 52.815.077,91	R$ 56.590.937.339,48	0,09%	
	SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF	R$ 87.492.561,97	R$ 6.582.667.069,01	1,33%	
	ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R$ 92.228.236,55	R$ 2.180.749.467,31	4,23%	
FI RENDA FIXA	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R$ 124.904.275,53	R$ 8.965.211.424,43	1,39%	15%
	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	R$ 27.919.049,93	R$ 14.076.402.461,33	0,20%	
FI RF CREDITO PRIVADO	SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R$ 36.180.169,40	R$ 1.206.712.198,20	3,00%	5%
	ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R$ 99.338.260,76	R$ 7.992.454.287,12	1,24%	
	BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R$ 100.763.482,25	R$ 2.724.291.237,74	3,70%	
	PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP	R$ 99.957.569,57	R$ 3.791.509.102,63	2,64%	
	BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF	R$ 105.151.195,55	R$ 12.459.026.720,45	0,84%	
	SAFRA EXTRA BANCOS FIC RF CRED PR	R$ 64.698.622,77	R$ 3.157.249.576,42	2,05%	
FUNDOS DE AÇÕES	**ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA**	**R$ 64.898.021,75**	**R$ 432.383.815,97**	**15,01%**	15%
	AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R$ 69.618.759,62	R$ 1.166.023.248,50	5,97%	
	BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R$ 111.217.961,13	R$ 802.454.434,95	13,86%	
	BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R$ 50.463.329,61	R$ 1.302.352.358,50	3,87%	
	BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	**R$ 97.284.002,91**	**R$ 626.989.168,61**	**15,52%**	
	BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 38.110.685,21	R$ 261.363.542,17	14,58%	
	BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R$ 183.369.971,07	R$ 1.324.436.773,75	13,85%	
	CAIXA FIC FIA BRASIL AÇOES LIVRE QUANTITATIVO	R$ 33.546.703,15	R$ 684.321.543,81	4,90%	
	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇOES	R$ 18.008.050,77	R$ 119.695.725,10	15,04%	
	ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R$ 82.100.271,56	R$ 624.172.990,30	13,15%	
	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R$ 47.668.948,98	R$ 1.495.048.092,10	3,19%	
	ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R$ 66.252.649,94	R$ 484.265.022,12	13,68%	
	OCCAM FIC FIA	R$ 97.619.838,10	R$ 743.764.993,45	13,13%	
	VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	**R$ 97.219.273,95**	**R$ 642.219.135,91**	**15,14%**	
	GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R$ 92.712.511,40	R$ 1.711.519.705,62	5,42%	
	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R$ 40.845.620,93	R$ 496.748.907,37	8,22%	
	TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA	R$ 51.278.462,26	R$ 1.054.966.556,39	4,86%	
	TARPON GT 30 FIC FIA	R$ 89.156.002,70	R$ 1.772.465.430,71	5,03%	
	TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA	R$ 5.221.211,81	R$ 813.185.802,30	0,64%	
	CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	R$ 40.781.134,71	R$ 1.226.062.847,62	3,33%	
	CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA	R$ 14.001.021,48	R$ 721.013.694,58	1,94%	
INVEST NO EXTERIOR - FI	BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R$ 27.453.000,51	R$ 1.238.585.556,92	2,22%	15%
	GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R$ 32.065.205,87	R$ 102.584.180.402,87	0,03%	
	GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R$ 13.605.636,51	R$ 13.144.537.893,01	0,10%	
	SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R$ 44.200.272,98	R$ 555.172.942,68	7,96%	
	SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R$ 24.778.444,02	R$ 24.715.857.622,82	0,10%	
FIA - BDR	BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R$ 61.057.682,53	R$ 1.202.637.787,52	5,08%	15%
	ITAU BDR NIVEL 1 AÇÕES	R$ 31.440.200,52	R$ 243.264.190,27	12,92%	
	SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R$ 28.825.195,72	R$ 624.028.529,44	4,62%	

