

Processo: 2022.A.01477

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: **Relatório de Anual de Investimentos – 2021**

Data: 15/02/2022

RELATÓRIO Nº. 011/ 2022 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao exercício de **2021**, destacando:

- 1) 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 08);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 09 a 10);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 11);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 12)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 13 a 14)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (página 15 a 16)
- 7) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (página 17 a 18)
- 8) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 19 a 20)
- 9) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 21)
- 10) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 22 a 27)
- 11) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 28 a 29)
- 12) Relatório de Riscos da Carteira (página 30 a 38)
- 13) Parecer do Comitê de Investimentos (página 39).

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

1. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

1.1 SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 318.295.997,28	R\$ 271.047.525,22	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%	
BB PREVID TP VII	R\$ 7.079.089,17	R\$ 7.120.337,67	(0,4962)	1,7354	0,5826	1,8204%	6,5673%	6,5673%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 298.527.614,30	R\$ 300.635.822,30	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 27.323.162,17	R\$ 27.544.534,01	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 299.531,26	R\$ 75.287,33	0,4800	0,5700	0,6900	1,7500%	4,2045%	4,2045%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 53.088.094,00	R\$ 53.538.599,32	(1,4900)	2,7100	0,8500	2,0396%	2,7700%	2,7700%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 488.617.878,32	R\$ 492.367.703,98	(1,2440)	2,4678	0,7674	1,9697%	4,3127%	4,3127%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 370.262.781,85	R\$ 373.319.988,18	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%	
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 28.840.676,76	R\$ 29.159.159,12	(2,4300)	3,1800	1,1000	1,7801%	4,8600%	4,8600%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 92.691.813,36	R\$ 93.399.609,36	(1,2400)	2,5000	0,7600	1,9983%	4,1400%	4,1400%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.807.769,26	R\$ 112.387.683,11	(3,8700)	4,4400	(0,3700)	0,0267%	-6,9600%	-6,9600%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 21.841,78	R\$ 22.029,78	(0,3600)	1,6400	0,8600	2,1451%	4,5300%	4,5300%	
SANTANDER CP CRESCIMENT INST	R\$ 99.044.974,59	R\$ 107.652.513,38	0,6774	0,5966	0,7678	2,0557%	2,2638%	NC	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 25.973.110,33	R\$ 34.040.408,86	0,6100	0,6800	0,8400	2,1450%	6,2900%	6,2900%	
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ 7.702.655,51	R\$ 34.855.852,12	-	0,6065	0,3388	0,9474%	0,9474%	NC	
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 53.345.940,97	R\$ 61.624.409,75	0,6300	0,6400	0,8100	2,0944%	5,1600%	5,1600%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 131.098.727,06	R\$ 133.951.797,73	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.115.021.657,97	R\$ 2.132.743.261,22							

Quadro 1.

1.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 97.799.184,35	R\$ 101.786.211,51	(5,5414)	(0,8673)	4,0767	-2,5432%	-4,7614%	-4,7614%	
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ -	R\$ 50.145.820,90	-	-	0,2900	0,2900%	0,2900%	NC	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 147.266.685,61	R\$ 152.999.296,21	(12,5400)	(3,1700)	3,8900	-12,0181%	-9,8400%	-9,8400%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 229.424.304,27	R\$ 227.851.827,32	(13,0596)	(6,7100)	(0,6854)	-19,4492%	-31,7900%	-31,7900%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 7.886.600,35	R\$ 7.941.806,13	(8,4938)	(4,3200)	0,7000	-11,8341%	-19,0262%	-19,0262%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.877.804,75	R\$ 13.828.108,17	(0,2881)	(0,3007)	(0,3581)	-0,9439%	13,6198%	13,6198%	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ -	R\$ 23.614.189,43	-	-	-	0,0000%	0,0000%	0,0000%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANT	R\$ 11.342.056,59	R\$ 11.997.742,88	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 76.046.531,25	R\$ 76.750.860,53	(6,9600)	(2,1900)	0,9300	-8,1513%	-18,2600%	-18,2600%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 156.101.613,81	R\$ 157.617.379,80	(7,5400)	(1,4400)	0,9700	-7,9875%	-8,5100%	-8,5100%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 33.466.421,25	R\$ 34.095.419,66	(8,7800)	(2,0600)	1,8800	-8,9795%	-16,6400%	-16,6400%	
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 100.650.594,60	R\$ 104.186.789,94	(11,0000)	(2,3200)	3,5100	-10,0134%	-10,0600%	-10,0600%	
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 103.897.372,21	R\$ 109.658.401,60	7,6300	(0,5100)	5,5400	13,0134%	32,7400%	32,7400%	
SANTANDER CRESC SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 12.064,20	R\$ 12.327,77	(8,5268)	(4,1435)	2,1847	-10,4014%	-20,5854%	-20,5854%	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 27.147.276,78	R\$ 28.619.821,87	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 74.798.444,07	R\$ 76.459.160,97	(6,7900)	(3,7900)	2,2200	-8,3318%	-9,7400%	-9,7400%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 78.132.767,17	R\$ 80.861.753,24	(4,9000)	(2,6700)	3,4900	-4,2088%	-12,7400%	-12,7400%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 25.543.886,19	R\$ 26.804.565,85	(11,5680)	(5,6715)	4,9353	-12,4666%	-20,3621%	-20,3621%	
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 40.140.785,00	R\$ 41.113.518,85	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 7.836.757,83	R\$ 8.130.314,94	(8,2413)	(2,7265)	3,7459	-7,3996%	-19,2064%	-19,2064%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.309.964,96	R\$ 9.256.195,85	(0,5157)	(0,5050)	(0,5775)	-1,5898%	-2,7315%	NC	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 16.548.724,79	R\$ 17.242.753,11	(9,3469)	(3,3841)	4,1938	-8,7415%	-18,3646%	-18,3646%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.551.401,37	R\$ 97.670.543,70	(8,3800)	3,5100	0,1200	-5,0503%	-12,8200%	-12,8200%	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 37.533.248,57	R\$ 38.807.964,00	(6,8300)	0,0600	3,4000	-3,6044%	-6,5000%	-6,5000%	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 22.605.221,39	-	-	(0,7200)	-0,7200%	-1,8900%	-1,8900%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 34.255.367,85	R\$ 35.164.933,77	(8,1200)	(0,6400)	2,6600	-6,2797%	-11,4900%	-11,4900%	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.426.569.857,82	R\$ 1.555.222.929,39							

Quadro 2.



