

Relatório de Investimentos – Abril/2023

Processo: **2023.A.04093**
Destino: **DIRAF / PRESI**
Assunto: **Relatório de Investimentos – Abril/2023**
Data: **15/05/2023**

RELATÓRIO N°. 022/2023/COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **abril/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 12);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 13 a 16);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (páginas 17 a 19);
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (páginas 20 a 22);
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (páginas 23 a 25)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 26 a 28);
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (páginas 29 a 30);
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 31 a 32);
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 33);
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 34 a 42);
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 43);
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 44);
- 14) Parecer do Comitê de Investimentos (página 45).

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:37

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1. SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

| FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|---------------------------|---------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BB PREVID TP VII | R\$ 8.136.449,71 | R\$ 8.209.684,87 | 0,9000 | 1,1511 | 0,9000 | 2,9800% | 4,1142% | 11,7836% |
| CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF | R\$ 55.783.264,18 | R\$ 56.067.829,33 | 1,3300 | 1,2700 | 0,5100 | 3,1402% | 4,5636% | 8,3100% |
| SAFRA SOBERANO REGIM PROP DI | R\$ 81.389.423,95 | R\$ 82.112.044,07 | 0,9000 | 1,1600 | 0,8900 | 2,9789% | 4,1219% | 13,2972% |
| TOTAL art. 7º, inciso I, "b" | R\$ 145.309.137,84 | R\$ 146.389.558,27 | | | | | | |
| BRDESCO MAXI PODER PUBLICO | R\$ 1.561.889,84 | R\$ 7.341.331,70 | 0,8700 | 1,1100 | 0,8500 | 2,8566% | 3,9468% | 12,6952% |
| CAIXA FI BRASIL REFERENCIADO DI LP | R\$ 10.968.773,49 | R\$ 11.069.480,07 | 0,7994 | 1,1508 | 0,9181 | 2,8955% | 4,0214% | 13,3741% |
| ITAU SOBERANO SIMPLES FIC | R\$ 49.130.607,93 | R\$ 49.567.206,25 | 0,9200 | 1,1600 | 0,8900 | 2,9993% | 4,1529% | 13,2860% |
| TOTAL art. 7º, inciso III, "a" | R\$ 61.661.271,26 | R\$ 67.978.018,02 | | | | | | |
| SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST | R\$ 101.691.218,01 | R\$ 91.781.307,64 | 0,3073 | 0,8456 | 0,6296 | 1,7924% | 1,7101% | 11,3504% |
| ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI | R\$ 116.683.104,16 | R\$ 92.614.467,00 | 0,7300 | 1,1700 | 0,9200 | 2,8461% | 4,0597% | 14,0048% |
| BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP | R\$ 99.274.494,18 | R\$ 99.953.444,40 | 0,0800 | 0,7500 | 0,6800 | 1,5162% | 1,1109% | 11,1188% |
| MAG CRED PRIV FI RF LP | R\$ 56.523.652,96 | R\$ 56.712.123,77 | (0,0900) | 0,6200 | 0,3300 | 0,8612% | 0,3771% | 10,0463% |
| PORTO SEGURO FI REFER DI CRED PRIV | R\$ 115.673.979,00 | R\$ 92.577.638,27 | 0,6095 | 1,0276 | 0,8711 | 2,5288% | 2,9267% | 12,4634% |
| BNP PARIBAS MATCH DI FI RF REF CP | R\$ 68.168.583,03 | R\$ 68.786.133,72 | 0,9039 | 1,1794 | 0,9059 | 3,0189% | 4,2043% | 12,5706% |
| RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF | R\$ 11.480.140,45 | R\$ 11.542.742,29 | 0,1500 | 0,7800 | 0,5500 | 1,4863% | 2,5722% | NC |
| TOTAL art 7º, inciso V, "b" | R\$ 569.495.171,79 | R\$ 513.967.857,09 | | | | | | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 776.465.580,89 | R\$ 728.335.433,38 | | | | | | |

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 COMIV nº. 197/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria: **3.1. FPREV EXECUTIVO: a) Novos Recursos:** Aplicar os recursos no fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97). A opção por esse ativo deve-se a sugestão trazida, para análise e discussão no Comitê, pelo Sr. Leonardo Cavalcanti, considerando as dificuldades encontradas, pelo financeiro, no momento de resgate dos recursos, principalmente para operações de aquisições de Títulos Público; **b) Recursos atuais: 1) Zerar** os recursos aplicado no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), direcionando para o fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97), **2) Migrar** R\$ 10 milhões dos recursos aplicado no fundo SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST (17.138.474/0001-05) - rentabilidade obtida desde a aplicação: 14,46%; **3) Migrar** R\$ 10 milhões dos recursos aplicado no fundo ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI (09.093.883/0001-04) - rentabilidade obtida desde a aplicação: 15,84%; **4) Migrar** R\$ 10 milhões dos recursos aplicado no fundo PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP (18.719.154/0001-01) - rentabilidade obtida desde a aplicação: 11,53%

Nota 3: Registra-se a aquisição de Títulos Públicos Federais no volume de **R\$ 99.992.774,19** (noventa e nove milhões, novecentos e noventa e dois mil, setecentos e setenta e quatro reais e dezenove centavos) em **abril/2023**, com recursos disponíveis nos fundos indexados ao CDI, conforme estratégia aprovada na Política de Investimentos, devidamente aprovada pelos Conselhos, para o exercício/2023.

Nota 4: A opção por esse ativo justifica-se que, com base no cenário de incertezas fiscais para 2023, ocasionando na abertura da curva de juros, poderá realizar a aquisição de Títulos Públicos indexados à inflação, de forma a cumprir às orientações do Estudo ALM 2023, completando a Carteira de Títulos com vencimentos a partir de 2024 a 2045, sempre com taxas de juros que superem a meta atuarial. Além disso, devido a característica do papel de alta liquidez, deve otimizar as operações de aquisições de Títulos Públicos. Com cenário interno e externo cada vez mais incerto, a volatilidade dos ativos tem impactado



Relatório de Investimentos – Abril/2023

os resultados, e aumentar a exposição em Renda Fixa para acima de 80% da carteira poderá melhorar o resultado da Amazonprev.

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

| FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|-----------------------------|-----------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|-----------|------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 59.821.435,38 | R\$ 60.369.974,14 | (9,3900) | (3,2400) | 0,9200 | -11,5192% | -9,5283% | -13,1957% |
| AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 66.486.299,63 | R\$ 67.651.606,22 | (5,1100) | (2,9700) | 1,7500 | -6,3170% | -3,8250% | -11,6348% |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 90.881.635,92 | R\$ 92.022.094,47 | (7,3365) | (3,4033) | 1,2548 | -9,3669% | -6,3426% | -9,2831% |
| BB AÇÕES SELEÇÃO FATOR FIC FI | R\$ 45.800.847,91 | R\$ 46.599.794,37 | (8,5053) | (3,7071) | 1,7443 | -10,3603% | -6,3646% | -9,3850% |
| BRADESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 101.009.487,13 | R\$ 100.205.329,57 | (8,7400) | (4,6100) | (0,8000) | -13,6435% | -10,7506% | -19,1197% |
| BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES | R\$ 36.145.842,25 | R\$ 37.665.720,97 | (4,7800) | (2,5800) | 4,2000 | -3,3406% | -1,5428% | -5,2601% |
| BTG ABSOLUTO FIQ FIA | R\$ 171.191.079,37 | R\$ 167.660.623,96 | (6,2900) | (6,0900) | (2,0600) | -13,8098% | -9,7942% | -12,1142% |
| CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT | R\$ 11.655.768,56 | R\$ 11.992.640,49 | (5,8467) | (2,5283) | 2,8902 | -5,5748% | -2,4549% | -4,3506% |
| DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | R\$ 16.940.473,77 | R\$ 16.959.073,50 | (7,8619) | (3,5072) | 0,1098 | -10,9957% | -7,5924% | -7,6751% |
| ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 75.289.440,28 | R\$ 75.593.676,02 | (6,9000) | (3,2000) | 0,4000 | -9,5187% | -6,4966% | -4,8704% |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC | R\$ 47.667.561,92 | R\$ 48.299.535,24 | (6,8000) | (3,9300) | 1,3300 | -9,2719% | -7,0763% | -1,2773% |
| ITAU SMALL CAPS VALUATION | R\$ 63.110.881,28 | R\$ 64.736.977,49 | (8,6000) | (2,3900) | 2,5800 | -8,4827% | -6,3870% | -15,4944% |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 83.958.027,63 | R\$ 84.914.576,29 | (6,4400) | (2,8000) | 1,1400 | -8,0230% | -5,4936% | -3,2180% |
| VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA | R\$ 86.978.179,33 | R\$ 88.623.908,59 | (6,4700) | (3,3700) | 1,8900 | -7,9138% | -4,9302% | -9,9007% |
| GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 56.212.852,81 | R\$ 59.536.751,37 | (3,6874) | (1,0370) | 5,9131 | 0,9498% | 0,0349% | 14,4110% |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA | R\$ 32.522.099,33 | R\$ 33.118.335,28 | (6,7000) | (3,4000) | 1,8300 | -8,2229% | -5,9927% | -7,0650% |
| TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA | R\$ 38.515.579,21 | R\$ 36.898.851,39 | (4,0000) | (6,3100) | (4,2000) | -13,8352% | -10,9314% | -3,7230% |
| TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA | R\$ 4.573.383,87 | R\$ 4.438.919,26 | (4,1900) | (4,5600) | (2,9400) | -11,2473% | -6,6055% | 2,1369% |
| TARPON GT 30 FIC FIA | R\$ 57.513.684,05 | R\$ 60.140.861,77 | (2,5289) | (4,0745) | 4,5679 | -2,2294% | 0,0677% | 6,8425% |
| 4UM SMALL CAPS FIA | R\$ 34.575.271,25 | R\$ 36.152.574,95 | (4,4500) | (9,9300) | 4,5600 | -10,0137% | -9,1400% | -11,2500% |
| 4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA | R\$ 4.059.673,89 | R\$ 4.166.624,46 | (6,2400) | (0,4000) | 2,6300 | -4,1590% | -0,3700% | -0,2800% |
| CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA | R\$ 37.911.854,51 | R\$ 39.048.412,73 | (6,1600) | (2,8200) | 3,0000 | -6,0705% | -2,4730% | -6,5465% |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA | R\$ 12.945.074,01 | R\$ 13.057.834,21 | (7,1100) | (5,7600) | 0,8700 | -11,6989% | -7,4339% | -9,5837% |
| TOTAL art. 8º, inciso I | R\$ 1.235.766.433,29 | R\$ 1.249.854.696,74 | | | | | | |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | R\$ 1.235.766.433,29 | R\$ 1.249.854.696,74 | | | | | | |

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.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|--|---------------------------|---------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|----------|------------------|--|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA | R\$ 32.916.373,26 | R\$ 33.242.048,05 | (0,2519) | 2,0535 | (2,0486) | -0,2889% | -0,6321% | -1,5569% | |
| GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE | R\$ 14.220.783,15 | R\$ 13.239.782,87 | 0,7117 | (1,2604) | (6,8984) | -7,4176% | 3,1218% | -27,4351% | |
| SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC | R\$ 45.194.661,58 | R\$ 45.133.126,12 | 0,4458 | (1,4323) | (0,1362) | -1,1277% | 0,7657% | 1,2717% | |
| SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA | R\$ 25.809.351,34 | R\$ 25.783.514,86 | 0,3500 | 0,8700 | (0,1000) | 1,1218% | 2,8813% | 3,8669% | |
| TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exte | R\$ 118.141.169,33 | R\$ 117.398.471,90 | | | | | | | |
| BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I | R\$ 58.648.226,57 | R\$ 58.327.235,17 | 0,3785 | 1,0893 | (0,5473) | 0,9166% | 2,8758% | 1,7218% | |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR | R\$ 27.086.095,71 | R\$ 27.292.532,63 | 0,2300 | 2,0600 | 0,7600 | 3,0722% | 5,7005% | 1,7864% | |
| ITAU BDR NIVEL I AÇÕES FIC | R\$ 30.030.953,07 | R\$ 30.513.223,78 | (0,8100) | (1,6600) | 1,6100 | -0,8861% | -0,7374% | 2,9774% | |
| TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I | R\$ 115.765.275,35 | R\$ 116.132.991,58 | | | | | | | |
| TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | R\$ 233.906.444,68 | R\$ 233.531.463,48 | | | | | | | |

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 (%) | | | | | | |
|--|-----------------------------|-----------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|-----------|------------------|--|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT | R\$ 16.312.507,03 | R\$ 16.642.967,02 | (1,7400) | 2,0100 | 2,0300 | 2,2698% | 8,7952% | 12,9680% | |
| FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV FIM | R\$ 15.199.886,93 | R\$ 15.236.173,46 | (2,1723) | (0,7086) | 0,2387 | -2,6336% | -0,9528% | -8,4786% | |
| CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP | R\$ 17.480.820,69 | R\$ 17.724.988,19 | 0,3305 | 0,4102 | 1,3968 | 2,1492% | 3,7651% | NC | |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MM | R\$ 15.163.408,23 | R\$ 15.280.810,34 | (2,4000) | (0,2900) | 0,7700 | -1,9337% | -0,2960% | 4,5828% | |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM | R\$ 31.084.802,04 | R\$ 31.279.158,83 | 0,9000 | 1,5700 | 0,6300 | 3,1298% | 3,9651% | NC | |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MM | R\$ 10.542.667,23 | R\$ 10.457.953,28 | 0,2800 | 1,9700 | (0,8000) | 1,4375% | 1,6505% | 4,6699% | |
| TOTAL art. 10º, inciso I | R\$ 105.784.092,15 | R\$ 106.622.051,12 | | | | | | | |
| BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ 41.142.984,00 | R\$ 41.111.376,00 | (0,0900) | 17,0600 | (0,0800) | 16,8611% | 16,7330% | -2,3348% | |
| BTG PACTUAL IMPACTO FIP | R\$ 21.352.741,81 | R\$ 21.437.289,23 | (0,0400) | 11,3700 | 0,4000 | 11,7708% | 11,4689% | 5,2179% | |
| CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT | R\$ 1.434.608,42 | R\$ 1.387.218,10 | 0,3400 | (0,6100) | (3,3000) | -3,5631% | 10,4010% | NC | |
| KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP | R\$ 15.131.464,79 | R\$ 14.795.514,65 | (1,6350) | (7,9200) | (2,2200) | -11,4363% | -12,2979% | 4,8528% | |
| TOTAL art. 10º, inciso II | R\$ 79.061.799,02 | R\$ 78.731.397,98 | | | | | | | |
| TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS | R\$ 184.845.891,17 | R\$ 185.353.449,10 | | | | | | | |
| TOTAL GERAL | R\$ 2.430.984.350,03 | R\$ 2.397.075.042,70 | | | | | | | |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 10.000.000,00 | R\$ 1,00 | | | | | | | |
| VALORES EM TRÂNSITO | R\$ - | R\$ - | | | | | | | |
| TOTAL RECURSOS | R\$ 2.440.984.350,03 | R\$ 2.397.075.043,70 | | | | | | | |

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.