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

FUNDOS MULTIMERCADO	SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R$ 36.203.624,08	R$ 520.571.054,03	6,95%	15%
	BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R$ 17.416.431,83	R$ 486.158.774,15	3,58%	
	FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV	R$ 15.898.167,25	R$ 114.510.305,81	13,88%	
	CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP	R$ 19.139.102,40	R$ 183.802.266,19	10,41%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO	R$ 10.596.391,47	R$ 166.159.454,23	6,38%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM	R$ 33.232.616,05	R$ 228.305.649,03	14,56%	
	RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM	R$ 15.928.360,81	R$ 134.074.924,65	11,88%	
FIP	BTG ECONOMIA REAL FIP	R$ 40.886.351,99	R$ 3.044.104.596,40	1,34%	15%
	KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP	R$ 27.285.165,75	R$ 545.636.534,39	5,00%	
	BTG PACTUAL CLA ECONOMIA REAL II FIP MULT	R$ 6.604.064,57	R$ 121.751.142,70	5,42%	
	CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT	R$ 1.534.714,24	R$ 29.556.133,16	5,19%	
	PÁTRIA PRIVATE EQUITY VII ADVISORY FIP	R$ 21.792.317,51	R$ 183.802.266,19	11,86%	
	BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R$ 22.791.084,44	R$ 476.459.434,99	4,78%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO		R$ 3.840.537.276,39			

Quadro 49.

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

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

CONTROLE DE PRAZO DE DESENQUADRAMENTO	DT. DESENQ.	EM 17.11.23	PRAZO (180 DIAS)	MEDIDA TOMADA
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	21/08/2023	89 DIAS	16/02/2024	ANALISE DE EVOLUÇÃO DE COTAS
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇOES	30/10/2023	19 DIAS	27/04/2024	ANALISE DE EVOLUÇÃO DE COTAS
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	30/10/2023	19 DIAS	27/04/2024	ANALISE DE EVOLUÇÃO DE COTAS
BRADESCO FI MID SMALL CAPS	19/06/2023	152 DIAS	15/12/2023	REUNIÃO COM A INST. FINAN. 14.11.23

Quadro 50.

Nota 3: Em relação ao fundo Itau Small Cap Valuation, que se encontrava desenquadrado até o relatório anterior, informa-se que houveram novos aportes, através de outros investidores, trazendo o fundo para dentro do limite de 15% do PL, conforme previsto em legislação especifica.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/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 SETEMBRO/2023 EM R$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (OUTUBRO/2023)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 4.963/21
BB DTVM S.A	R$ 1.494.134,20	R$ 640.434.879,58	0,0429%	5%
CAIXA	R$ 501.666,97	R$ 687.264.875,32	0,1370%	
ITAU	R$ 848.754,38	R$ 389.743.374,66	0,0459%	
SAFRA	R$ 101.942,08	R$ 217.220.004,54	0,2131%	
BRADESCO	R$ 635.056,51	R$ 266.163.830,16	0,0419%	
ICATÚ	R$ 43.925,75	R$ 82.100.271,56	0,1869%	
BTG PACTUAL	R$ 330.540,05	R$ 371.831.386,15	0,1125%	
SANTANDER	R$ 322.208,25	R$ 80.380.442,38	0,0249%	
VINCI	R$ 51.206,47	R$ 139.599.609,12	0,2726%	
OCCAM	R$ 5.498,52	R$ 97.619.838,10	1,7754%	
PLURAL INVEST	R$ 59.673,35	R$ 45.670.842,38	0,0765%	
AZ QUEST	R$ 21.423,65	R$ 69.618.759,62	0,3250%	
BC GESTAO	R$ 3.331,58	R$ 38.110.685,21	1,1439%	
ARX	R$ 27.589,37	R$ 64.898.021,75	0,2352%	
SCHRODER	R$ 24.728,03	R$ 24.778.444,02	0,1002%	
DAYCOVAL	R$ 13.780,20	R$ 18.008.050,77	0,1307%	
GUEPARDO	R$ 3.316,76	R$ 92.712.511,40	2,7953%	
TRIGONO	R$ 3.409,47	R$ 56.499.674,07	1,6571%	
TARPON	R$ 6.391,98	R$ 89.156.002,70	1,3948%	
RIO BRAVO	R$ 9.806,59	R$ 59.757.368,33	0,6094%	
PORTO SEGURO	R$ 23.334,69	R$ 99.957.569,57	0,4284%	
CONSTANCIA	R$ 1.835,83	R$ 40.781.134,71	2,2214%	
BNP PARIBAS	R$ 71.997,92	R$ 105.151.195,55	0,1460%	
KINEA	R$ 112.176,78	R$ 27.285.165,75	0,0243%	
PATRIA INVEST	R$ 46.967,41	R$ 21.792.317,51	0,0464%	
CLARITAS	R$ 7.147,07	R$ 14.001.021,48	0,1959%	