Relatório de Anual Investimentos - 2021

003

1.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 24.982.199,35	R\$ 25.980.390,21	6,7610	(0,7968)	3,9956	10,1421%	32,3477%	32,3477%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 152.880.147,40	R\$ 154.235.894,63	7,8592	(2,0098)	0,8868	6,6287%	23,3375%	23,3375%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC EIA	R\$ 31.713.226,62	R\$ 32.233.514,06	7,5613	(2,3300)	1,6400	6,7780%	28,4800%	28,4800%
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 163.204.312,77	R\$ 168.086.619,73	10,6509	(1,2881)	2,9915	12,4931%	33,4942%	33,4942%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 157.840.206,03	R\$ 163.286.774,60	8,5200	0,2100	3,4500	12,4997%	33,9200%	33,9200%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 39.523.473,43	R\$ 41.389.565,28	7,3109	(0,7084)	4,7214	11,5814%	22,0687%	22,0687%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 39.539.540,73	R\$ 34.417.308,95	10,8973	0,1499	(12,9547)	-3,3244%	-0,5777%	-0,5777%
TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	R\$ 609.683.106,33	R\$ 619.630.067,46						
TOTAL GERAL	R\$ 4.151.274.622,12	R\$ 4.307.596.258,07						

Quadro 3.

1.4 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 176.185.240,52	R\$ 178.402.400,81	1,7812	1,4796	1,2584	4,587%	17,1930%	17,1930%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 184.002.716,08	R\$ 186.335.713,27	1,7907	1,4891	1,2679	4,616%	17,3249%	17,3249%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 189.532.823,63	R\$ 191.980.923,04	1,8145	1,5129	1,2916	4,690%	17,6553%	17,6553%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 191.093.165,04	R\$ 193.516.093,32	1,7907	1,4891	1,2679	4,616%	17,3251%	17,3251%
TOTAL GERAL	R\$ 740.813.945,27	R\$ 750.235.130,45						

Quadro 4.

1.5 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45
VALOR ATUAL	R\$ 178.402.400,81	R\$ 186.335.713,27	R\$ 191.980.923,04	R\$ 193.516.093,32
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 5.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

004

1.6 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	30/11/2021	31/12/2021
CVS - A	R\$ 1.065.466,26	R\$ 1.048.518,02
CVS - B	R\$ 6.893.246,70	R\$ 6.783.585,05
CVS - C	R\$ 138.214,44	R\$ 136.015,88
CVS - D	R\$ 755.936,28	R\$ 743.910,42
TOTAL	R\$ 8.852.863,68	R\$ 8.712.029,37

Quadro 6.

1.7 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/21	R\$ 30.247,09	R\$ 145.084,72	R\$ 175.331,81
fev/21	R\$ 29.827,12	R\$ 145.084,72	R\$ 174.911,84
mar/21	R\$ 29.407,16	R\$ 145.084,72	R\$ 174.491,88
abr/21	R\$ 28.978,18	R\$ 145.084,72	R\$ 174.062,90
mai/21	R\$ 28.567,21	R\$ 145.084,72	R\$ 173.651,93
jun/21	R\$ 28.147,25	R\$ 145.084,72	R\$ 173.231,97
jul/21	R\$ 27.727,27	R\$ 145.084,72	R\$ 172.811,99
ago/21	R\$ 27.307,30	R\$ 145.084,72	R\$ 172.392,02
set/21	R\$ 26.887,32	R\$ 145.084,32	R\$ 171.971,64
out/21	R\$ 26.887,32	R\$ 145.084,32	R\$ 171.971,64
nov/21	R\$ 26.047,38	R\$ 145.084,72	R\$ 171.132,10
dez/21	R\$ 25.639,76	R\$ 145.100,57	R\$ 170.740,33
TOTAL	R\$ 335.670,36	R\$ 1.741.031,69	R\$ 2.076.702,05

Quadro 7.

1.8 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2021 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
mar/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
abr/21	R\$ 87.271,44	R\$ 100.364,40	R\$ 187.635,84
mai/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
jun/21	R\$ -	R\$ 301.093,20	R\$ 301.093,20
jul/21	R\$ 43.635,72	R\$ -	R\$ 43.635,72
ago/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
set/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
out/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
nov/21	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
dez/21	R\$ 218.178,60	R\$ 200.728,80	R\$ 418.907,40
TOTAL	R\$ 349.085,76	R\$ 903.279,60	R\$ 1.252.365,36

Quadro 8.

1.9 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/11/2021	31/12/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.151.274.622,12	R\$ 4.307.596.258,07	83,8868%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 740.813.945,27	R\$ 750.235.130,45	14,6102%
TÍTULOS CVS	R\$ 8.852.863,68	R\$ 8.712.029,37	0,1697%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 68.293.435,00	1,3300%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 16.176.311,25	R\$ 173.785,24	0,0034%
TOTAL	R\$ 4.978.953.067,50	R\$ 5.135.010.638,13	100,00%

Quadro 9.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

005

1.10 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
dez/20	R\$ 4.808.000.009,11	2,28%	-7,07%	-7,07%
jan/21	R\$ 4.691.638.612,35	-2,42%	-2,42%	-8,75%
fev/21	R\$ 4.654.824.437,71	-0,78%	-3,19%	-9,45%
mar/21	R\$ 4.764.067.642,49	2,35%	-0,91%	1,67%
abr/21	R\$ 4.868.735.602,27	2,20%	1,26%	2,42%
mai/21	R\$ 4.985.703.862,07	2,40%	3,70%	3,69%
jun/21	R\$ 5.049.248.442,12	1,27%	5,02%	4,38%
jul/21	R\$ 5.055.266.764,76	0,12%	5,14%	3,12%
ago/21	R\$ 5.028.755.971,61	-0,52%	4,59%	4,82%
set/21	R\$ 4.986.467.576,78	-0,84%	3,71%	7,20%
out/21	R\$ 4.928.789.222,04	-1,16%	2,51%	8,34%
nov/21	R\$ 4.978.953.067,50	1,02%	3,56%	5,92%
dez/21	R\$ 5.135.010.638,13	3,13%	6,80%	6,80%

Quadro 10.