Relatório de Investimentos – Abril/2023

2.5 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

| INSTITUIÇÃO | fev/23 | mar/23 | abr/23 |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| BRADESCO | R\$ 108.360.250,10 | R\$ 102.571.376,97 | R\$ 107.546.661,27 |
| BTG | R\$ 349.631.637,05 | R\$ 349.273.806,39 | R\$ 346.805.700,61 |
| ITAÚ | R\$ 343.435.941,55 | R\$ 306.623.108,36 | R\$ 285.731.409,76 |
| BANCO DO BRASIL | R\$ 207.707.746,90 | R\$ 203.467.160,11 | R\$ 205.158.808,88 |
| CAIXA | R\$ 143.846.583,91 | R\$ 111.088.513,85 | R\$ 112.091.111,54 |
| ICATU | R\$ 138.027.532,38 | R\$ 75.289.440,28 | R\$ 75.593.676,02 |
| SANTANDER | R\$ 167.029.455,26 | R\$ 146.885.879,59 | R\$ 136.914.433,76 |
| PORTO | R\$ 148.247.050,55 | R\$ 115.673.979,00 | R\$ 92.577.638,27 |
| VINCI | R\$ 125.122.371,67 | R\$ 120.934.887,08 | R\$ 123.129.461,97 |
| SAFRA | R\$ 106.993.004,34 | R\$ 108.475.519,66 | R\$ 109.404.576,70 |
| OCCAM | R\$ 86.374.790,91 | R\$ 83.958.027,63 | R\$ 84.914.576,29 |
| BNP | R\$ 74.307.121,78 | R\$ 68.168.583,03 | R\$ 68.786.133,72 |
| AZ QUEST | R\$ 68.522.412,20 | R\$ 66.486.299,63 | R\$ 67.651.606,22 |
| RIO BRAVO | R\$ 68.733.343,97 | R\$ 68.271.017,95 | R\$ 68.560.664,74 |
| ARX | R\$ 61.822.879,25 | R\$ 59.821.435,38 | R\$ 60.369.974,14 |
| MONGERAL | R\$ 62.134.843,84 | R\$ 56.523.652,96 | R\$ 56.712.123,77 |
| TARPON | R\$ 59.956.608,42 | R\$ 57.513.684,05 | R\$ 60.140.861,77 |
| GUEPARDO | R\$ 56.801.889,09 | R\$ 56.212.852,81 | R\$ 59.536.751,37 |
| TRÍGONO | R\$ 45.901.136,76 | R\$ 43.088.963,08 | R\$ 41.337.770,65 |
| PLURAL | R\$ 46.656.337,69 | R\$ 47.137.156,41 | R\$ 46.481.830,92 |
| 4UM | R\$ 42.463.183,92 | R\$ 38.634.945,14 | R\$ 40.319.199,41 |
| CONSTANCIA | R\$ 39.012.161,46 | R\$ 37.911.854,51 | R\$ 39.048.412,73 |
| BRASIL CAPITAL | R\$ 37.102.878,96 | R\$ 36.145.842,25 | R\$ 37.665.720,97 |
| SCHRODER | R\$ 25.585.616,92 | R\$ 25.809.351,34 | R\$ 25.783.514,86 |
| DAYCOVAL | R\$ 17.556.207,17 | R\$ 16.940.473,77 | R\$ 16.959.073,50 |
| INTRAG | R\$ 16.432.953,05 | R\$ 15.131.464,79 | R\$ 14.795.514,65 |
| CLARITAS | R\$ 13.738.719,14 | R\$ 12.945.074,01 | R\$ 13.057.834,21 |
| TOTAL | R\$ 3.208.167.128,93 | R\$ 2.430.984.350,03 | R\$ 2.397.075.042,70 |

Quadro 5.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC ABRIL/2023

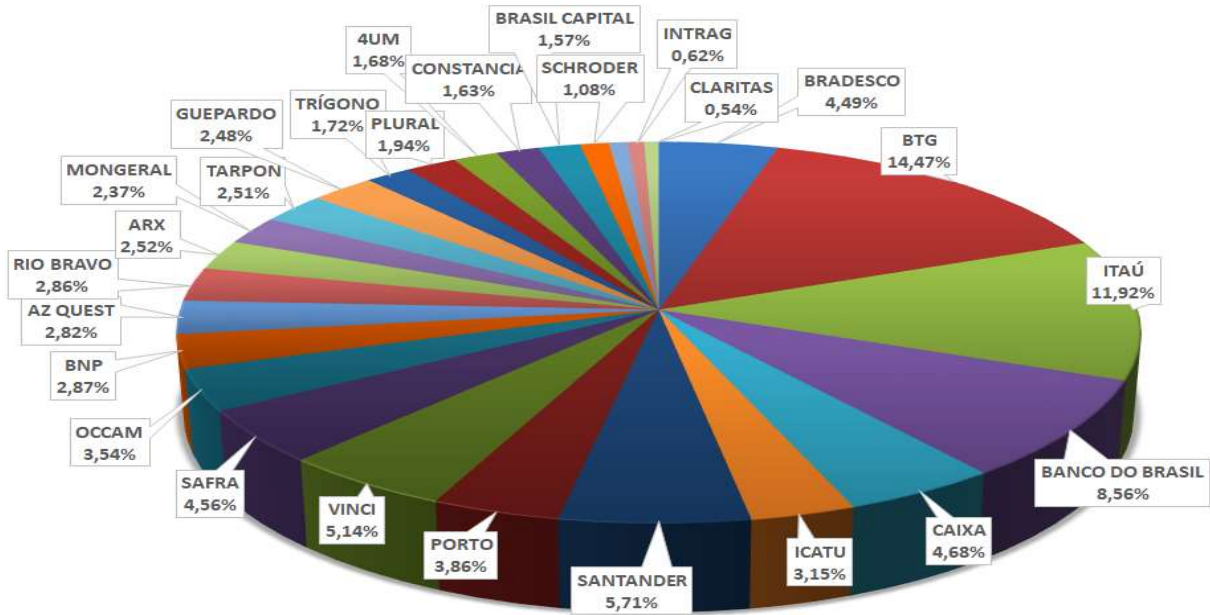


Gráfico 1.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

| | | | | | | | |
|------------|---------------------|------------|-------------------|---------------|---------|--------|------------------------|
| 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 |
| 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 | EXECUTIVO | 15/05/2045 | R\$ 80.001.923,16 | 4.159,1849840 | 6,1076% | 19.235 | BGC LIQUIDEZ |
| 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 | EXECUTIVO | 15/05/2045 | R\$ 19.990.851,03 | 4.164,7606320 | 6,1005% | 4.800 | BGC LIQUIDEZ |
| 24/04/2023 | ASSEMBLEIA | 15/05/2045 | R\$ 495.606,52 | 4.164,7606320 | 6,1005% | 119 | BGC LIQUIDEZ |
| 24/04/2023 | MINISTÉRIO PÚBLICO | 15/05/2045 | R\$ 3.519.222,73 | 4.164,7606320 | 6,1005% | 845 | 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 |

Quadro 6.

Nota: Referente as operações de compra de Títulos Públicos realizadas desde 2014 com a descrição do ativo e da instituição financeira contraparte. A custódia é realizada pela Instituição XP Investimentos.

2.7 SALDOS CVS – FPREV

| DESCRIÇÃO | SALDO | |
|--------------|-------------------------|-------------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| CVS - A | R\$ 803.540,19 | R\$ 803.540,19 |
| CVS - B | R\$ 5.198.579,70 | R\$ 5.198.579,70 |
| CVS - C | R\$ 104.236,86 | R\$ 104.236,86 |
| CVS - D | R\$ 570.093,48 | R\$ 570.093,48 |
| TOTAL | R\$ 6.676.450,23 | R\$ 6.676.450,23 |

Quadro 7.

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

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 |
| TOTAL | R\$ 79.785,13 | R\$ 592.170,18 | R\$ 671.955,31 |

Quadro 8.

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

| RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2023 | | | |
|--|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
| MÊS | UEA | SEAS | TOTAL |
| jan/23 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| fev/23 | R\$ - | R\$ 200.728,73 | R\$ 200.728,73 |
| mar/22 | R\$ 87.271,44 | R\$ 100.364,40 | R\$ 187.635,84 |
| abr/22 | R\$ 43.635,72 | R\$ 100.364,40 | R\$ 144.000,12 |
| TOTAL | R\$ 130.907,16 | R\$ 401.457,53 | R\$ 532.364,69 |

Quadro 9.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

| RECURSOS FPREV EXECUTIVO | SALDO | | % dos Recursos |
|----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|----------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO | R\$ 2.430.984.350,03 | R\$ 2.397.075.042,70 | 40,7636% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | R\$ 3.278.813.424,14 | R\$ 3.411.335.203,52 | 58,0117% |
| TÍTULOS CVS | R\$ 6.676.450,23 | R\$ 6.533.554,16 | 0,1111% |
| IMÓVEIS | R\$ 65.484.778,63 | R\$ 65.484.778,63 | 1,1136% |
| VALORES EM TRÂNSITO | R\$ - | R\$ - | 0,0000% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | R\$ 10.000.000,00 | R\$ 1,00 | 0,0000% |
| TOTAL | R\$ 5.791.959.003,03 | R\$ 5.880.428.580,01 | 100,00% |

Quadro 10.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

| Mês | Recursos FPREV Executivo | Evolução | | |
|---------------|-----------------------------|--------------|--------------|---------------|
| | | Mensal | Anual | 12 Meses |
| abr/22 | R\$ 5.227.351.195,97 | -1,75% | 1,72% | 7,37% |
| mai/22 | R\$ 5.288.544.931,25 | 1,17% | 2,91% | 6,07% |
| jun/22 | R\$ 5.200.480.011,20 | -1,67% | 1,20% | 3,00% |
| jul/22 | R\$ 5.345.100.326,41 | 2,78% | 4,01% | 5,73% |
| ago/22 | R\$ 5.480.240.218,85 | 2,53% | 6,64% | 8,98% |
| set/22 | R\$ 5.511.466.216,21 | 0,57% | 7,25% | 10,53% |
| out/22 | R\$ 5.705.500.023,14 | 3,52% | 11,02% | 15,76% |
| nov/22 | R\$ 5.675.963.312,47 | -0,52% | 10,45% | 14,00% |
| dez/22 | R\$ 5.780.297.494,50 | 1,84% | 12,48% | 12,48% |
| jan/23 | R\$ 5.771.604.745,47 | -0,15% | -0,15% | 12,56% |
| fev/23 | R\$ 5.742.296.217,39 | -0,51% | -0,66% | 10,78% |
| mar/23 | R\$ 5.791.959.003,03 | 0,86% | 0,20% | 8,86% |
| abr/23 | R\$ 5.880.428.580,01 | 1,53% | 1,73% | 12,49% |

Quadro 11.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

| | |
|---|----------------------|
| Saldo dos Investimentos em 04/2022 | R\$ 5.227.351.195,97 |
|---|----------------------|

| Período | Receitas (R\$) | Despesas (R\$) | Resultado (R\$) |
|---------|--------------------|-------------------|-------------------|
| 05/2022 | R\$ 46.172.988,27 | R\$ 15.327.214,72 | R\$ 30.845.773,55 |
| 06/2022 | R\$ 47.103.866,59 | R\$ 10.942.355,40 | R\$ 36.161.511,19 |
| 07/2022 | R\$ 47.549.359,29 | R\$ 10.900.524,10 | R\$ 36.648.835,19 |
| 08/2022 | R\$ 48.163.488,37 | R\$ 12.302.988,95 | R\$ 35.860.499,42 |
| 09/2022 | R\$ 48.483.431,53 | R\$ 10.781.769,44 | R\$ 37.701.662,09 |
| 10/2022 | R\$ 47.905.531,55 | R\$ 10.820.436,66 | R\$ 37.085.094,89 |
| 11/2022 | R\$ 47.465.381,12 | R\$ 11.535.636,72 | R\$ 35.929.744,40 |
| 12/2022 | R\$ 110.680.756,99 | R\$ 16.540.401,56 | R\$ 94.140.355,43 |
| 01/2023 | R\$ 33.677.075,44 | R\$ 13.128.151,27 | R\$ 20.548.924,17 |
| 02/2023 | R\$ 48.396.223,00 | R\$ 19.336.309,60 | R\$ 29.059.913,40 |
| 03/2023 | R\$ 47.844.489,27 | R\$ 13.501.061,49 | R\$ 34.343.427,78 |
| 04/2023 | R\$ 48.529.359,82 | R\$ 12.897.196,53 | R\$ 35.632.163,29 |

| | |
|---|----------------------|
| Saldo dos Investimentos em 04/2023 | R\$ 5.880.428.579,01 |
|---|----------------------|

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) | 4,1847% | 2,7170% | 0,6100% |
| Juros | 5,1200% | 1,6783% | 0,4170% |
| Meta | 9,5190% | 4,4409% | 1,0295% |
| Rentabilidade em % | 3,4793% | -0,3343% | 0,9123% |
| Rentabilidade em R\$ | R\$ 189.119.478,24 | R\$ -19.453.344,13 | R\$ 52.837.412,69 |
| Resultado em % | -5,5147% | -4,5722% | -0,1161% |
| Resultado em R\$ | R\$ -328.065.849,25 | R\$ -277.846.147,86 | R\$ -6.791.587,20 |

Quadro 13.