Quadro 51.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

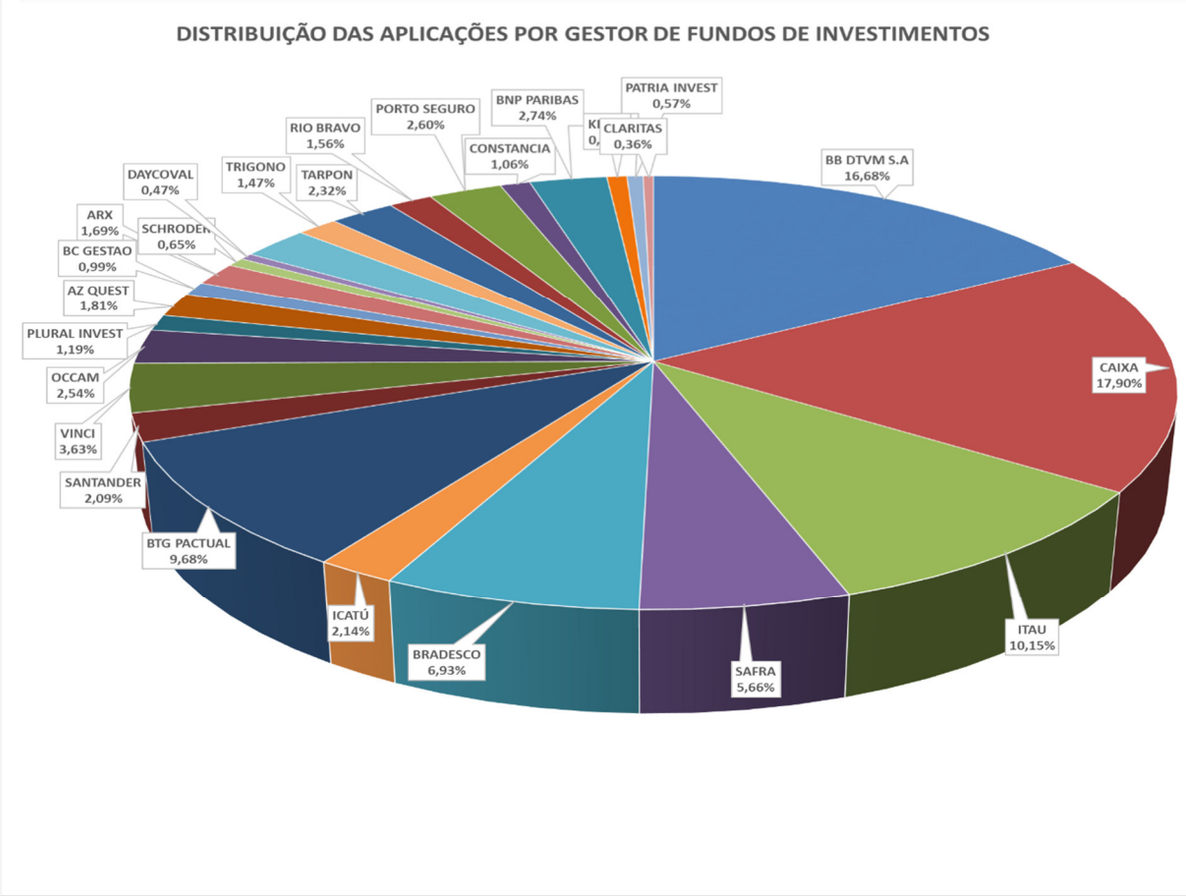

Gráfico 11.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R$	3.840.537.276,41
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R$	3.753.311.110,82
TÍTULOS - CVS	R$	5.699.190,22
IMÓVEIS	R$	65.484.778,63
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R$	484.403,83
TOTAL	**R$**	**7.665.516.759,91**