1.11 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 12/2020		R\$ 4.808.000.009,11	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 584.279,15	R\$ 82.104.432,44	R\$ -81.520.153,29
02/2021	R\$ 40.864.605,59	R\$ 44.974.382,51	R\$ -4.109.776,92
03/2021	R\$ 41.485.170,47	R\$ 10.665.619,53	R\$ 30.819.550,94
04/2021	R\$ 41.308.639,76	R\$ 10.074.221,86	R\$ 31.234.417,90
05/2021	R\$ 41.318.216,48	R\$ 14.353.928,89	R\$ 26.964.287,59
06/2021	R\$ 50.044.250,01	R\$ 10.611.950,64	R\$ 39.432.299,37
07/2021	R\$ 47.181.791,70	R\$ 9.896.860,10	R\$ 37.284.931,60
08/2021	R\$ 26.480.105,00	R\$ 11.394.062,81	R\$ 15.086.042,19
09/2021	R\$ 41.572.477,52	R\$ 10.674.589,38	R\$ 30.897.888,14
10/2021	R\$ 43.880.558,88	R\$ 10.627.718,85	R\$ 33.252.840,03
11/2021	R\$ 54.114.701,48	R\$ 14.772.501,88	R\$ 39.342.199,60
12/2021	R\$ 94.087.378,25	R\$ 11.974.925,91	R\$ 82.112.452,34
Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 5.135.010.638,13	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,9536 %	0,9536 %	1,4852 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 46.213.649,53	R\$ 46.213.649,53	R\$ 73.945.118,29
Resultado em %	-13,0155 %	-13,0155 %	+0,3051 %
Resultado em R\$	R\$ -731.506.030,76	R\$ -731.506.030,76	R\$ +15.370.857,46

Quadro 11.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

006

2. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.138.980,88	R\$ 5.181.412,73	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 90.312,37	R\$ 91.089,75	(0,3600)	1,6400	0,8600	2,1451%	4,5300%	4,5300%	
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.014.068,02	R\$ 2.036.309,03	(2,4300)	3,1800	1,1000	1,7801%	4,8600%	4,8600%	
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF LP	R\$ 75.779,65	R\$ 75.497,45	(3,8700)	4,4400	(0,3700)	0,0267%	-6,9600%	-6,9600%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 75.668,32	R\$ 75.590,14	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%	
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 362.174,91	R\$ 364.732,60	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%	
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ -	R\$ 165.527,34	-	-	0,3388	0,3388%	0,3388%	NC	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 7.756.984,15	R\$ 7.990.159,04							

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 437.786,25	R\$ 441.840,95	(6,9600)	(2,1900)	0,9300	-8,1513%	-18,2600%	-18,2600%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.105.241,25	R\$ 1.097.665,91	(13,0596)	(6,7100)	(0,6854)	-19,4492%	-31,7869%	-31,7869%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 452.491,70	R\$ 478.650,33	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC	
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.806.814,71	R\$ 1.869.922,31	(4,9000)	(2,6700)	3,4900	-4,2088%	-12,7400%	-12,7400%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 107.239,32	R\$ 109.838,06	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 745.988,32	R\$ 786.452,84	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%	
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 161.568,48	R\$ 170.527,33	7,6300	(0,5100)	5,5400	13,0134%	32,7400%	32,7400%	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.817.130,03	R\$ 4.954.897,73							

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO						
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.642.623,01	R\$ 1.699.304,75	8,5200	0,2100	3,4500	12,4997%	33,9200%	33,9200%	
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.642.623,01	R\$ 1.699.304,75							

TOTAL GERAL	R\$ 14.216.737,19	R\$ 14.644.361,52						
--------------------	--------------------------	--------------------------	--	--	--	--	--	--

Quadro 12.

2.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.520.893,95	R\$ 2.554.337,82	1,8145	1,5129	1,2916	4,6899%	17,6552%	17,6552%
TOTAL GERAL	R\$ 2.520.893,95	R\$ 2.554.337,82						

Quadro 13.

2.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	30/11/2021	31/12/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 7.756.984,15	R\$ 7.990.159,04
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.817.130,03	R\$ 4.954.897,73
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.642.623,01	R\$ 1.699.304,75
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.520.893,95	R\$ 2.554.337,82
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 16.555.960,29	R\$ 17.198.699,34

Quadro 14.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

007

2.4 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
Saldo dos Investimentos em 12/2020			R\$ 15.166.901,59
01/2021	R\$ 286.790,86	R\$ 0,00	R\$ 286.790,86
02/2021	R\$ 143.097,24	R\$ 0,00	R\$ 143.097,24
03/2021	R\$ 143.973,76	R\$ 0,00	R\$ 143.973,76
04/2021	R\$ 144.001,52	R\$ 0,00	R\$ 144.001,52
05/2021	R\$ 144.070,46	R\$ 0,00	R\$ 144.070,46
06/2021	R\$ 144.136,78	R\$ 0,00	R\$ 144.136,78
07/2021	R\$ 174.168,74	R\$ 0,00	R\$ 174.168,74
08/2021	R\$ 152.615,42	R\$ 0,00	R\$ 152.615,42
09/2021	R\$ 152.252,38	R\$ 0,00	R\$ 152.252,38
10/2021	R\$ 165.653,56	R\$ 0,00	R\$ 165.653,56
11/2021	R\$ 169.762,40	R\$ 0,00	R\$ 169.762,40
12/2021	R\$ 164.966,52	R\$ 0,00	R\$ 164.966,52
Saldo dos Investimentos em 12/2021			R\$ 17.198.699,34

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

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,2874 %	0,2874 %	1,7691 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 46.308,11	R\$ 46.308,11	R\$ 296.101,68
Resultado em %	-13,5896 %	-13,5896 %	+0,5857 %
Resultado em R\$	R\$ -2.537.504,90	R\$ -2.537.504,90	R\$ +99.193,94

Quadro 15.

3. RECURSOS DO MPE – FPREV

3.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.616.402,95	R\$ 7.679.290,50	(0,6612)	0,9059	(0,8257)	-0,5890%	-0,1090%	-0,1090%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.225.944,68	R\$ 40.540.838,53	(0,7200)	1,4500	0,7800	1,5052%	-0,1600%	-0,1600%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 77.983.961,20	R\$ 78.696.812,90	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.266.091,36	R\$ 3.289.156,56	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.651.313,10	R\$ 1.664.692,02	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FIA RF	R\$ 1.627.815,14	R\$ 1.626.133,37	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 132.371.528,43	R\$ 133.496.923,88						
FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 22.638.699,25	R\$ 23.288.292,57	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.265.459,96	R\$ 1.296.125,92	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 7.154.927,20	R\$ 7.543.030,69	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
BB AÇÕES VALOR	R\$ 20.179.779,54	R\$ 21.002.458,48	(5,5414)	(0,8673)	4,0767	-2,5432%	-4,7614%	-4,7614%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 51.238.865,95	R\$ 53.129.907,66						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 8.151,70	R\$ 3.913.565,18						
TOTAL RECURSOS	R\$ 183.618.546,08	R\$ 190.540.396,72						

Quadro 16.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

008

3.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 12/2020	RS 169.242.211,10
------------------------------------	-------------------