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

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA | SALDOS | | VALORIZAÇÃO | | | | | |
|---------------------------------------|-------------------------|-------------------------|-------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC | R\$ 74.197,49 | R\$ 71.350,96 | 1.1400 | 2.4300 | 1.2300 | 4,8720% | 5,3963% | 9,8793% |
| TOTAL art. 7º, inciso I, "b" | R\$ 74.197,49 | R\$ 71.350,96 | | | | | | |
| SAFRA SOBERANO RP DI FIC REF | R\$ 58.763,53 | R\$ 59.285,26 | 0,9000 | 1,1600 | 0,8900 | 2,9789% | 2,9789% | NC |
| BRASESCO MAXI PODER PUBLICO | R\$ 573.724,05 | R\$ 316.559,63 | - | 1,1100 | 0,0085 | 1,1186% | 1,1186% | NC |
| ITAU SOBERANO SIMPLES FIC | R\$ - | R\$ 3.764,63 | - | - | - | 0,0000% | 0,0000% | NC |
| TOTAL art. 7º, inciso III, "a" | R\$ 632.487,58 | R\$ 379.609,52 | | | | | | |
| BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP | R\$ 1.053.253,63 | R\$ 1.060.456,97 | 0,0800 | 0,7500 | 0,6800 | 1,5162% | 1,1900% | 11,1900% |
| TOTAL art 7º, inciso V, "b" | R\$ 1.053.253,63 | R\$ 1.060.456,97 | | | | | | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 1.759.938,70 | R\$ 1.511.417,45 | | | | | | |

| FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL | SALDOS | | VALORIZAÇÃO | | | | | |
|--|-------------------------|-------------------------|-------------|----------|----------|-----------|----------|------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 433.427,81 | R\$ 435.179,25 | (6,9000) | (3,2000) | 0,4000 | -9,5187% | -6,4966% | -4,8704% |
| BTG ABSOLUTO FIQ FIA | R\$ 969.617,24 | R\$ 949.620,92 | (6,2900) | (6,0900) | (2,0600) | -13,8098% | -9,2500% | -11,5800% |
| CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT | R\$ 465.007,25 | R\$ 478.446,77 | (5,8467) | (2,5283) | 2,8902 | -5,5748% | -2,4549% | -4,3506% |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 880.724,18 | R\$ 890.758,43 | (6,4400) | (2,8000) | 1,1400 | -8,0230% | -5,4936% | -3,2180% |
| BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 96.566,51 | R\$ 100.626,99 | (4,7800) | (2,5800) | 4,2000 | -3,3406% | -1,5428% | -5,2601% |
| TOTAL art. 8º, inciso I | R\$ 2.845.342,99 | R\$ 2.854.632,36 | | | | | | |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | R\$ 2.845.342,99 | R\$ 2.854.632,36 | | | | | | |

| FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | SALDOS | | VALORIZAÇÃO | | | | | |
|--|-----------------------|-----------------------|-------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR | R\$ 966.227,15 | R\$ 973.591,26 | 0,2300 | 2,0600 | 0,7600 | 3,0722% | 5,7005% | 1,7864% |
| TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I | R\$ 966.227,15 | R\$ 973.591,26 | | | | | | |
| TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | R\$ 966.227,15 | R\$ 973.591,26 | | | | | | |

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------|--------|--------|-----------|----------|------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO | R\$ 452.725,08 | R\$ 461.665,59 | (1,7500) | 3,9900 | 1,9700 | 4,1829% | 10,8506% | 10,1776% |
| TOTAL art. 10º, inciso I | R\$ 452.725,08 | R\$ 461.665,59 | | | | | | |
| TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS | R\$ 452.725,08 | R\$ 461.665,59 | | | | | | |

| | | | | | | | | |
|--|-------------------------|-------------------------|--|--|--|--|--|--|
| TOTAL GERAL | R\$ 6.024.233,92 | R\$ 5.801.306,66 | | | | | | |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 855,54 | | | | | | | |
| VALORES EM TRANSITO | R\$ - | R\$ - | | | | | | |
| TOTAL DOS RECURSOS | R\$ 6.025.089,46 | R\$ 5.801.306,66 | | | | | | |

Quadro 14.

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

Nota 2: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. **195/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria: **3.2 FPREV ALE d) Recursos Atuais:** Zerar o fundo ITAÚ INST.ALOC. DINÂMICA FI FIC (21.838.150/0001-49) migrando o recurso para o fundo ITAU SOBERANO SIMPLES FIC (06.175.696/0001-73), operação com resgate parcial devido o recurso ter sofrido bloqueio judicial.

Nota 3: As movimentações neste mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. **197/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria: **3.2 FPREV ALE: a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97). Todos os membros foram favoráveis a movimentação; **b) Recursos atuais:** Zerar os



Relatório de Investimentos – Abril/2023

recursos aplicado no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), saldo aproximado de R\$ 3 milhões, direcionando para o fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97).

Nota 4: Registrar a Aquisição de Títulos Públicos Federais no volume de **R\$ 495.606,52** (quatrocentos e noventa e cinco mil, seiscentos e seis reais e cinquenta e dois centavos) em **abril/2023**, com recursos disponíveis nos fundos indexados ao CDI, conforme Estratégia aprovada na Política de Investimentos para 2023.

3.2 Total dos Recursos – ALE/FPREV

| RECURSOS ALE FPREV | SALDO | |
|---------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA | R\$ 1.759.938,70 | R\$ 1.511.417,45 |
| FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL | R\$ 2.845.342,99 | R\$ 2.854.632,36 |
| FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | R\$ 966.227,15 | R\$ 973.591,26 |
| FUNDOS ESTRUTURADOS | R\$ 452.725,08 | R\$ 461.665,59 |
| TÍTULOS PÚBLICOS | R\$ 14.926.555,43 | R\$ 15.569.766,11 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | R\$ - | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 20.950.789,35 | R\$ 21.371.072,77 |

Quadro 15

3.3 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

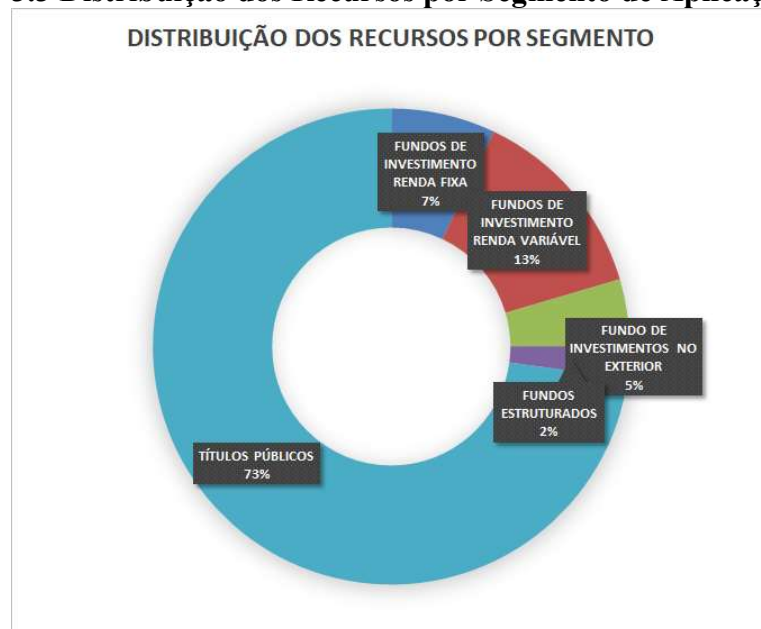


Gráfico 2.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

3.4 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

| Saldo dos Investimentos em 04/2022 | | R\$ 17.942.453,54 | |
|------------------------------------|----------------|-------------------|-----------------|
| Período | Receitas (R\$) | Despesas (R\$) | Resultado (R\$) |
| 05/2022 | R\$ 225.494,08 | R\$ 0,00 | R\$ 225.494,08 |
| 06/2022 | R\$ 206.676,04 | R\$ 0,00 | R\$ 206.676,04 |
| 07/2022 | R\$ 208.176,70 | R\$ 0,00 | R\$ 208.176,70 |
| 08/2022 | R\$ 195.200,20 | R\$ 0,00 | R\$ 195.200,20 |
| 09/2022 | R\$ 211.199,86 | R\$ 0,00 | R\$ 211.199,86 |
| 10/2022 | R\$ 209.483,44 | R\$ 0,00 | R\$ 209.483,44 |
| 11/2022 | R\$ 208.368,70 | R\$ 0,00 | R\$ 208.368,70 |
| 12/2022 | R\$ 215.348,54 | R\$ 0,00 | R\$ 215.348,54 |
| 01/2023 | R\$ 415.713,96 | R\$ 50.378,58 | R\$ 365.335,38 |
| 02/2023 | R\$ 206.662,34 | R\$ 10.022,51 | R\$ 196.639,83 |
| 03/2023 | R\$ 205.889,22 | R\$ 10.391,50 | R\$ 195.497,72 |
| 04/2023 | R\$ 206.002,88 | R\$ 12.482,71 | R\$ 193.520,17 |
| Saldo dos Investimentos em 04/2023 | | R\$ 21.371.072,77 | |

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) | 4,1847 % | 2,7170 % | 0,6100 % |
| Juros | 5,1200 % | 1,6783 % | 0,4170 % |
| Meta | 9,5190 % | 4,4409 % | 1,0295 % |
| Rentabilidade em % | 4,1707 % | 0,8657 % | 1,0824 % |
| Rentabilidade em R\$ | R\$ 797.678,57 | R\$ 178.868,18 | R\$ 226.763,25 |
| Resultado em % | -4,8834 % | -3,4232 % | +0,0523 % |
| Resultado em R\$ | R\$ -1.021.827,85 | R\$ -738.585,12 | R\$ +11.072,05 |

Quadro 16.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

| FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|---|--------------------------|--------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|-----------|------------------|--|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| BRDESCO MAXI PODER PUBLICO | R\$ - | R\$ 3.246.580,41 | - | - | - | 0,0000% | 0,0000% | 0,0000% | |
| TOTAL art. 7º, inciso III, "a" | R\$ - | R\$ 3.246.580,41 | | | | | | | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ - | R\$ 3.246.580,41 | | | | | | | |
| FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 1.139.517,23 | R\$ 1.187.432,23 | (4,7800) | (2,5800) | 4,2000 | -7,2367% | -1,5428% | -5,2601% | |
| BB AÇOES VALOR | R\$ 13.928.925,87 | R\$ 14.103.717,64 | (7,3365) | (3,4033) | 1,2548 | -10,4901% | -6,3426% | -9,2831% | |
| GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 6.497.261,69 | R\$ 6.881.448,54 | (3,6874) | (1,1144) | 5,9131 | -4,7608% | -0,0433% | 14,3215% | |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 5.633.608,81 | R\$ 5.697.793,51 | (6,4400) | (2,8000) | 1,1400 | -9,0597% | -5,4936% | -3,2100% | |
| TARPON GT INST FIC FIA | R\$ 6.510.337,01 | R\$ 6.807.723,85 | (2,5289) | (4,0745) | 4,5679 | -6,5004% | 0,0677% | 5,4376% | |
| TRIGONO FLAGSHIP INST FI FIA | R\$ 5.457.423,80 | R\$ 5.228.343,28 | (4,0000) | (6,3100) | (4,2000) | -10,0576% | -10,9314% | -3,7230% | |
| TOTAL art. 8º, inciso I - RENDA VARIÁVEL | R\$ 39.167.074,41 | R\$ 39.906.459,05 | | | | | | | |
| FUNDO DE INVESTIMENTO - FUNDOS ESTRUTURADOS | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO | R\$ 7.222.341,69 | R\$ 7.364.969,99 | (1,7500) | 3,9900 | 1,9700 | 2,1702% | 10,8506% | 10,1776% | |
| TOTAL art. 10º, inciso I | R\$ 7.222.341,69 | R\$ 7.364.969,99 | | | | | | | |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 4.483.430,03 | R\$ 1,00 | | | | | | | |
| VALORES EM TRÂNSITO | R\$ - | R\$ - | | | | | | | |
| TOTAL RECURSOS | R\$ 50.872.846,13 | R\$ 50.518.010,45 | | | | | | | |

Quadro 17.