Quadro 52.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

Fundação AMAZONPREV

Relatório de Investimentos – Outubro/2023

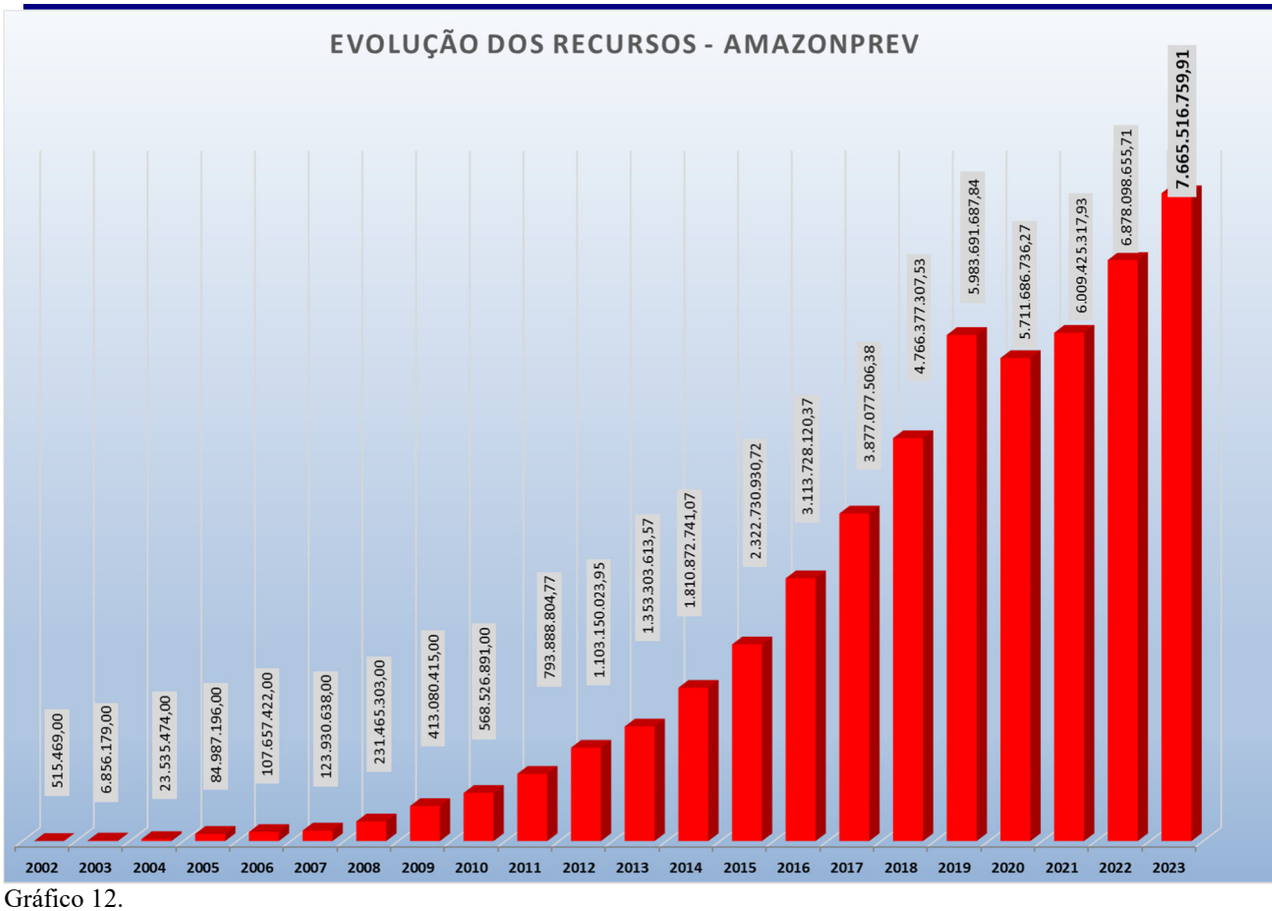

Gráfico 12.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV/EXECUTIVO	Novos Recursos Executivo: Aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2023
	Recursos Atuais: Resgatar R$100 milhoes do fundo CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP, bem como, R$100 milhoes do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2, aplicando o montante no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM, para fins de aquisiçao de NTN-B 2025, com taxa a partir de 5,80%.		15/12/2023
FPREV/ASSEMBLEIA	Novos Recursos Executivo: Aplicar no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2023
FPREV/TCE, TJA. MPE, DPE	Novos Recursos Executivo: Devem ser aplicados no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2023
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE, FPPM)	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2023
RECURSOS COMPREV	Novos recursos aplicar no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2023
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2023
REUNIÕES COM INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS	Programada reunião virtual com a LDB CONSULTORIA para fins de apresentação da ALM para o exercicio 2024	COMIV	24/11/2023
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, bem como, os recursos do Executivo alocados em fundos IMA.	COMIV / DIRAF / PRESI / GERAF / COFIN	15/12/2023
REUNIÃO COFIS/CONAD	Participação nas reuniões dos Conselhos Fiscal e de Administração, conforme definido nos Normativos Internos.	COMIV / DIRAF / PRESI / GERAF / COFIN	29 e 30/11/2023
PREENCHIMENTO E ENVIO DE INFORMAÇÕES - CADPREV	Atualização das informações sobre a Carteira do RPPS, via sistema DAIR/CADPREV, referrete ao mês de outrubro/2023	COMIV / DIRAF / PRESI / GERAF / COFIN	30/11/2023
PLANO DE APLICAÇÕES E INVESTIMENTOS	Versão Inicial aprovada pelo Comitê. Aguardando a aprovação do CODIR e COFIS.	COMIV / DIRAF / PRESI / COFIS / CONAD	01/12/2023

Quadro 53.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente **no dia 17 de novembro de 2023**, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de **outubro/2023**, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas movimentações dos recursos do RPPS.