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	RS 3.008.450,20	RS 8.065,16	RS 3.000.385,04
02/2021	RS 1.585.217,06	RS 1.642,15	RS 1.583.574,91
03/2021	RS 1.564.682,30	RS 17.772,47	RS 1.546.909,83
04/2021	RS 1.594.346,58	RS 9.707,31	RS 1.584.639,27
05/2021	RS 1.573.220,64	RS 41.257,15	RS 1.531.963,49
06/2021	RS 1.959.057,05	RS 12.521,07	RS 1.946.535,98
07/2021	RS 2.023.578,91	RS 55.617,86	RS 1.967.961,05
08/2021	RS 1.638.039,45	RS 23.802,84	RS 1.614.236,61
09/2021	RS 1.647.557,59	RS 3.779,70	RS 1.643.777,89
10/2021	RS 1.646.387,89	RS 23.802,84	RS 1.622.585,05
11/2021	RS 3.285.936,72	RS 81.114,00	RS 3.204.822,72
12/2021	RS 3.913.495,83	RS 32.084,33	RS 3.881.411,50

Saldo dos Investimentos em 12/2021	RS 190.540.396,72
------------------------------------	-------------------

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
---------------------	----------	--------------------	------

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	-2,1312 %	-2,1312 %	1,6558 %
Rentabilidade em R\$	RS -3.830.617,72	RS -3.830.617,72	RS 3.040.439,14
Resultado em %	-15,6735 %	-15,6735 %	+0,4738 %
Resultado em R\$	RS -32.647.074,45	RS -32.647.074,45	RS +880.282,08

Quadro 17.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

009

4. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 7.773.369,25	R\$ 7.837.552,85	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%
BRADESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.574.531,11	R\$ 8.641.653,63	(0,7200)	1,4500	0,7800	1,5052%	-0,1600%	-0,1600%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.496.445,81	R\$ 9.569.604,29	(1,2800)	2,4700	0,7700	1,9373%	3,6700%	3,6700%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.165.427,15	R\$ 1.174.869,42	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 1.148.861,72	R\$ 1.147.674,78	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.079.189,88	R\$ 2.093.873,16	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
TOTAL	R\$ 30.237.824,92	R\$ 30.465.228,13						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 850.905,58	R\$ 871.525,63	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	R\$ 823.044,75	R\$ 846.661,14	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.568.351,97	R\$ 3.761.909,47	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇORES LIVRE QUA	R\$ 13.934,67	R\$ 14.740,24	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 1.734.677,1400	-	-	(0,7200)	-0,7200%	-1,8900%	-1,8900%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ -	R\$ 1.734.806,6870	-	-	-	0,0000%	0,0000%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 5.256.236,97	R\$ 8.964.320,31						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.726,09	R\$ -
TOTAL RECURSOS	R\$ 35.496.787,98	R\$ 39.429.548,44

Quadro 18.

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 6.283,41	R\$ 77.294,71	R\$ -71.011,30
02/2021	R\$ 1.003.038,47	R\$ 51.465,27	R\$ 951.573,20
03/2021	R\$ 992.747,96	R\$ 51.465,27	R\$ 941.282,69
04/2021	R\$ 999.548,81	R\$ 39.463,54	R\$ 960.085,27
05/2021	R\$ 1.057.911,85	R\$ 96.855,31	R\$ 961.056,54
06/2021	R\$ 1.062.228,59	R\$ 51.465,27	R\$ 1.010.763,32
07/2021	R\$ 1.085.187,70	R\$ 51.462,27	R\$ 1.033.725,43
08/2021	R\$ 1.172.401,85	R\$ 51.465,27	R\$ 1.120.936,58
09/2021	R\$ 1.179.063,91	R\$ 12.001,73	R\$ 1.167.062,18
10/2021	R\$ 1.172.130,12	R\$ 51.465,27	R\$ 1.120.664,85
11/2021	R\$ 1.220.800,58	R\$ 90.180,34	R\$ 1.130.620,24
12/2021	R\$ 3.547.742,31	R\$ 80.855,04	R\$ 3.466.887,27
Saldo dos Investimentos em 12/2020			R\$ 25.328.013,69
Saldo dos Investimentos em 12/2021			R\$ 39.429.548,44

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

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	1,0320 %	1,0320 %	1,3124 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 307.888,48	R\$ 307.888,48	R\$ 465.873,19
Resultado em %	-12,9480 %	-12,9480 %	+0,1344 %
Resultado em R\$	R\$ -4.461.600,01	R\$ -4.461.600,01	R\$ +48.275,74

Quadro 19.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARÃES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRÉ LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

010

5. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 162.612.742,86	R\$ 163.955.412,81	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.129.669,27	R\$ 51.597.045,77	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 170.104.422,44	R\$ 171.305.703,28	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
BRABESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.559.379,57	R\$ 1.572.013,64	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 1.849.896,21	R\$ 1.847.985,00	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
BRABESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 41.401.091,30	R\$ 41.360.457,88	(1,2800)	2,4700	0,7700	1,9373%	3,6700%	3,6700%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 428.657.201,65	R\$ 431.638.618,38						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 2.762.118,40	R\$ 2.829.052,97	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 19.035.900,76	R\$ 20.068.461,87	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
BRABESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 4.039.107,04	R\$ 4.155.004,91	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 8.778.681,23	R\$ 9.286.178,35	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 2.959.907,11	-	-	(0,7200)	-0,7200%	-0,7200%	NC
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	R\$ 2.960.078,94	-	-	-	0,0000%	-3,7457%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 34.615.807,43	R\$ 42.258.684,15						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 30.436.642,75	R\$ 31.652.771,81	6,7610	(0,7968)	3,9956	10,1421%	32,3477%	32,3477%
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 30.436.642,75	R\$ 31.652.771,81						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 33.268,74	R\$ 1.268.056,82						
TOTAL	R\$ 493.742.920,57	R\$ 506.818.131,16						