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. 197/2023**, devidamente aprovada pela Diretoria: **3.3 OUTROS PODERES: MPE/DPE/TJA/TCE FPREV. a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97; **b) Recursos atuais:** Zerar os recursos aplicado no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), saldo aproximado de R\$ 91 milhões, direcionando para o fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97).

Nota 3: Realizadas novas aquisições de Títulos Públicos Federais, NTN B, **no valor total de R\$ 3.519.222,73** (três milhões, quinhentos e dezenove mil, duzentos e vinte e dois reais e setenta e três centavos), **em abril/2023**, com recursos disponíveis nos fundos indexados ao CDI, conforme Estratégia aprovada na Política de Investimentos para 2023.



Relatório de Investimentos – Abril/2023

4.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

| Saldo dos Investimentos em 04/2022 | | R\$ 200.636.573,73 | |
|------------------------------------|------------------|--------------------|------------------|
| Período | Receitas (R\$) | Despesas (R\$) | Resultado (R\$) |
| 05/2022 | R\$ 1.689.107,22 | R\$ 18.421,09 | R\$ 1.670.686,13 |
| 06/2022 | R\$ 1.652.239,90 | R\$ 34.635,86 | R\$ 1.617.604,04 |
| 07/2022 | R\$ 1.640.438,74 | R\$ 33.562,04 | R\$ 1.606.876,70 |
| 08/2022 | R\$ 1.630.533,84 | R\$ 33.562,04 | R\$ 1.596.971,80 |
| 09/2022 | R\$ 1.637.208,36 | R\$ 42.623,43 | R\$ 1.594.584,93 |
| 10/2022 | R\$ 1.621.262,66 | R\$ 46.725,64 | R\$ 1.574.537,02 |
| 11/2022 | R\$ 1.613.014,95 | R\$ 45.605,84 | R\$ 1.567.409,11 |
| 12/2022 | R\$ 1.611.566,90 | R\$ 89.462,79 | R\$ 1.522.104,11 |
| 01/2023 | R\$ 3.260.425,74 | R\$ 136.113,27 | R\$ 3.124.312,47 |
| 02/2023 | R\$ 1.613.129,15 | R\$ 145.358,74 | R\$ 1.467.770,41 |
| 03/2023 | R\$ 1.623.976,36 | R\$ 160.693,65 | R\$ 1.463.282,71 |
| 04/2023 | R\$ 2.424.596,60 | R\$ 178.605,05 | R\$ 2.245.991,55 |
| Saldo dos Investimentos em 04/2023 | | R\$ 239.586.362,02 | |

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) | 4,1847 % | 2,7170 % | 0,6100 % |
| Juros | 5,1200 % | 1,6783 % | 0,4170 % |
| Meta | 9,5190 % | 4,4409 % | 1,0295 % |
| Rentabilidade em % | 8,5360 % | 2,7896 % | 1,1575 % |
| Rentabilidade em R\$ | R\$ 17.897.657,31 | R\$ 6.369.824,65 | R\$ 2.715.704,22 |
| Resultado em % | -0,8975 % | -1,5811 % | +0,1267 % |
| Resultado em R\$ | R\$ -2.059.461,02 | R\$ -3.770.206,34 | R\$ +300.211,61 |

Quadro 18.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|--------------------------|--------------------------|-----------------|----------|--------|-----------|----------|------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRASESCO MAXI PODER PUBLICO | R\$ 4.768.961,30 | R\$ 6.054.899,26 | - | 1,1100 | 0,8500 | 1,1100% | 1,9694% | NC |
| TOTAL art. 7º, inciso III, "a" | R\$ 4.768.961,30 | R\$ 6.054.899,26 | | | | | | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 4.768.961,30 | R\$ 6.054.899,26 | | | | | | |
| FUNDOS DE AÇÕES | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 766.220,67 | R\$ 798.439,10 | (4,7800) | (2,5800) | 4,2000 | -5,5113% | -1,5428% | -5,2601% |
| CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA | R\$ 14.320,10 | R\$ 14.733,97 | (5,8467) | (2,5283) | 2,8902 | -5,1950% | -2,4549% | 5,6438% |
| GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 2.621.578,22 | R\$ 2.776.593,66 | (3,6874) | (1,3195) | 5,9131 | -5,8196% | -0,2507% | 7,1283% |
| TOTAL art. 8º, inciso I | R\$ 3.402.118,99 | R\$ 3.589.766,73 | | | | | | |
| FUNDO ESTRUTURADOS | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO | R\$ 3.601.973,36 | R\$ 3.673.105,89 | (1,7500) | 3,9900 | 1,9700 | 8,7091% | 10,8506% | 21,7092% |
| TOTAL art. 10º, inciso I | R\$ 3.601.973,36 | R\$ 3.673.105,89 | | | | | | |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 80,45 | R\$ 6.767,94 | | | | | | |
| VALORES EM TRÂNSITO | R\$ - | R\$ - | | | | | | |
| TOTAL RECURSOS | R\$ 11.773.134,10 | R\$ 13.324.539,82 | | | | | | |

Quadro 19.

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. 197/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria: **3.3 OUTROS PODERES: MPE/DPE/TJA/TCE FPREV. a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97); **b) Recursos atuais:** Zerar os recursos aplicado no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), saldo aproximado de R\$ 91 milhões, direcionando para o fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97).

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

| Saldo dos Investimentos em 04/2022 | | R\$ 43.480.573,11 | |
|------------------------------------|------------------|-------------------|------------------|
| Período | Receitas (R\$) | Despesas (R\$) | Resultado (R\$) |
| 05/2022 | R\$ 1.239.427,94 | R\$ 43.017,61 | R\$ 1.196.410,33 |
| 06/2022 | R\$ 1.265.619,51 | R\$ 54.090,17 | R\$ 1.211.529,34 |
| 07/2022 | R\$ 1.314.247,49 | R\$ 6.039,13 | R\$ 1.308.208,36 |
| 08/2022 | R\$ 1.289.382,39 | R\$ 102.141,21 | R\$ 1.187.241,18 |
| 09/2022 | R\$ 1.297.425,41 | R\$ 47.405,73 | R\$ 1.250.019,68 |
| 10/2022 | R\$ 1.312.094,85 | R\$ 54.090,17 | R\$ 1.258.004,68 |
| 11/2022 | R\$ 1.325.950,25 | R\$ 48.051,04 | R\$ 1.277.899,21 |
| 12/2022 | R\$ 1.340.533,16 | R\$ 83.947,48 | R\$ 1.256.585,68 |
| 01/2023 | R\$ 2.652.384,33 | R\$ 41.366,60 | R\$ 2.611.017,73 |
| 02/2023 | R\$ 1.363.583,62 | R\$ 191.804,69 | R\$ 1.171.778,93 |
| 03/2023 | R\$ 1.361.693,00 | R\$ 121.514,16 | R\$ 1.240.178,84 |
| 04/2023 | R\$ 1.353.367,86 | R\$ 107.760,38 | R\$ 1.245.607,48 |
| Saldo dos Investimentos em 04/2023 | | R\$ 65.772.202,19 | |

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) | 4,1847 % | 2,7170 % | 0,6100 % |
| Juros | 5,1200 % | 1,6783 % | 0,4170 % |
| Meta | 9,5190 % | 4,4409 % | 1,0295 % |
| Rentabilidade em % | 12,0421 % | 4,5914 % | 1,2811 % |
| Rentabilidade em R\$ | R\$ 6.077.147,64 | R\$ 2.736.429,34 | R\$ 816.201,97 |
| Resultado em % | +2,3039 % | +0,1441 % | +0,2490 % |
| Resultado em R\$ | R\$ +1.270.385,39 | R\$ +89.667,63 | R\$ +160.294,88 |

Quadro 20.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|---------------------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|---------|------------------|--|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| BRADESCO MAXI PODER PUBLICO | R\$ 45.298.040,94 | R\$ 25.265.342,27 | - | - | 0,8500 | 0,8500% | 0,8500% | NC | |
| TOTAL art. 7º, inciso III, "a" | R\$ 45.298.040,94 | R\$ 25.265.342,27 | | | | | | | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 45.298.040,94 | R\$ 25.265.342,27 | | | | | | | |

| FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|---|--------------------------|--------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|-----------|------------------|--|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 2.487.223,31 | R\$ 2.591.807,34 | (4,7800) | (2,5800) | 4,2000 | -3,3406% | -1,5428% | -5,2601% | |
| CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA | R\$ 9.021.492,35 | R\$ 9.282.229,12 | (5,8467) | (2,5283) | 2,8902 | -5,5748% | -2,4549% | -4,3506% | |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 1.005.126,17 | R\$ 1.016.577,75 | (6,4400) | (2,8000) | 1,1400 | -8,0230% | -5,4936% | -3,2180% | |
| TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA | R\$ 1.138.065,39 | R\$ 1.090.294,02 | (4,0000) | (6,3100) | (4,2000) | -13,8352% | -10,9314% | -3,7230% | |
| TARPON GT INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 1.167.849,50 | R\$ 1.221.195,90 | (2,5289) | (4,0745) | 4,5679 | -2,2294% | 0,0677% | 5,4376% | |
| GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 5.711.242,89 | R\$ 6.048.951,99 | (3,6874) | (1,0370) | 5,9131 | 0,9498% | 0,0350% | 7,4350% | |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA | R\$ 4.266.284,96 | R\$ 4.344.499,85 | (6,7000) | (3,4000) | 1,8300 | -8,2229% | -5,9927% | -7,0650% | |
| TOTAL art. 8º, inciso I | R\$ 24.797.284,57 | R\$ 25.595.555,97 | | | | | | | |

| FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|--|--------------------------|--------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|---------|------------------|--|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| BB MM GLOBAL SELECT | R\$ 26.795.285,10 | R\$ 26.466.140,95 | 2,5316 | (0,3184) | (1,2283) | 0,9498% | 3,5454% | 4,2874% | |
| TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior | R\$ 26.795.285,10 | R\$ 26.466.140,95 | | | | | | | |

| FUNDOS ESTRUTURADOS | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | | |
|--|---------------------------|--------------------------|-----------------|--------|--------|-----------|----------|------------------|--|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES | |
| SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO | R\$ 19.215.259,07 | R\$ 19.594.725,98 | (1,7500) | 3,9900 | 1,9700 | 4,1829% | 10,8506% | 10,1776% | |
| TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior | R\$ 19.215.259,07 | R\$ 19.594.725,98 | | | | | | | |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 50.025.926,19 | R\$ 1,00 | | | | | | | |
| VALORES EM TRÂNSITO | R\$ - | R\$ - | | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 166.131.795,87 | R\$ 96.921.766,17 | | | | | | | |

Quadro 21.

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. 197/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria: **3.3 OUTROS PODERES: MPE/DPE/TJA/TCE FPREV. a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97); **b) Recursos atuais:** Zerar os recursos aplicado no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), saldo aproximado de R\$ 91 milhões, direcionando para o fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97).

Nota 3: Realizadas novas aquisições de Títulos Públicos Federais, NTN B, **no valor total de R\$ 19.994.106,22** (dezenove milhões, novecentos e noventa e quatro mil, cento e seis reais e vinte e dois centavos, em abril/2023, com recursos disponíveis nos fundos indexados ao CDI, conforme Estratégia aprovada na Política de Investimentos para 2023.



Relatório de Investimentos – Abril/2023

6.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

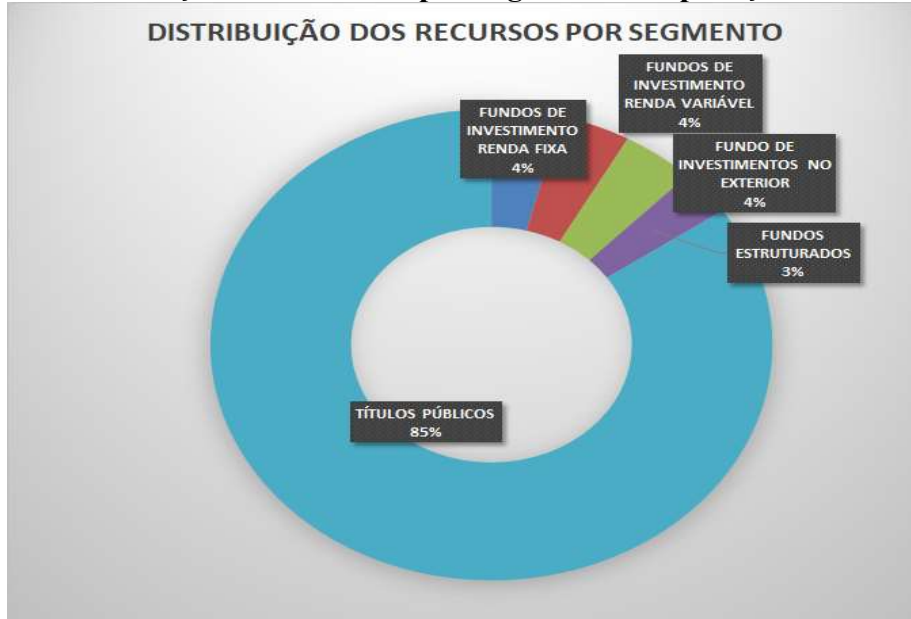


Gráfico 3.