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

Em outubro, dos 21 pregões do Ibovespa, 12 sessões foram de baixa, contra apenas nove pregões de alta. O IBOV fechou o mês com uma queda acumulada de 2,94%, aos 113.143,67 pontos, consolidando o índice como o terceiro pior investimento do período, atrás de empresas pagadoras de dividendos (representadas pelo IDIV) e Small Caps (empresas de baixa capitalização).

Por trás do cenário amargo, há três fatores determinantes que explicam a performance do principal indicador de ações da B3: o avanço dos títulos do Tesouro Americano, considerado o principal driver para a queda do IBOV, a guerra em Israel e os ruídos em relação ao fiscal no Brasil.

Sobre o Tesouro Americano, os "treasuries", como são conhecidos os papéis de dívida, se mantiveram em patamares elevados durante todo o mês. O título americano de prazo para 10 anos, uma das principais referências desse mercado de dívida, viu seus rendimentos subirem de 4,18% para o patamar recorde de 4,89%, segundo dados de Rivero e Investing. A escala dos "T-Notes" no mês ocorre na esteira da percepção de que os EUA terão juros altos por mais tempo.

Para conter a inflação no país, o Federal Reserve (Fed, banco central americano) passou a subir os juros, hoje entre 5,25% e 5,5% ao ano, maior nível em 22 anos. E a expectativa é de que a autoridade monetária continue a elevar as taxas, já que a economia americana não dá sinais de desaquecimento.

"A economia americana ainda está acelerando e os dados de emprego também estão fortes", afirma Bruce Barbosa, sócio fundador e analista de ações da Nord Research. "O Fed foi claro

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5

e sinalizou que precisaria manter os juros mais altos por mais tempo, até ameaçou subir a taxa um pouco. ”

Por aqui, entretanto, juros altos nos EUA significam diminuição da atratividade do mercado acionário. Isto porque as treasuries são consideradas os ativos mais seguros do mundo e, quando as taxas desses papéis sobem, os investidores globais engatam um movimento de evitar riscos, principalmente em países emergentes, e voarem para a renda fixa americana.