Quadro 20.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 12/2020		R\$ 451.531.332,20	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 3.459.800,94	R\$ 280.567,30	R\$ 3.179.233,64
02/2021	R\$ 3.471.253,44	R\$ 284.979,37	R\$ 3.186.274,07
03/2021	R\$ 3.427.904,40	R\$ 367.719,45	R\$ 3.060.184,95
04/2021	R\$ 3.574.036,92	R\$ 317.977,95	R\$ 3.256.058,97
05/2021	R\$ 3.591.371,99	R\$ 308.689,08	R\$ 3.282.682,91
06/2021	R\$ 3.620.988,47	R\$ 346.178,51	R\$ 3.274.809,96
07/2021	R\$ 3.670.676,51	R\$ 315.553,25	R\$ 3.355.123,26
08/2021	R\$ 3.690.680,27	R\$ 318.681,54	R\$ 3.371.998,73
09/2021	R\$ 3.738.023,51	R\$ 317.532,32	R\$ 3.420.491,19
10/2021	R\$ 3.756.511,37	R\$ 317.532,32	R\$ 3.438.979,05
11/2021	R\$ 3.805.215,10	R\$ 331.580,86	R\$ 3.473.634,24
12/2021	R\$ 7.253.729,28	R\$ 456.014,72	R\$ 6.797.714,56
Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 506.818.131,16	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	2,5975 %	2,5975 %	1,2714 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 12.189.613,43	R\$ 12.189.613,43	R\$ 6.277.496,03
Resultado em %	-11,5991 %	-11,5991 %	+0,0939 %
Resultado em R\$	R\$ -63.108.243,18	R\$ -63.108.243,18	R\$ +468.920,17

Quadro 21.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARÃES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

011

6. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 41.674.722,09	R\$ 42.018.824,25	(0,6612)	0,9059	0,8257	1,0664%	-0,1090%	-0,1090%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 31.815.161,61	R\$ 32.039.840,92	(1,2527)	2,4291	0,7062	1,8603%	4,6456%	4,6456%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.229.616,44	R\$ 21.423.676,45	(1,6263)	1,7339	0,9141	0,9942%	-0,3984%	-0,3984%
BRADERCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 301.989,72	R\$ 304.436,43	0,5800	0,6400	0,8100	2,0436%	4,9400%	4,9400%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 298.055,53	R\$ 297.747,60	(3,2300)	3,2400	(0,1000)	-0,1946%	-4,8600%	-4,8600%
BRADERCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.619.299,10	R\$ 7.677.996,48	(1,2800)	2,4700	0,7700	1,9373%	3,6700%	3,6700%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 102.938.844,49	R\$ 103.762.522,13						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 746.220,00	R\$ 764.303,19	(13,2500)	(3,7300)	2,4200	-14,4647%	-22,5000%	-22,5000%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.551.602,97	R\$ 3.744.251,95	7,5500	(0,5100)	5,4200	12,8010%	32,1100%	32,1100%
BRADERCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 429.565,78	R\$ 441.891,72	(7,7600)	(3,5900)	2,8700	-8,5192%	-15,2800%	-15,2800%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇORES LIVRE QUANTIT.	R\$ 8.778.681,23	R\$ 9.286.178,35	(6,0249)	(0,5234)	5,7810	-1,1125%	-4,8165%	NC
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 859.592,91	-	-	(1,8900)	-1,8900%	-1,8900%	-1,8900%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	R\$ 859.642,80	-	-	-	0,0000%	1,8900%	0,0000%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 13.506.069,98	R\$ 15.955.860,92						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/11/2021	31/12/2021	out/21	nov/21	dez/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 582.119,38	R\$ 605.378,59	6,7610	(0,7968)	3,9956	10,1421%	32,3477%	32,3477%
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 582.119,38	R\$ 605.378,59						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 50.000,00	R\$ -						
TOTAL	R\$ 117.077.033,85	R\$ 120.323.761,64						

Quadro 22.

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 12/2020		R\$ 111.881.662,84	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 7.943,52	R\$ 0,00	R\$ 7.943,52
02/2021	R\$ 1.040.178,80	R\$ 0,00	R\$ 1.040.178,80
03/2021	R\$ 523.658,87	R\$ 0,00	R\$ 523.658,87
04/2021	R\$ 4.964,70	R\$ 0,00	R\$ 4.964,70
05/2021	R\$ 1.036.389,86	R\$ 67.687,34	R\$ 968.702,52
06/2021	R\$ 521.558,25	R\$ 32.206,97	R\$ 489.351,28
07/2021	R\$ 523.292,11	R\$ 39.670,93	R\$ 483.621,18
08/2021	R\$ 587.761,57	R\$ 32.116,97	R\$ 555.644,60
09/2021	R\$ 596.685,79	R\$ 32.206,97	R\$ 564.478,82
10/2021	R\$ 621.603,17	R\$ 7.463,96	R\$ 614.139,21
11/2021	R\$ 1.288.278,50	R\$ 56.027,71	R\$ 1.232.250,79
12/2021	R\$ 1.716.449,08	R\$ 39.670,93	R\$ 1.676.778,15
Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 120.323.761,64	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,2445 %	0,2445 %	1,3410 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 280.386,36	R\$ 280.386,36	R\$ 1.569.949,64
Resultado em %	-13,6266 %	-13,6266 %	+0,1626 %
Resultado em R\$	R\$ -18.125.363,47	R\$ -18.125.363,47	R\$ +192.611,75

Quadro 23.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

012

7. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 12/2020		R\$ 5.581.150.130,53	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
01/2021	R\$ 7.353.548,08	R\$ 82.470.359,61	R\$ -75.116.811,53
02/2021	R\$ 48.107.390,60	R\$ 45.312.469,30	R\$ 2.794.921,30
03/2021	R\$ 48.138.137,76	R\$ 11.102.576,72	R\$ 37.035.561,04
04/2021	R\$ 47.625.538,29	R\$ 10.441.370,66	R\$ 37.184.167,63
05/2021	R\$ 48.721.181,28	R\$ 14.868.417,77	R\$ 33.852.763,51
06/2021	R\$ 57.352.219,15	R\$ 11.054.322,46	R\$ 46.297.896,69
07/2021	R\$ 54.658.695,67	R\$ 10.359.164,41	R\$ 44.299.531,26
08/2021	R\$ 33.721.603,56	R\$ 11.820.129,43	R\$ 21.901.474,13
09/2021	R\$ 48.886.060,70	R\$ 11.040.110,10	R\$ 37.845.950,60
10/2021	R\$ 51.242.844,99	R\$ 11.027.983,24	R\$ 40.214.861,75
11/2021	R\$ 63.884.694,78	R\$ 15.331.404,79	R\$ 48.553.289,99
12/2021	R\$ 110.683.761,27	R\$ 12.583.550,93	R\$ 98.100.210,34
Saldo dos Investimentos em 12/2021		R\$ 6.009.321.175,43	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,0611 %	10,0611 %	0,7300 %
Juros	5,4500 %	5,4500 %	0,4432 %
Meta	16,0594 %	16,0594 %	1,1764 %
Rentabilidade em %	0,9761 %	0,9761 %	1,4693 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 55.207.228,19	R\$ 55.207.228,19	R\$ 85.594.977,97
Resultado em %	-12,9962 %	-12,9962 %	+0,2894 %
Resultado em R\$	R\$ -852.385.816,77	R\$ -852.385.816,77	R\$ +17.060.141,14

Quadro 24.