6.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

| Saldo dos Investimentos em 04/2022 | | R\$ 532.919.602,58 | |
|------------------------------------|------------------|--------------------|------------------|
| Período | Receitas (R\$) | Despesas (R\$) | Resultado (R\$) |
| 05/2022 | R\$ 24.966,47 | R\$ 623.560,78 | R\$ -598.594,31 |
| 06/2022 | R\$ 8.338.800,59 | R\$ 308.280,26 | R\$ 8.030.520,33 |
| 07/2022 | R\$ 4.283.886,16 | R\$ 333.045,61 | R\$ 3.950.840,55 |
| 08/2022 | R\$ 4.331.931,11 | R\$ 455.010,26 | R\$ 3.876.920,85 |
| 09/2022 | R\$ 4.327.276,05 | R\$ 353.459,00 | R\$ 3.973.817,05 |
| 10/2022 | R\$ 4.288.452,36 | R\$ 351.916,60 | R\$ 3.936.535,76 |
| 11/2022 | R\$ 4.407.617,21 | R\$ 355.001,41 | R\$ 4.052.615,80 |
| 12/2022 | R\$ 8.528.187,87 | R\$ 425.895,65 | R\$ 8.102.292,22 |
| 01/2023 | R\$ 4.503.689,63 | R\$ 316.298,28 | R\$ 4.187.391,35 |
| 02/2023 | R\$ 4.452.062,90 | R\$ 386.831,46 | R\$ 4.065.231,44 |
| 03/2023 | R\$ 4.682.824,72 | R\$ 954.025,73 | R\$ 3.728.798,99 |
| 04/2023 | R\$ 37.853,98 | R\$ 416.120,94 | R\$ -378.266,96 |
| Saldo dos Investimentos em 04/2023 | | R\$ 630.436.897,46 | |

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) | 4,1847 % | 2,7170 % | 0,6100 % |
| Juros | 5,1200 % | 1,6783 % | 0,4170 % |
| Meta | 9,5190 % | 4,4409 % | 1,0295 % |
| Rentabilidade em % | 9,1164 % | 4,2618 % | 1,0099 % |
| Rentabilidade em R\$ | R\$ 50.589.191,81 | R\$ 25.542.953,96 | R\$ 6.306.680,85 |
| Resultado em % | -0,3676 % | -0,1715 % | -0,0195 % |
| Resultado em R\$ | R\$ -2.232.548,90 | R\$ -1.073.374,76 | R\$ -122.718,30 |

Quadro 22.



Relatório de Investimentos – Abril/2023

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

| FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
|--|--------------------------|--------------------------|-----------------|----------|----------|-----------|----------|------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRADESCO MAXI PODER PUBLICO | R\$ 5.143.670,77 | R\$ 5.989.063,76 | - | - | 0,8500 | 0,8500% | 0,8500% | NC |
| TOTAL art. 7º, inciso III, "a" | R\$ 5.143.670,77 | R\$ 5.989.063,76 | | | | | | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 5.143.670,77 | R\$ 5.989.063,76 | | | | | | |
| FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 671.953,73 | R\$ 700.208,39 | (4,7800) | (2,5800) | 4,2000 | -3,3406% | -3,9228% | -5,3708% |
| CAIXA FIC FIA BRASIL AÇOES LIVRE QUANTIT. | R\$ 9.021.492,35 | R\$ 9.282.229,12 | (5,8467) | (2,5283) | 2,8902 | -5,5748% | -8,2651% | -4,3506% |
| GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 1.322.882,96 | R\$ 1.401.105,79 | (3,6874) | (1,0370) | 5,9131 | 0,9498% | -5,9564% | 14,1221% |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA | R\$ 795.036,01 | R\$ 809.611,61 | (6,7000) | (3,4000) | 1,8300 | -8,2229% | -5,9927% | -7,0650% |
| TOTAL art. 8º, inciso I | R\$ 11.811.365,05 | R\$ 12.193.154,91 | | | | | | |
| FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| BB MM GLOBAL SELECT | R\$ 512.476,19 | R\$ 506.181,11 | 2,5316 | (0,3184) | (1,2283) | 0,9498% | 3,5454% | 4,2874% |
| TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior | R\$ 512.476,19 | R\$ 506.181,11 | | | | | | |
| FUNDOS ESTRUTURADOS | SALDOS | | VALORIZAÇÃO (%) | | | | | |
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 | fev/23 | mar/23 | abr/23 | TRIMESTRE | 2023 | ÚLTIMOS 12 MESES |
| SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO | R\$ 3.585.066,55 | R\$ 3.655.865,18 | (1,7500) | 3,9900 | 1,9700 | 4,1829% | 10,8506% | 10,1776% |
| TOTAL art. 10º, inciso I | R\$ 3.585.066,55 | R\$ 3.655.865,18 | | | | | | |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 836.338,78 | R\$ 599,06 | | | | | | |
| VALORES EM TRANSITO | R\$ - | R\$ - | | | | | | |
| TOTAL | R\$ 21.888.917,34 | R\$ 22.344.864,02 | | | | | | |

Quadro 23.

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. 197/2023**, devidamente autorizada pela Diretoria: **3.3 OUTROS PODERES: MPE/DPE/TJA/TCE FPREV. a) Novos Recursos:** aplicar no fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97); **b) Recursos atuais:** Zerar os recursos aplicado no fundo BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM (03.399.411/0001-90), saldo aproximado de R\$ 91 milhões, direcionando para o fundo BRADESCO FI RENDA FIXA MAXI PODER PUBLICO (008.246.263/0001-97).

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

7.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

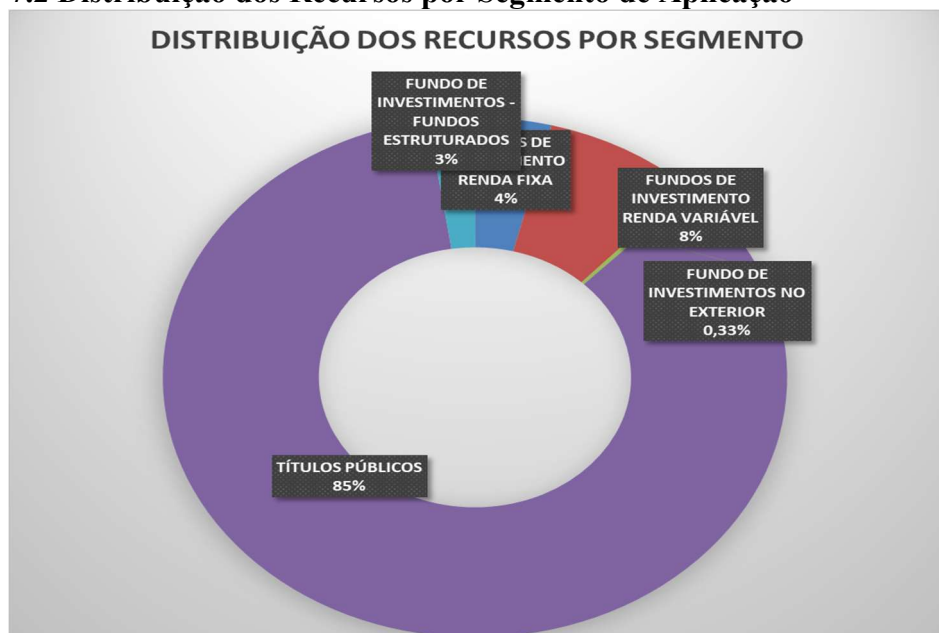


Gráfico 4.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MzA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

| Saldo dos Investimentos em 04/2022 | | R\$ 126.846.183,71 | |
|------------------------------------|-----------------|--------------------|-----------------|
| Período | Receitas (R\$) | Despesas (R\$) | Resultado (R\$) |
| 05/2022 | RS 730.190,58 | RS 64.596,96 | RS 665.593,62 |
| 06/2022 | RS 752.226,14 | RS 57.988,93 | RS 694.237,21 |
| 07/2022 | RS 743.489,44 | RS 7.489,13 | RS 736.000,31 |
| 08/2022 | RS 820.598,04 | RS 106.726,53 | RS 713.871,51 |
| 09/2022 | RS 980.772,84 | RS 32.298,48 | RS 948.474,36 |
| 10/2022 | RS 817.771,29 | RS 32.298,48 | RS 785.472,81 |
| 11/2022 | RS 957.070,80 | RS 38.906,51 | RS 918.164,29 |
| 12/2022 | RS 1.730.199,65 | RS 39.809,66 | RS 1.690.389,99 |
| 01/2023 | RS 818.311,18 | RS 24.852,01 | RS 793.459,17 |
| 02/2023 | RS 840.406,80 | RS 57.209,33 | RS 783.197,47 |
| 03/2023 | RS 868.020,15 | RS 119.035,88 | RS 748.984,27 |
| 04/2023 | RS 884.821,56 | RS 81.955,68 | RS 802.865,88 |
| Saldo dos Investimentos em 04/2023 | | R\$ 152.062.293,83 | |

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) | 4,1847 % | 2,7170 % | 0,6100 % |
| Juros | 5,1200 % | 1,6783 % | 0,4170 % |
| Meta | 9,5190 % | 4,4409 % | 1,0295 % |
| Rentabilidade em % | 11,3794 % | 3,9412 % | 1,1850 % |
| Rentabilidade em R\$ | RS 14.935.399,23 | RS 5.691.420,86 | RS 1.771.438,66 |
| Resultado em % | +1,6987 % | -0,4784 % | +0,1539 % |
| Resultado em R\$ | RS +2.440.326,74 | RS -721.532,97 | RS +232.439,63 |

Quadro 24.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

| Saldo dos Investimentos em 04/2022 | | R\$ 6.149.176.582,64 | |
|------------------------------------|--------------------|----------------------|--------------------|
| Período | Receitas (R\$) | Despesas (R\$) | Resultado (R\$) |
| 05/2022 | R\$ 50.082.174,56 | R\$ 16.076.811,16 | R\$ 34.005.363,40 |
| 06/2022 | R\$ 59.319.428,77 | R\$ 11.397.350,62 | R\$ 47.922.078,15 |
| 07/2022 | R\$ 55.739.597,82 | R\$ 11.280.660,01 | R\$ 44.458.937,81 |
| 08/2022 | R\$ 56.431.133,95 | R\$ 13.000.428,99 | R\$ 43.430.704,96 |
| 09/2022 | R\$ 56.937.314,05 | R\$ 11.257.556,08 | R\$ 45.679.757,97 |
| 10/2022 | R\$ 56.154.596,15 | R\$ 11.305.467,55 | R\$ 44.849.128,60 |
| 11/2022 | R\$ 55.977.403,03 | R\$ 12.023.201,52 | R\$ 43.954.201,51 |
| 12/2022 | R\$ 124.106.593,11 | R\$ 17.179.517,14 | R\$ 106.927.075,97 |
| 01/2023 | R\$ 45.327.600,28 | R\$ 13.697.160,01 | R\$ 31.630.440,27 |
| 02/2023 | R\$ 56.872.067,81 | R\$ 20.127.536,33 | R\$ 36.744.531,48 |
| 03/2023 | R\$ 56.586.892,72 | R\$ 14.866.722,41 | R\$ 41.720.170,31 |
| 04/2023 | R\$ 53.436.002,70 | R\$ 13.694.121,29 | R\$ 39.741.881,41 |
| Saldo dos Investimentos em 04/2023 | | R\$ 6.989.657.407,28 | |

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) | 4,1847 % | 2,7170 % | 0,6100 % | |
| Juros | 5,1200 % | 1,6783 % | 0,4170 % | |
| Meta | 9,5190 % | 4,4409 % | 1,0295 % | |
| Rentabilidade em % | 4,3652 % | 0,3066 % | 0,9393 % | |
| Rentabilidade em R\$ | R\$ 279.416.552,80 | R\$ 21.066.152,86 | R\$ 64.674.201,64 | |
| Resultado em % | -4,7058 % | -3,9585 % | -0,0893 % | |
| Resultado em R\$ | R\$ -329.668.974,88 | R\$ -284.060.179,42 | R\$ -6.210.287,34 | |

Quadro 25.