De acordo com a B3, entre 1 e 26 de outubro, o fluxo de investimento estrangeiro na bolsa brasileira estava negativo em R$ 2,5 bilhões. “Outubro foi mais um mês em que o ambiente fora do Brasil deu as cartas”, afirma José Cataldo, head de research da Ágora Investimentos. “Houve uma preponderância global sobre o ambiente local. ”

Em paralelo, a guerra entre Israel e o grupo terrorista Hamas, iniciada em 7 de outubro, também intensificou a aversão a risco no mês. No primeiro pregão após o início dos conflitos (9 de outubro), os barris de petróleo Brent e WTI avançaram 4,22% e 4,34%. Contudo, os impactos sobre os ativos devem se restringir ao curto prazo.

Essa também é a visão de Gabriel Bassotto, analista chefe de ações do Simpla Club. “Só vai ocorrer uma virada nesse fluxo de capital estrangeiro na B3 e no Ibovespa quando a situação nos EUA se acalmar. Enquanto as treasuries estiverem com uma volatilidade muito grande, não sabemos o que vai ser do Brasil e dos demais mercados emergentes”, afirma. “As taxas nos EUA precisam estabilizar, mesmo que em um patamar mais alto. ”

“Nos primeiros dias havia o receio de que o conflito escalasse e tomasse uma proporção maior, envolvendo outros países do Oriente Médio, como o caso do Irã (produtor de petróleo) ”, afirma Bassotto. “Como vimos, o conflito não escalou e até o temor que em relação do impacto no petróleo, já está se dissipando. ”

O último golpe ao Ibovespa em outubro ocorreu há três dias do fim do mês, quando o Presidente da República declarou que dificilmente o governo iria conseguir entregar a meta fiscal de déficit zero no ano que vem, prometida no Arcabouço Fiscal.

Na data da declaração, o IBOV fechou em baixa de 1,29%. “O Presidente deveria dar uma sinalização de que o País tem uma meta. Só que ele detonou essa meta e descredibilizou seu ministro da Fazenda, Fernando Haddad (PT)", diz Barbosa, da Nord Research. “A equipe econômica vinha trabalhando para convencer o mercado de que a meta de déficit zero era possível. Se o mercado já não acreditava antes, agora vai acreditar menos ainda. ”

Para Barbosa, o principal efeito dessa perspectiva de não cumprimento da meta é o avanço dos juros futuros e das perspectivas para a inflação. Juros e inflação mais altos significam

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJl5

também maiores dificuldades para a população tomar empréstimos e das empresas financiarem suas atividades. Essa situação, com os títulos de dívida dos EUA em alta, são uma combinação danosa para a bolsa brasileira.

Cataldo, da Ágora, e Sene, analista da Nova Futura, também recomendam uma carteira mais resiliente aos possíveis solavancos do mercado nos próximos meses. “É importante seletividade na escolha dos ativos”, diz Cataldo. “O momento é de manter uma carteira equilibrada, um pouco mais defensiva, e composta por ativos de qualidade. Oportunidades mais curtas podem surgir, e a diversificação é sempre o melhor caminho”, afirma Sene.

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

Todas as operações efetuadas foram devidamente autorizadas pela Diretoria, com registro nas Atas de Reunião do Comitê de 17 de outubro de 2023.

Assinado Eletronicamente
Claudinei Soares
Coordenador

Assinado Eletronicamente
Bruno Barroso
Secretário

Assinado Eletronicamente
Bruno Novo
Membro

Assinado Eletronicamente
Leonardo Cavalcanti
Membro

Assinado Eletronicamente
Wellington Guimaraes
Membro

Assinado Eletronicamente
André Bentes
Membro

Assinado Eletronicamente
Augusto Netto
Membro

Assinado Eletronicamente
Nuno Ponce
Membro

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/11/2023 13:13:44
Documento Assinado por: AUGUSTO SAMPAIO DE ARAUJO NETTO em 21/11/2023 13:13:58
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 21/11/2023 13:13:50
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/11/2023 12:35:29
Documento Assinado por: NUNO PONCE DE LEAO GONCALVES em 21/11/2023 12:35:36
Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/11/2023 12:36:20
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/11/2023 13:02:57
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/11/2023 13:01:57
Documento assinado eletronicamente 409229/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar
e valide o código: NDA5MJI5