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.

Nota 2: Foram revisados os valores de **Receitas** e **Despesas**, com base nos Controles da GERA/COFIN, para o exercício de 2021.

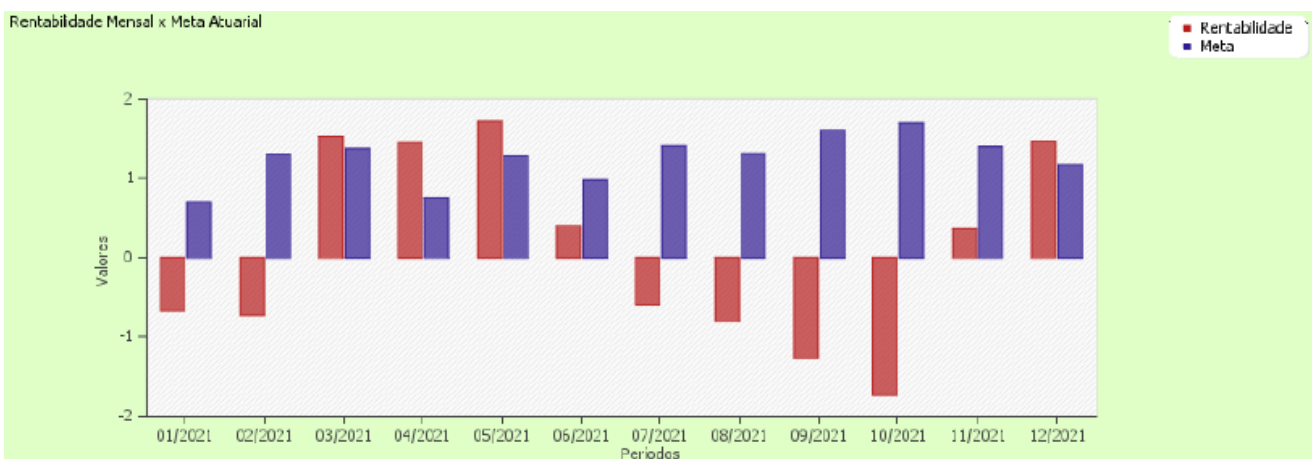


Gráfico 1.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

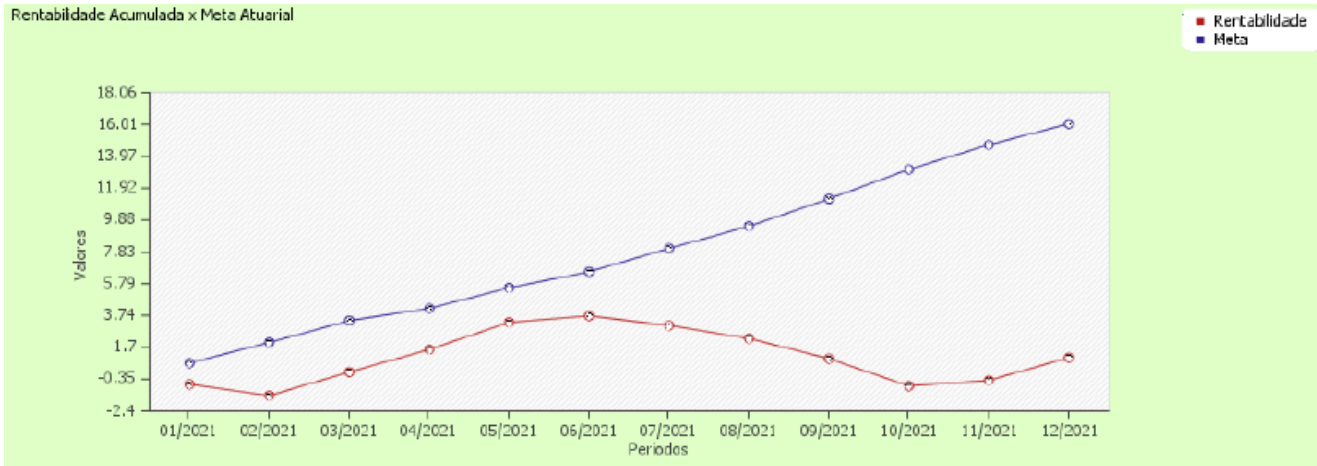


Gráfico 2.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTI3NDU4



8. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

8.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 11.753.073,29	R\$ 20.700.266,91
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 6.054.723,75	R\$ 6.259.794,93
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 27.382.766,13	R\$ 3.320.989,92
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 264.295,10	R\$ 264.295,10
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 23.432.002,70
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA - COMPREV	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 45.454.859,29	R\$ 53.977.349,58

Quadro 25.

8.2 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 4.723,53	R\$ 24.930.709,80
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 1,00	R\$ 453,96
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 24.806,63	R\$ 24.806,63
TOTAL	R\$ 29.531,16	R\$ 24.955.970,39

Quadro 26.

8.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 803.859,92
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ 803.859,92

Quadro 27.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARÃES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



8.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 449.391,24	R\$ 451.032,00
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 58.132,69	R\$ 2.075,62
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 179,35	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 507.703,28	R\$ 453.108,62

Quadro 28.

8.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 985.698,89	R\$ 3.172.933,30
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 420.215,41	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 6.066.281,79
TOTAL	R\$ 1.405.914,30	R\$ 9.239.215,09

Quadro 29.

8.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.376.088,17	R\$ 12.279.664,11
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 602.764,51	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 547.786,19
TOTAL	R\$ 6.978.853,68	R\$ 12.827.450,30

Quadro 30.

8.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.808.646,58	R\$ 6.709.308,76
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 1.946.837,55	R\$ 705,87
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 28.167,48	R\$ -
TOTAL	R\$ 4.783.651,61	R\$ 6.710.014,63

TOTAL GERAL FFIN	R\$ 59.160.513,32	R\$ 108.966.968,53
-------------------------	--------------------------	---------------------------

Quadro 31.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

9.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 5.448.371,83	R\$ 1.143,62
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 45.106.086,68	R\$ 40.560.407,77
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 50.554.459,51	R\$ 40.561.552,39

Quadro 32.

9.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 35.718,27
TOTAL	R\$ -	R\$ 35.718,27

Quadro 33.

9.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 56.848,80	R\$ 61.970,46
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 56.848,80	R\$ 61.971,46

Quadro 34.