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 DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

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

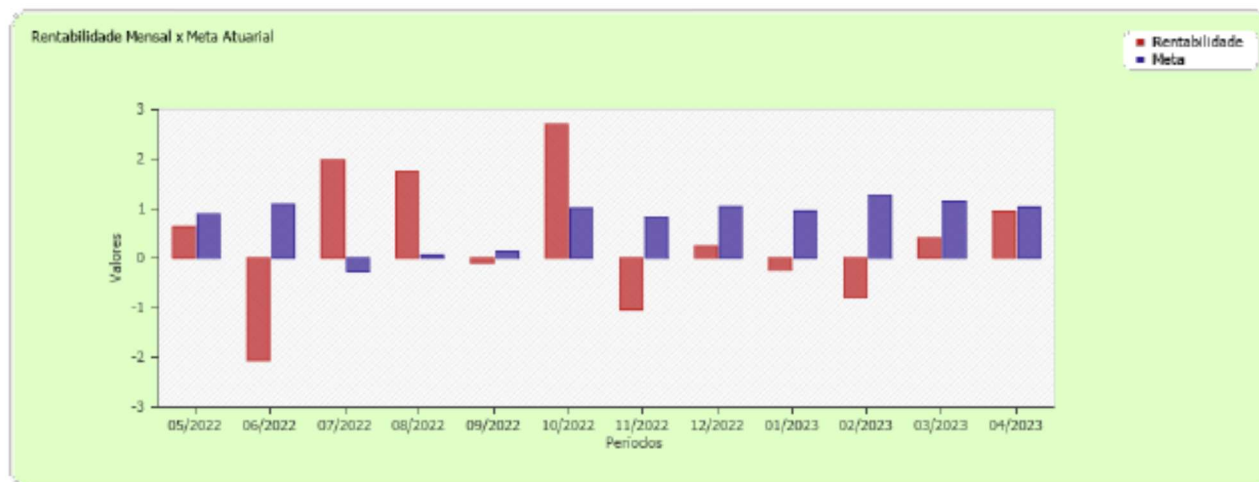


Gráfico 5.

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

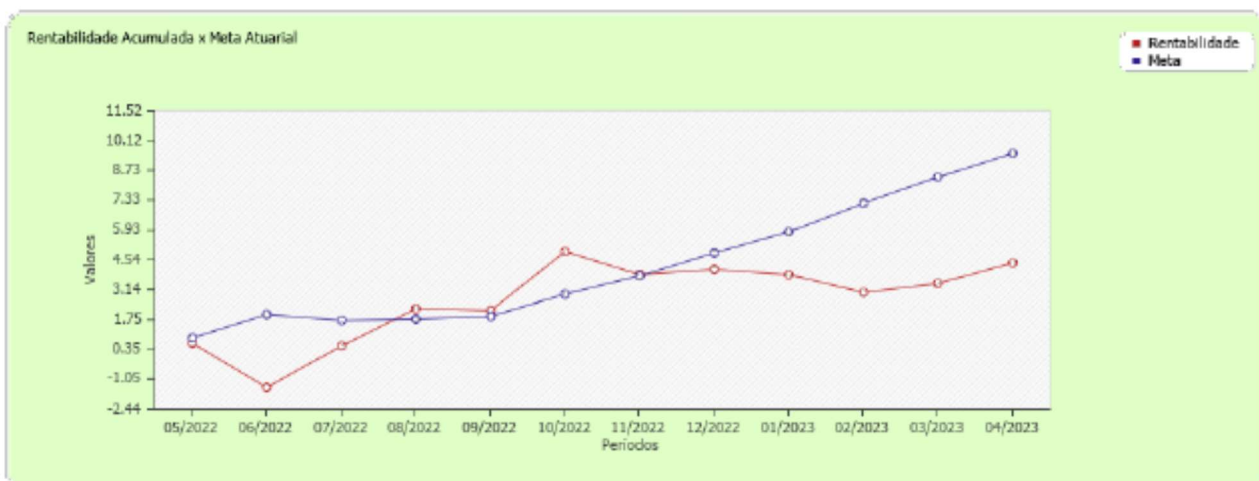


Gráfico 6.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MzA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

| DESCRIÇÃO | SALDOS | |
|--------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 1.051.250,48 | R\$ 1.379.329,02 |
| FUNDO BRADESCO RF - COMPREV | R\$ 12.047.903,54 | R\$ 12.620.198,81 |
| REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO | R\$ 5.055,96 | R\$ 5.055,96 |
| COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO | R\$ 16.950.332,18 | R\$ 17.198.314,81 |
| SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS | R\$ 237.999,46 | R\$ 237.999,46 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | R\$ - | R\$ 1,00 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV | R\$ - | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 30.292.541,62 | R\$ 31.440.899,06 |

Quadro 26.

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

9.2 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

| DESCRIÇÃO | SALDOS | |
|--|-------------------------|-------------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM | R\$ 5.452.151,07 | R\$ 5.481.649,93 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM | R\$ - | R\$ 1,00 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP | R\$ 24.537,13 | R\$ 24.510,18 |
| TOTAL | R\$ 5.476.688,20 | R\$ 5.506.161,11 |

Quadro 27.

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

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

| DESCRIÇÃO | SALDOS | |
|--|-------------------|--------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ - | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 141,74 | R\$ - |
| TOTAL | R\$ 141,74 | R\$ - |

Quadro 28.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|----------------------|-----------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 8.805,23 | R\$ 245.351,40 |
| DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN | R\$ 5.901,38 | R\$ 83.837,84 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ 1,00 |
| TOTAL | R\$ 14.706,61 | R\$ 329.190,24 |

Quadro 29.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|-------------------------|-------------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 4.131.326,98 | R\$ 3.796.303,89 |
| CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE | R\$ - | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN | R\$ - | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ 1,00 |
| TOTAL | R\$ 4.131.326,98 | R\$ 3.796.304,89 |

Quadro 30.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|-------------------------|-------------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 6.610.551,09 | R\$ 1.192.757,06 |
| CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE | R\$ - | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN | R\$ 603.350,86 | R\$ 663.882,58 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ 1,00 |
| TOTAL | R\$ 7.213.901,95 | R\$ 1.856.640,64 |

Quadro 31.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

| FUNDO DE INVESTIMENTO | SALDOS | |
|--|--------------------------|--------------------------|
| | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 1.452.798,76 | R\$ 1.458.535,98 |
| CDB-FACIL CDI - P/ RESGATE | R\$ - | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN | R\$ 1.401.543,21 | R\$ 1.000.000,00 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ 1,00 |
| TOTAL | R\$ 2.854.341,97 | R\$ 2.458.536,98 |
| TOTAL GERAL FFIN | R\$ 49.983.649,07 | R\$ 45.387.732,92 |

Quadro 32.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Evolução do Saldo de Taxa de Administração

| DESCRIÇÃO | SALDOS | | | |
|--|--------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| BRANCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 1.143,62 | R\$ 961.974,54 | R\$ 1.596.913,27 | R\$ 3.183.907,62 |
| CAIXA FI BRASIL REF DI LP | R\$ 40.560.407,77 | R\$ 22.023.255,82 | R\$ 22.700.489,05 | R\$ 22.908.906,94 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 1,00 | R\$ - | R\$ 50.715,16 | R\$ 1,00 |
| TOTAL PODER EXECUTIVO | R\$ 40.561.552,39 | R\$ 22.986.209,34 | R\$ 24.348.117,48 | R\$ 26.092.815,56 |
| DESCRIÇÃO | SALDOS | | | |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| BRANCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ - | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 35.718,27 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| TOTAL - ALE | R\$ 35.718,27 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| DESCRIÇÃO | SALDOS | | | |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| BRANCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 61.970,46 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ 1,00 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| TOTAL - TCE | R\$ 61.971,46 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| DESCRIÇÃO | SALDOS | | | |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| BRANCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 605.835,00 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| TOTAL TJ/AM | R\$ 605.835,00 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| DESCRIÇÃO | SALDOS | | | |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/03/2023 | 28/04/2023 |
| BRANCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 199.434,03 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE | R\$ - | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| TOTAL PGJ/AM | R\$ 199.434,03 | R\$ - | R\$ - | R\$ - |
| TOTAL GERAL | R\$ 41.464.511,15 | R\$ 22.986.209,34 | R\$ 24.348.117,48 | R\$ 26.092.815,56 |

Quadro 33.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA | TOTAL | % DA CARTEIRA | ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023 | | Resolução CMN nº 4.963/21 | | | | |
|--|-----------------------------|---------------|-----------------------------------|-----------------|---------------------------|---------------|--|--|--|
| | | | ESTRATÉGIA ALVO | LIMITE SUPERIOR | | | | | |
| TÍTULOS DO TESOUREIRO NACIONAL | R\$ 4.331.653.544,67 | 62,15% | 34,00% | 100,00% | art. 7º, inciso I, "a" | | | | |
| TOTAL art. 7º, inciso I, "a" | R\$ 4.331.653.544,67 | | | | | | | | |
| BB PREVIDENCIÁRIO TP VII | R\$ 8.209.684,87 | 2,10% | 29,00% | 100,00% | art. 7º, Inciso I, "b" | | | | |
| CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF | R\$ 56.067.829,33 | | | | | | | | |
| SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF | R\$ 82.171.329,33 | | | | | | | | |
| ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC | R\$ 71.350,96 | | | | | | | | |
| TOTAL art. 7º, inciso I, "b" | R\$ 146.520.194,49 | | | | | | | | |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 70.753.039,87 | 2,31% | 5,00% | 70,00% | art. 7º, inciso III, "a" | | | | |
| BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM | R\$ 6.818.770,87 | | | | | | | | |
| ITAU SOBERANO SIMPLES FIC | R\$ 49.570.970,88 | | | | | | | | |
| CAIXA FI BRASIL REF DI LP | R\$ 33.978.387,01 | | | | | | | | |
| TOTAL art. 7º, inciso III, "a" | R\$ 161.121.168,63 | | | | | | | | |
| SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST | R\$ 91.781.307,64 | 7,39% | 10,00% | 10,00% | art 7º, inciso V, "b" | | | | |
| ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI | R\$ 92.614.467,00 | | | | | | | | |
| BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP | R\$ 101.013.901,37 | | | | | | | | |
| MAG CRED PRIV FI RF LONGO PRAZO | R\$ 56.712.123,77 | | | | | | | | |
| PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP | R\$ 92.577.638,27 | | | | | | | | |
| BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF | R\$ 68.786.133,72 | | | | | | | | |
| RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF | R\$ 11.542.742,29 | | | | | | | | |
| TOTAL art 7º, inciso V, "b" | R\$ 515.028.314,06 | | | | | | | | |
| TOTAL RENDA FIXA | R\$ 5.154.323.221,85 | | | | | 73,95% | | | |

Quadro 34.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/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\$ 60.369.974,14 | 19,14% | 15,00% | 44,00% | art. 8º, inciso I |
| AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 67.651.606,22 | | | | |
| BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 106.125.812,11 | | | | |
| BB SELEÇÃO FATOR FIC FI | R\$ 46.599.794,37 | | | | |
| BRADESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 100.205.329,57 | | | | |
| BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 43.044.235,02 | | | | |
| BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA | R\$ 168.610.244,88 | | | | |
| CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO | R\$ 31.050.279,47 | | | | |
| DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | R\$ 16.959.073,50 | | | | |
| ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 76.028.855,27 | | | | |
| ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC | R\$ 48.299.535,24 | | | | |
| ITAÚ SMALL CAP VALUATION | R\$ 64.736.977,49 | | | | |
| OCCAM FIC FIA | R\$ 92.519.705,98 | | | | |
| VINCI MOSAICO INSTUCIONAL FIA | R\$ 88.623.908,59 | | | | |
| GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 76.644.851,35 | | | | |
| VINCI SELECTION EQUITIES FIA | R\$ 38.272.446,74 | | | | |
| TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA | R\$ 43.217.488,69 | | | | |
| TARPON GT 30 FIC FIA | R\$ 68.169.781,52 | | | | |
| 4UM SMALL CAPS FIA | R\$ 36.152.574,95 | | | | |
| TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA | R\$ 4.438.919,26 | | | | |
| CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA | R\$ 39.048.412,73 | | | | |
| 4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA | R\$ 4.166.624,46 | | | | |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA | R\$ 13.057.834,21 | | | | |
| TOTAL art. 8º, inciso I, "a" | R\$ 1.333.994.265,76 | | | | |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | R\$ 1.333.994.265,76 | 19,14% | | | |

Quadro 35.

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\$ 26.972.322,06 | 2,07% | 1,00% | 10,00% | art 9º-A, inciso II |
| GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA | R\$ 33.242.048,04 | | | | |
| GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE | R\$ 13.239.782,88 | | | | |
| SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR | R\$ 45.133.126,12 | | | | |
| SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE | R\$ 25.783.514,86 | | | | |
| TOTAL art 9º, inciso II - Sufixo Investimento no Exterior | R\$ 144.370.793,96 | | | | |
| BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I | R\$ 58.327.235,17 | 1,68% | 1,00% | | art 9º-A, inciso III |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I | R\$ 28.266.123,89 | | | | |
| ITAÚ BDR NIVEL 1 AÇÕES | R\$ 30.513.223,78 | | | | |
| TOTAL art 9º, inciso III - BDR Nivel I | R\$ 117.106.582,84 | | | | |
| TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | R\$ 261.477.376,80 | 3,75% | | | |

Quadro 36.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

11.4 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Fundos Estruturados

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO - FUNDOS ESTRUTURADOS | TOTAL | % DA CARTEIRA | ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2023 | | Resolução CMN nº 4.963/21 |
|---|-----------------------------|---------------|-----------------------------------|-----------------|---------------------------|
| | | | LIMITE ALVO | LIMITE SUPERIOR | |
| SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO | R\$ 34.750.332,63 | 2,03% | 2,00% | 10,00% | art. 10º, inciso I, a |
| BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT | R\$ 16.642.967,02 | | | | |
| FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV | R\$ 15.236.173,46 | | | | |
| CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP | R\$ 17.724.988,19 | | | | |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM | R\$ 10.457.953,28 | | | | |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM | R\$ 31.279.158,83 | | | | |
| RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM | R\$ 15.280.810,34 | | | | |
| TOTAL art. 10º, inciso I, "a" | R\$ 141.372.383,75 | | | | |
| BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ 41.111.376,00 | 1,13% | 2,00% | 5,00% | art. 10º, inciso I, b |
| BTG PACTUAL IMPACTO FIP | R\$ 21.437.289,23 | | | | |
| CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT | R\$ 1.387.218,10 | | | | |
| KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP | R\$ 14.795.514,65 | | | | |
| TOTAL art. 10º, inciso I, "b" | R\$ 78.731.397,98 | | | | |
| TOTAL FUNDOS ESTRUTURADOS | R\$ 220.103.781,73 | 3,16% | | | |
| TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES | R\$ 6.969.898.646,14 | 100% | | | |

Quadro 37.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

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

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO | | TOTAL APLICADO | % CARTEIRA | LIMITE NO PL DO RPPS POR FUNDO |
|-------------------------|---|--------------------|------------|--------------------------------|
| FI RF - 100% TPF | BB PREVIDENCIÁRIO TP VII | R\$ 8.209.684,87 | 0,12% | 100% |
| | CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF | R\$ 56.067.829,33 | 0,79% | |
| FI RENDA FIXA | BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 70.753.039,87 | 1,00% | 20% |
| | BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM | R\$ 6.818.770,87 | 0,10% | |
| | CAIXA FI BRASIL REF DI LP | R\$ 33.978.387,01 | 0,48% | |
| | ITAU SOBERANO SIMPLES FIC - FUNDO NOVO | R\$ 49.570.970,88 | 0,70% | |
| | SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF | R\$ 82.171.329,33 | 1,16% | |
| | ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC | R\$ 71.350,96 | 0,00% | |
| FI RF CREDITO PRIVADO | SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST | R\$ 91.781.307,64 | 1,30% | 20% |
| | ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI | R\$ 92.614.467,00 | 1,31% | |
| | BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP | R\$ 101.013.901,37 | 1,43% | |
| | PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP | R\$ 92.577.638,27 | 1,31% | |
| | BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF | R\$ 68.786.133,72 | 0,97% | |
| | RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF | R\$ 11.542.742,29 | 0,16% | |
| | MAG CRED PRIV FI RF LONGO PRAZO | R\$ 56.712.123,77 | 0,80% | |
| FUNDOS DE AÇÕES | ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 60.369.974,14 | 0,85% | 20% |
| | AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 67.651.606,22 | 0,96% | |
| | BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 106.125.812,11 | 1,50% | |
| | BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI | R\$ 46.599.794,37 | 0,66% | |
| | BRADESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 100.205.329,57 | 1,42% | |
| | BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 43.044.235,02 | 0,61% | |
| | BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA | R\$ 168.610.244,88 | 2,39% | |
| | CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO | R\$ 31.050.279,47 | 0,44% | |
| | DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | R\$ 16.959.073,50 | 0,24% | |
| | ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 76.028.855,27 | 1,08% | |
| | ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC | R\$ 48.299.535,24 | 0,68% | |
| | ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA | R\$ - | 0,00% | |
| | ITAÚ SMALL CAP VALUATION | R\$ 64.736.977,49 | 0,92% | |
| | OCCAM FIC FIA | R\$ 92.519.705,98 | 1,31% | |
| | VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA | R\$ 88.623.908,59 | 1,26% | |
| | GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 76.644.851,35 | 1,09% | |
| | VINCI SELECTION EQUITIES FIA | R\$ 38.272.446,74 | 0,54% | |
| | TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA | R\$ 43.217.488,69 | 0,61% | |
| | TARPON GT 30 FIC FIA | R\$ 68.169.781,52 | 0,97% | |
| | TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA | R\$ 4.438.919,26 | 0,06% | |
| | CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA | R\$ 39.048.412,73 | 0,55% | |
| | 4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA | R\$ 4.166.624,46 | 0,06% | |
| | CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA | R\$ 13.057.834,21 | 0,18% | |
| 4UM SMALL CAPS FIA | R\$ 36.152.574,95 | 0,51% | | |
| INVEST NO EXTERIOR - FI | BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIO | R\$ 26.972.322,06 | 0,38% | 20% |
| | GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA | R\$ 33.242.048,04 | 0,47% | |
| | GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE | R\$ 13.239.782,88 | 0,19% | |
| | SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR | R\$ 45.133.126,12 | 0,64% | |
| | SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE | R\$ 25.783.514,86 | 0,37% | |
| FIA - BDR | BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I | R\$ 58.327.235,17 | 0,83% | 20% |
| | ITAU BDR NIVE 1 AÇÕES | R\$ 30.513.223,78 | 0,43% | |
| | SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I | R\$ 28.266.123,89 | 0,40% | |

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023

AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

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

e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

| | | | | | |
|--|--|------------|-------------------------|-------|-----|
| FUNDOS MULTIMERCADO | SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO | R\$ | 34.750.332,63 | 0,49% | 20% |
| | BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT | R\$ | 16.642.967,02 | 0,24% | |
| | FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV | R\$ | 15.236.173,46 | 0,22% | |
| | CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP | R\$ | 17.724.988,19 | 0,25% | |
| | RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO | R\$ | 10.457.953,28 | 0,15% | |
| | RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM | R\$ | 31.279.158,83 | 0,44% | |
| | RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM | R\$ | 15.280.810,34 | 0,22% | |
| FIP | BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ | 41.111.376,00 | 0,58% | 20% |
| | KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP | R\$ | 14.795.514,65 | 0,21% | |
| | CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT | R\$ | 1.387.218,10 | 0,02% | |
| | BTG PACTUAL IMPACTO FIP | R\$ | 21.437.289,23 | 0,30% | |
| TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO | | R\$ | 2.638.245.101,47 | | |
| TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL | | R\$ | 4.331.653.544,67 | | |
| IMÓVEIS | | R\$ | 65.484.778,63 | | |
| RECURSOS EM TRÂNSITO | | R\$ | - | | |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | | R\$ | 19.220.977,83 | | |
| CVS | | R\$ | 6.533.554,16 | | |
| TOTAL DO RECURSOS | | R\$ | 7.061.137.956,76 | | |
| TOTAL DAS APLICAÇÕES DOS RECURSOS | | R\$ | 7.061.137.956,76 | | |

Quadro 38.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

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

| SEGMENTO DE APLICAÇÃO | | TOTAL APLICADO | PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$ | % DO PL DO FUNDO | LIMITE RESOL. CMN 4.963/21 |
|-------------------------------|---|--------------------|-----------------------------------|------------------|----------------------------|
| FI RF - 100% TPF | BB PREVIDENCIÁRIO TP VII | R\$ 8.209.684,87 | R\$ 12.858.761.791,29 | 0,06% | 100% |
| | CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF | R\$ 56.067.829,33 | R\$ 228.811.691,95 | 24,50% | |
| FI RENDA FIXA | BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO | R\$ 70.753.039,87 | R\$ 593.247.753,24 | 11,93% | 15% |
| | BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM | R\$ 6.818.770,87 | R\$ 7.884.712.793,21 | 0,09% | |
| | CAIXA FI BRASIL REF DI LP | R\$ 33.978.387,01 | R\$ 15.640.448.903,65 | 0,22% | |
| | ICATU VANGUARDA RF FI PLUS LP | R\$ - | R\$ 707.225.251,73 | 0,00% | |
| | ITAU SOBERANO SIMPLES FIC | R\$ 49.570.970,88 | R\$ 36.382.532.815,75 | 0,14% | |
| | SAFRA SOBERANO REGIME PROPRIO DI FIC REF | R\$ 82.171.329,33 | R\$ 4.782.179.808,47 | 1,72% | |
| | ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC | R\$ 71.350,96 | R\$ 1.969.463.967,87 | 0,00% | |
| FI RF CREDITO PRIVADO | ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP | R\$ - | R\$ 1.233.526.759,75 | 0,00% | 5% |
| | SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST | R\$ 91.781.307,64 | R\$ 1.605.481.843,43 | 5,72% | |
| | ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI | R\$ 92.614.467,00 | R\$ 3.915.545.567,54 | 2,37% | |
| | BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP | R\$ 101.013.901,37 | R\$ 2.482.220.300,09 | 4,07% | |
| | PORTO SEGURO FI REFERENCIADO DI CP | R\$ 92.577.638,27 | R\$ 3.272.318.764,16 | 2,83% | |
| | BNP PARIBAS MACTH DI FI RF REF | R\$ 68.786.133,72 | R\$ 8.238.300.404,50 | 0,83% | |
| | RIO BRAVO CREDITO PRIVADO FI RF | R\$ 11.542.742,29 | R\$ 296.275.990,22 | 3,90% | |
| | MAG CRED PRIV FI RF LONGO PRAZO | R\$ 56.712.123,77 | R\$ 575.168.512,68 | 9,86% | |
| FUNDOS DE AÇÕES | ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 60.369.974,14 | R\$ 515.770.464,47 | 11,70% | 15% |
| | AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA | R\$ 67.651.606,22 | R\$ 1.182.299.590,17 | 5,72% | |
| | BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA | R\$ 106.125.812,11 | R\$ 804.593.754,06 | 13,19% | |
| | BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI | R\$ 46.599.794,37 | R\$ 1.233.526.759,75 | 3,78% | |
| | BRADESCO FIA MID SMALL CAPS | R\$ 100.205.329,57 | R\$ 708.501.591,03 | 14,14% | |
| | BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 43.044.235,02 | R\$ 260.773.035,75 | 16,51% | |
| | BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA | R\$ 168.610.244,88 | R\$ 1.267.736.973,94 | 13,30% | |
| | CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO | R\$ 31.050.279,47 | R\$ 497.437.394,67 | 6,24% | |
| | DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | R\$ 16.959.073,50 | R\$ 139.278.988,35 | 12,18% | |
| | ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA | R\$ 76.028.855,27 | R\$ 665.799.937,26 | 11,42% | |
| | ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC | R\$ 48.299.535,24 | R\$ 1.494.739.801,78 | 3,23% | |
| | ITAÚ SMALL CAP VALUATION | R\$ 64.736.977,49 | R\$ 431.077.424,95 | 15,02% | |
| | OCCAM FIC FIA | R\$ 92.519.705,98 | R\$ 844.988.648,15 | 10,95% | |
| | VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA | R\$ 88.623.908,59 | R\$ 689.245.559,86 | 12,86% | |
| | GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA | R\$ 76.644.851,35 | R\$ 874.285.875,39 | 8,77% | |
| | VINCI SELECTION EQUITIES FIA | R\$ 38.272.446,74 | R\$ 487.310.997,27 | 7,85% | |
| | TRIGONO FLAGSHIP INST FIC FIA | R\$ 43.217.488,69 | R\$ 766.280.306,03 | 5,64% | |
| | TARPON GT 30 FIC FIA | R\$ 68.169.781,52 | R\$ 592.191.572,33 | 11,51% | |
| | TRIGONO DELPHOS INCOME INST FIC FIA | R\$ 4.438.919,26 | R\$ 96.178.056,74 | 4,62% | |
| | CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA | R\$ 39.048.412,73 | R\$ 1.094.637.216,71 | 3,57% | |
| 4UM MARLIM DIVIDENDOS FIA | R\$ 4.166.624,46 | R\$ 248.547.674,56 | 1,68% | | |
| CLARITAS VALOR FEEDER FIC FIA | R\$ 13.057.834,21 | R\$ 557.939.773,42 | 2,34% | | |
| 4UM SMALL CAPS FIA | R\$ 36.152.574,95 | R\$ 248.547.674,56 | 14,55% | | |
| INVEST NO EXTERIOR - FI | BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR | R\$ 26.972.322,06 | R\$ 1.146.604.381,58 | 2,35% | 15% |
| | GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA | R\$ 33.242.048,04 | R\$ 110.398.408.164,79 | 0,03% | |
| | GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE | R\$ 13.239.782,88 | R\$ 12.535.337.876,45 | 0,11% | |
| | SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR | R\$ 45.133.126,12 | R\$ 817.335.946,81 | 5,52% | |
| | SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE | R\$ 25.783.514,86 | R\$ 22.883.816.042,17 | 0,11% | |
| FIA - BDR | BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I | R\$ 58.327.235,17 | R\$ 1.255.948.266,57 | 4,64% | 15% |
| | ITAU BDR NIVEL I AÇÕES | R\$ 30.513.223,78 | R\$ 180.642.534,94 | 16,89% | |
| | SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I | R\$ 28.266.123,89 | R\$ 783.726.940,09 | 3,61% | |

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

| | | | | | |
|---------------------------------|--|----------------------|----------------------|--------|-----|
| FUNDOS MULTIMERCADO | SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO | R\$ 34.750.332,63 | R\$ 549.456.436,42 | 6,32% | 15% |
| | BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT | R\$ 16.642.967,02 | R\$ 509.872.626,73 | 3,26% | |
| | ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC | R\$ - | R\$ 1.139.873.707,23 | 0,00% | |
| | FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IV | R\$ 15.236.173,46 | R\$ 109.742.142,70 | 13,88% | |
| | CAIXA FIC CAPITAL PROTEGIDO IBOV V LP | R\$ 17.724.988,19 | R\$ 167.076.844,63 | 10,61% | |
| | RIO BRAVO PROTEÇÃO II FIM - FUNDO NOVO | R\$ 10.457.953,28 | R\$ 163.988.643,34 | 6,38% | |
| | RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FIM | R\$ 31.279.158,83 | R\$ 214.885.538,16 | 14,56% | |
| | RIO BRAVO PROTEÇÃO FIM | R\$ 15.280.810,34 | R\$ 128.624.246,31 | 11,88% | |
| FIP | BTG ECONOMIA REAL FIP | R\$ 41.111.376,00 | R\$ 2.957.301.604,17 | 1,39% | 15% |
| | KINEA PRIVATE EQUITY FEEDER INST I FIP | R\$ 14.795.514,65 | R\$ 332.412.095,08 | 4,45% | |
| | CLA VINCI STRATEGIC PARTINERS I FIP MULT | R\$ 1.387.218,10 | R\$ 11.498.400,09 | 12,06% | |
| | BTG PACTUAL IMPACTO FIP | R\$ 21.437.289,23 | R\$ 443.426.259,73 | 4,83% | |
| TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO | | R\$ 2.638.245.101,47 | | | |