9.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ 605.835,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 196.993,79	R\$ -
TOTAL	R\$ 196.993,79	R\$ 605.835,00

Quadro 35.

9.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/11/2021	31/12/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 74.213,96	R\$ 199.434,03
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 74.213,96	R\$ 199.434,03

TOTAL GERAL	R\$ 50.882.516,06	R\$ 41.464.511,15
--------------------	--------------------------	--------------------------

Quadro 36.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

017

10. RESUMO DAS MOVIMENTAÇÕES FINANCEIRAS

10.1 RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RENDIMENTO	SALDO	VARIAÇÃO (%)
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRFM 1 FIC FI	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.057.946,27	R\$ -	R\$ 383.478,94	R\$ 445.870,34	R\$ 7.120.337,67	6,3173%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA B5+ TP	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 317.176.278,77	R\$ 170.337.220,66	R\$ 12.169,57	R\$ 22.227.798,96	R\$ 509.729.128,82	7,0080%
SANTANDER FIC IMA B-5	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
SANTANDER FIC IMA B INST. TP RF LP	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
BRADESCO FI RF IRFM 1 TP	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 524.472.731,59	R\$ 18.819.302,36	R\$ 71.266.349,48	R\$ 20.342.019,51	R\$ 492.367.703,98	3,8786%
CAIXA FI BRASIL IMA B5+ TP RF LP	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
CAIXA FI BRASIL 2020 V TP RF	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 54.731.103,21	R\$ -	R\$ 2.710.481,70	R\$ 1.517.977,81	R\$ 53.538.599,32	2,7735%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 831.659.583,30	R\$ 13.058.128,98	R\$ 201.400.000,00	R\$ (2.764.823,19)	R\$ 640.552.889,09	-0,3324%
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.849.311,66	R\$ 30.000.000,00	R\$ 19.442.968,51	R\$ 3.993.266,21	R\$ 93.399.609,36	5,0644%
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 94.808.812,56	R\$ 54.584.144,36	R\$ 30.000.000,00	R\$ (6.929.776,36)	R\$ 112.463.180,56	-7,3092%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 60.799.000,01	R\$ 111.772.763,08	R\$ 30.063.249,42	R\$ (3.561.585,05)	R\$ 138.946.928,62	-5,8580%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 89.848.523,89	R\$ 517.958.582,98	R\$ 538.826.959,79	R\$ 1.476.090,03	R\$ 70.456.237,11	1,6429%
BRADESCO FI REF. DI FED. EXTRA	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	R\$ -	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.806.397,84	R\$ -	R\$ 4.300.559,16	R\$ 2.102.219,97	R\$ 58.608.058,65	3,4572%
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 9.324.667,93	R\$ 141.424.079,82	R\$ 113.763.974,74	R\$ 1.070.775,56	R\$ 38.055.548,57	11,4833%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 66.310.584,66	R\$ 98.068,57	R\$ 16.974.330,79	R\$ (251.830,28)	R\$ 49.182.492,16	-0,3798%
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 582.852.669,05	R\$ 23.331.898,77	R\$ 180.053.434,89	R\$ (3.366.072,59)	R\$ 422.765.060,34	-0,5775%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 64.400.324,94	R\$ -	R\$ 64.362.829,49	R\$ 75.624,08	R\$ 113.119,53	0,1174%
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.750.989,01	R\$ -	R\$ -	R\$ 1.444.479,14	R\$ 31.195.468,15	4,8552%
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ -	R\$ 60.472.572,27	R\$ -	R\$ 1.151.837,48	R\$ 61.624.409,75	1,9047%
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ -	R\$ 105.472.230,69	R\$ -	R\$ 2.180.282,69	R\$ 107.652.513,38	2,0672%
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ -	R\$ 33.472.230,68	R\$ -	R\$ 568.178,18	R\$ 34.040.408,86	1,6975%
BTG PACTUAL CRED CORP FIC FI RF CP	R\$ -	R\$ 34.804.274,91	R\$ -	R\$ 217.104,55	R\$ 35.021.379,46	0,6238%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.872.848.924,69	R\$ 1.315.605.498,13	R\$ 1.273.560.786,48	R\$ 41.939.437,04	R\$ 2.956.833.073,38	1,4599%

Quadro 37

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARÃES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