Quadro 39.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

11.7 Enquadramento IV – Limites Gerais – art. 20º - A - Res. CMN 4.963/2021 Quadro 40.

| GESTOR DE RECURSOS | TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA MARÇO/2023 EM R\$ MI) | APLICAÇÕES - AMAZONPREV (ABRIL/2023) | % DE RECURSOS SOB GESTÃO | Resolução CMN nº 4.963/21 |
|--------------------|--|--------------------------------------|--------------------------|---------------------------|
| BB DTVM S.A | R\$ 1.462.470,57 | R\$ 246.234.848,58 | 0,0168% | 5% |
| CAIXA | R\$ 493.213,47 | R\$ 154.057.657,46 | 0,0312% | |
| ITAU | R\$ 808.146,75 | R\$ 285.806.525,35 | 0,0354% | |
| SAFRA | R\$ 99.259,53 | R\$ 145.187.785,85 | 0,1463% | |
| BRABESCO | R\$ 586.812,89 | R\$ 177.777.140,31 | 0,0303% | |
| ICATÚ | R\$ 41.567,13 | R\$ 76.028.855,27 | 0,1829% | |
| BGT PACTUAL | R\$ 283.612,17 | R\$ 348.815.778,50 | 0,1230% | |
| SANTANDER | R\$ 309.583,04 | R\$ 136.914.433,76 | 0,0442% | |
| VINCI | R\$ 49.106,69 | R\$ 128.283.573,43 | 0,2612% | |
| OCCAM | R\$ 8.753,69 | R\$ 92.519.705,98 | 1,0569% | |
| PLURAL INVEST | R\$ 53.471,95 | R\$ 46.481.830,92 | 0,0869% | |
| AZ QUEST | R\$ 21.274,39 | R\$ 67.651.606,22 | 0,3180% | |
| BC GESTAO | R\$ 3.010,06 | R\$ 43.044.235,02 | 1,4300% | |
| ARX | R\$ 29.430,54 | R\$ 60.369.974,14 | 0,2051% | |
| SCHRODER | R\$ 21.974,73 | R\$ 25.783.514,86 | 0,1173% | |
| MONGERAL | R\$ 10.049,89 | R\$ 56.712.123,77 | 0,5643% | |
| DAYCOVAL | R\$ 11.291,46 | R\$ 16.959.073,50 | 0,1502% | |
| GUEPARDO | R\$ 2.219,15 | R\$ 76.644.851,35 | 3,4538% | |
| 4UM | R\$ 1.878,39 | R\$ 40.319.199,41 | 2,1465% | |
| TRIGONO | R\$ 2.424,81 | R\$ 47.656.407,95 | 1,9654% | |
| TARPON | R\$ 5.994,54 | R\$ 68.169.781,52 | 1,1372% | |
| RIO BRAVO | R\$ 9.716,89 | R\$ 68.560.664,74 | 0,7056% | |
| PORTO SEGURO | R\$ 20.524,91 | R\$ 92.577.638,27 | 0,4511% | |
| CONSTANCIA | R\$ 1.458,57 | R\$ 39.048.412,73 | 2,6772% | |
| BNP PARIBAS | R\$ 61.119,62 | R\$ 68.786.133,72 | 0,1125% | |
| KINEA | R\$ 77.071,69 | R\$ 14.795.514,65 | 0,0192% | |
| CLARITAS | R\$ 7.381,53 | R\$ 13.057.834,21 | 0,1769% | |

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



Relatório de Investimentos – Abril/2023

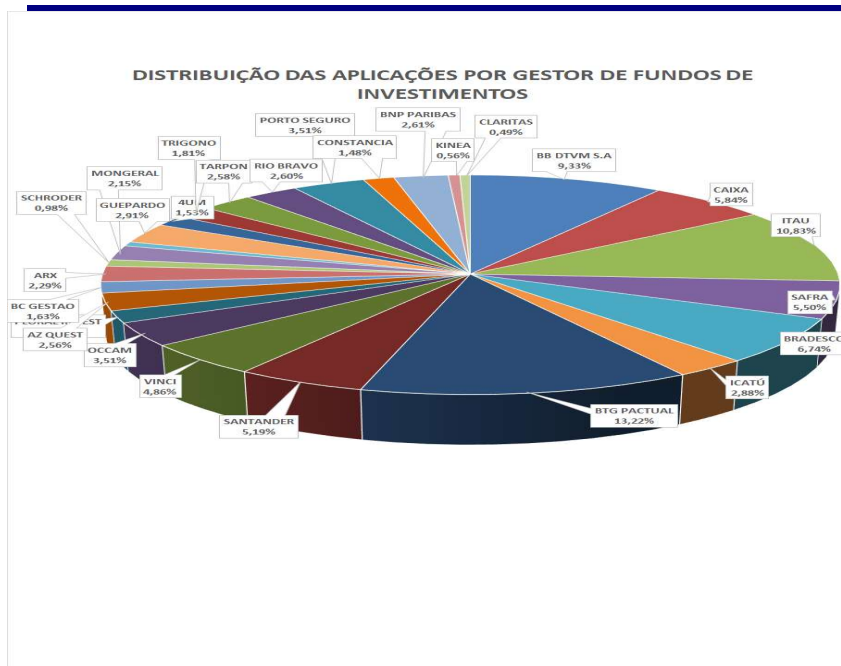


Gráfico 7.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

| DESCRIÇÃO | SALDO |
|----------------------------|-----------------------------|
| FUNDOS DE INVESTIMENTO | R\$ 2.638.245.101,45 |
| TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B | R\$ 4.331.653.544,67 |
| TÍTULOS - CVS | R\$ 6.533.554,16 |
| IMÓVEIS | R\$ 65.484.778,63 |
| VALORES EM TRÂNSITO | R\$ - |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | R\$ 19.220.977,83 |
| TOTAL | R\$ 7.061.137.956,74 |

Quadro 41.

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

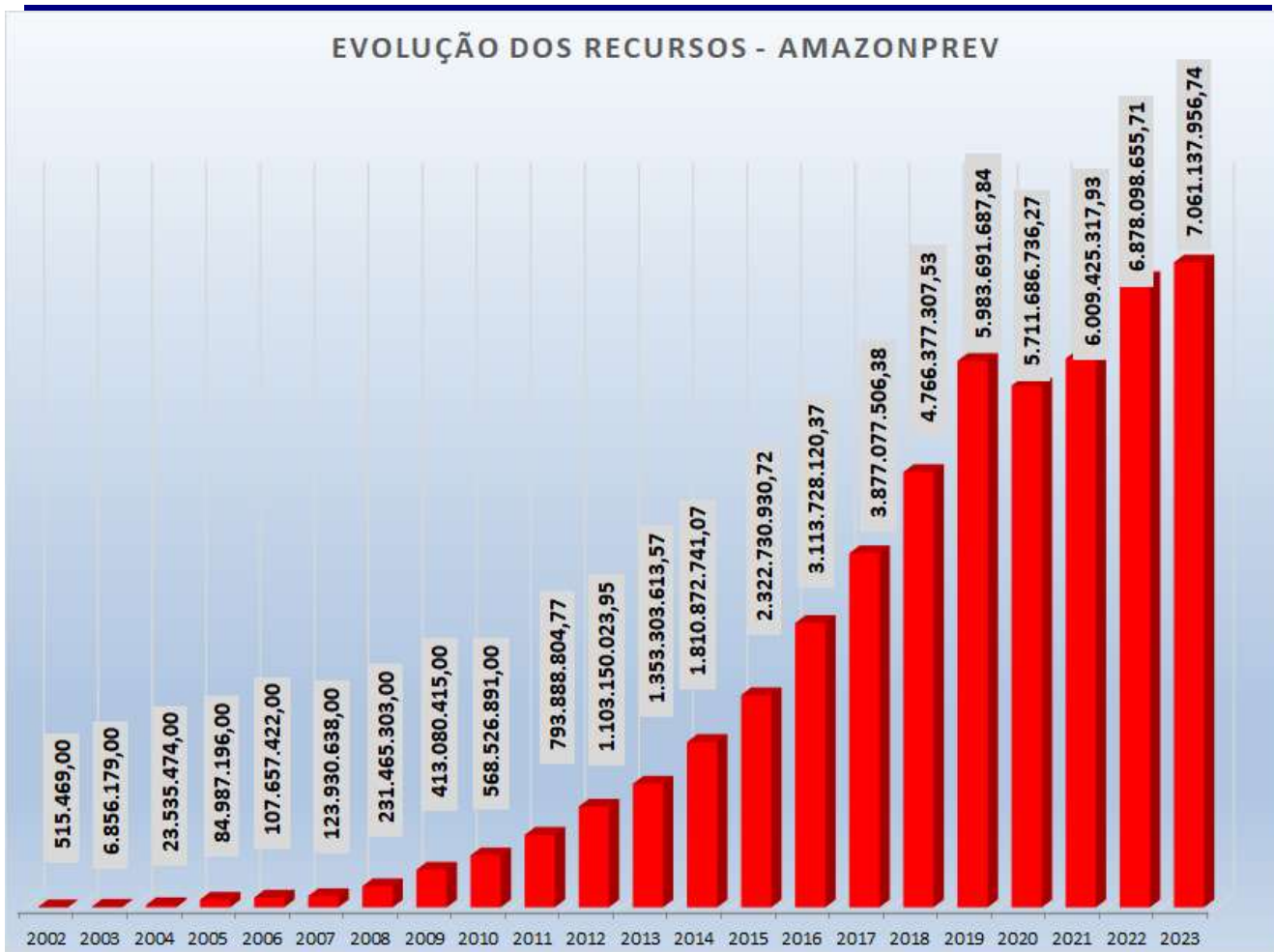


Gráfico 8.

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
 Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
 Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

| PLANO DE AÇÃO MENSAL | | RESPONSÁVEL | PRAZO |
|---|--|--|------------------------------|
| FPREV/EXECUTIVO | Novos Recursos Executivo: Novos recursos aplicar no fundo Bradesco Maxi Poder Público. | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/05/2023 |
| | | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/05/2023 |
| FPREV/ASSEMBLEIA | Novos Recursos ALE: Novos recursos aplicar no fundo Bradesco Maxi Poder Público. | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/05/2023 |
| FPREV/TCE, TJA, MPE, DPE | Novos Recursos TCE/TJA/MPE/DPE: Novos recursos aplicar no fundo Bradesco Maxi Poder Público. | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/05/2023 |
| FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE, FPPM) | Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público ou CDB Fácil Bradesco, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente. | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/05/2023 |
| RECURSOS COMPREV | Novos recursos aplicar no fundo Bradesco Maxi Poder Público. | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/05/2023 |
| DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO | Os Novos Recursos devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público ou CDB Fácil Bradesco. | GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV | 15/05/2023 |
| PAGAMENTO DE CUPOM E VENCIMENTO DE NTN-B | Aplicação dos recursos oriundos do pagamento de cupom e vencimento de ntn-b, conforme Parecer nº 075/2023/COMIV, submetido aos conselhos para deliberação. | COMIV/CODIR/COFIS/CONAD/GERAF | 31/05/2023 |
| AQUISIÇÃO DE TÍTULOS PÚBLICOS | Mantida a estratégia de Aquisição de Títulos Públicos Federais, conforme registrada na Ata 198/2023, e mantida na Política de Investimentos 2023. Devem ser utilizados recursos aplicados em fundos indexados ao CDI, em todos os Poderes do FPREV. | COMIV | 15/05/2023 |
| CONGRESSO NACIONAL DE INVESTIMENTOS - ABIPEM | Diligência às Instituições Financeiras: VINCI, ICATU, OCCAM, ARX E MONGERAL, localizadas no Rio de Janeiro-RJ. Irão participar quatro membros do Comitê. Participação de tres membros na Conferência Anual de Investidores, concementes aos FIP's Economia Real e Impacto, ambos do BTG. | COMIV | de 02/05/2023 até 01/06/2023 |

Quadro 42.

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 DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX



Relatório de Investimentos – Abril/2023

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente **no dia 15 de maio de 2023**, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de **abril/2023**, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

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

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

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

Manaus – AM, 15 de maio de 2023.

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Claudinei Soares
Membro

Leonardo Cavalcanti
Membro

Wellington Guimaraes
Membro

Bruno Barroso
Membro

Marcos Souza
Membro

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 19/05/2023 10:31:11
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 19/05/2023 12:03:38

Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 18/05/2023 14:46:05
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 18/05/2023 14:52:54
Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 19/05/2023 09:18:20
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 19/05/2023 09:33:23
Documento Assinado por: LEONARDO A. DE S. CAVALCANTI em 19/05/2023 09:49:38

Documento assinado eletronicamente 305911/2023
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MZA1OTEX