018

10.1 RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÃO	RESGATE	RENDIMENTO	SALDO	VARIAÇÃO (%)
BRDESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 46.127.497,79	R\$ 51.116.257,48	R\$ 65.715.541,26	-R\$ 2.796.363,67	R\$ 28.731.850,34	-6,062%
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 27.767.520,90	R\$ -	R\$ 27.978.435,76	R\$ 210.914,86	R\$ (0,00)	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 10.665.485,89	R\$ 31.000.000,00	R\$ -	-R\$ 7.570.066,23	R\$ 34.095.419,66	-70,977%
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 128.292.874,16	R\$ 41.660.113,08	R\$ -	-R\$ 16.953.691,03	R\$ 152.999.296,21	-13,215%
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 105.039.692,39	R\$ 50.000.000,00	R\$ 28.000.000,00	-R\$ 4.251.022,40	R\$ 122.788.669,99	-4,047%
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 116.324.768,42	R\$ 303.588,63	R\$ 120.670.742,24	-R\$ 3.957.614,81	R\$ -	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 127.693.596,92	R\$ -	R\$ 128.754.103,29	R\$ 1.060.506,37	R\$ -	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 172.274.057,48	R\$ -	R\$ -	-R\$ 14.656.677,68	R\$ 157.617.379,80	-8,508%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 55.061.046,42	R\$ 65.754.103,29	R\$ -	-R\$ 16.628.359,77	R\$ 104.186.789,94	-30,200%
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 245.501.673,60	R\$ -	R\$ 150.000.000,00	-R\$ 18.308.972,12	R\$ 77.192.701,48	-7,458%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ -	R\$ 10.000.000,00	R\$ 4.256,77	-R\$ 2.053.937,10	R\$ 7.941.806,13	-20,539%
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.569.463,88	R\$ 6.721.536,12	R\$ -	R\$ 1.537.108,17	R\$ 13.828.108,17	27,599%
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 315.688.693,03	R\$ 20.000.000,00	R\$ -	-R\$ 106.739.199,80	R\$ 228.949.493,23	-33,812%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 104.192.666,47	R\$ -	R\$ 100.541.342,58	-R\$ 3.651.323,89	R\$ -	-3,504%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 48.825.960,46	R\$ -	R\$ 49.352.919,90	R\$ 526.959,44	R\$ 0,00	1,079%
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 72.548.595,13	R\$ -	R\$ 71.660.113,08	-R\$ 876.154,28	R\$ 12.327,77	-1,208%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 84.713.090,08	R\$ -	R\$ -	-R\$ 8.253.929,11	R\$ 76.459.160,97	-9,743%
OCCAM FIC FIA	R\$ 106.163.566,71	R\$ 29.000.000,00	R\$ 38.000.000,00	-R\$ 14.431.891,16	R\$ 82.731.675,55	-13,594%
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 33.658.143,72	R\$ -	R\$ -	-R\$ 6.853.577,87	R\$ 26.804.565,85	-20,362%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 21.663.161,65	R\$ 33.093.349,04	R\$ -	R\$ 9.767.418,00	R\$ 64.523.928,69	45,088%
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 61.275.973,24	R\$ 71.541.342,58	R\$ -	R\$ 21.418.578,81	R\$ 154.235.894,63	34,954%
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 70.397.488,98	R\$ 60.000.000,00	R\$ -	R\$ 37.689.130,75	R\$ 168.086.619,73	53,538%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 96.225.956,55	R\$ 30.143.086,19	R\$ -	R\$ 38.617.036,61	R\$ 164.986.079,35	40,132%
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 44.046.955,17	R\$ 57.561.020,85	R\$ 60.000.000,00	R\$ 16.630.564,59	R\$ 58.238.540,61	37,756%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ -	R\$ 40.351.685,83	R\$ 12.252.505,29	R\$ 4.134.333,52	R\$ 32.233.514,06	10,246%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ -	R\$ 35.495.209,74	R\$ -	R\$ 5.894.355,54	R\$ 41.389.565,28	16,606%
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ -	R\$ 35.495.209,75	R\$ -	-R\$ 1.077.900,80	R\$ 34.417.308,95	-3,037%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 61.102.484,36	R\$ -	-R\$ 14.118.119,74	R\$ 46.984.364,62	-23,106%
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	R\$ 51.819.785,23	R\$ 10.731.390,42	-R\$ 2.103.739,30	R\$ 38.984.655,51	-4,060%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ -	R\$ 10.000.000,00	R\$ -	-R\$ 1.869.685,06	R\$ 8.130.314,94	-18,697%
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ -	R\$ 93.367.031,84	R\$ -	R\$ 16.461.897,09	R\$ 109.828.928,93	17,631%
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ -	R\$ 121.034.230,58	R\$ -	-R\$ 23.363.686,88	R\$ 97.670.543,70	-19,303%
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ -	R\$ 9.515.813,90	R\$ -	-R\$ 259.618,05	R\$ 9.256.195,85	-2,728%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI ACOES	R\$ -	R\$ 21.000.000,00	R\$ -	-R\$ 3.757.246,89	R\$ 17.242.753,11	-17,892%
CAIXA FIC FIA BRASIL ACOES LIVRE QU	R\$ -	R\$ 31.670.742,24	R\$ -	-R\$ 607.252,09	R\$ 31.063.490,15	-1,917%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 40.000.000,00	R\$ -	-R\$ 1.192.036,00	R\$ 38.807.964,00	-2,9801%
BB AÇÕES QUANTITATIVO	R\$ -	R\$ 50.000.000,00	R\$ -	R\$ 145.820,90	R\$ 50.145.820,90	0,2916%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL	R\$ -	R\$ 24.543.768,62	R\$ -	R\$ 805.227,49	R\$ 25.348.996,11	3,2808%
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 28.363.553,87	R\$ -	-R\$ 204.155,32	R\$ 28.159.398,55	-0,7198%
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 2.099.717.929,04	R\$ 1.211.653.913,22	R\$ 863.661.350,59	R\$ (121.636.368,91)	R\$ 2.334.074.122,76	-5,4120%
TOTAL GERAL	R\$ 4.972.566.853,73	R\$ 2.527.259.411,35	R\$ 2.137.222.137,07	R\$ (79.696.931,87)	R\$ 5.290.907.196,14	-1,4418%

Quadro 38

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldodesejado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



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 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TESOUREO NACIONAL	R\$ 752.788.585,51	12,46%	10,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 752.788.585,51				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.120.337,67	33,89%	22,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 509.729.128,82				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 492.367.703,98				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.538.599,32				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 640.552.889,09				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.399.609,36				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.463.180,56				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 138.946.928,62				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 2.048.118.377,42				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 70.456.237,12	10,58%	13,00%	40,00%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 38.055.548,57				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.608.058,65				
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.182.492,16				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 422.765.060,34				
ITAU INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 113.119,53				
TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 639.180.516,37				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 31.195.468,15	4,46%	3,00%	5,00%	art. 7º, inciso VII, "b"
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 107.652.513,38				
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 61.624.409,75				
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 35.021.379,46				
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.040.408,86				
TOTAL art. 7º, inciso VII, "b"	R\$ 269.534.179,60				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.709.621.658,90	61,38%			

Quadro 39.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

020

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRDESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 28.731.850,34	0,48%	3,00%	30,00%	art 8º, inciso I, "a"
TOTAL art 8º, inciso I, "a"	R\$ 28.731.850,34				
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 38.807.964,00				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.459.160,97				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 122.788.669,99				
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 50.145.820,90				
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.130.314,94				
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.999.296,21				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 46.984.364,62				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 228.949.493,23				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 7.941.806,13				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	R\$ 31.063.490,15				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.242.753,11	23,64%	30,00%	30,00%	art. 8º, inciso II, "a"
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 77.192.701,48				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 157.617.379,80				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 34.095.419,66				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 104.186.789,94				
OCCAM FIC FIA	R\$ 82.731.675,55				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 12.327,77				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 26.804.565,85				
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.670.543,70				
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 28.159.398,55				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 38.984.655,51				
TOTAL art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.428.968.592,06				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 64.523.928,69				
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 25.348.996,11	3,30%	3,00%	3,00%	art. 8º, inciso III
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 109.828.928,93				
TOTAL art. 8º, inciso III	R\$ 199.701.853,73				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.828.108,17				
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.256.195,85	0,38%	2,00%	5,00%	art. 8º, inciso IV, "a"
TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 23.084.304,02				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.680.486.600,15	27,81%			

Quadro 40.

11.3 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Investimentos no Exterior

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 58.238.540,61				
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 41.389.565,28				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.417.308,95	5,30%	5,00%		art 9º-A, inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXT DOLAR	R\$ 154.235.894,63				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 32.233.514,06			10,00%	
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 320.514.823,53				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 168.086.619,73	5,51%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 164.986.079,35				
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 333.072.699,08				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 653.587.522,61	10,81%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 6.043.695.781,66	100%			

Quadro 41.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARÃES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



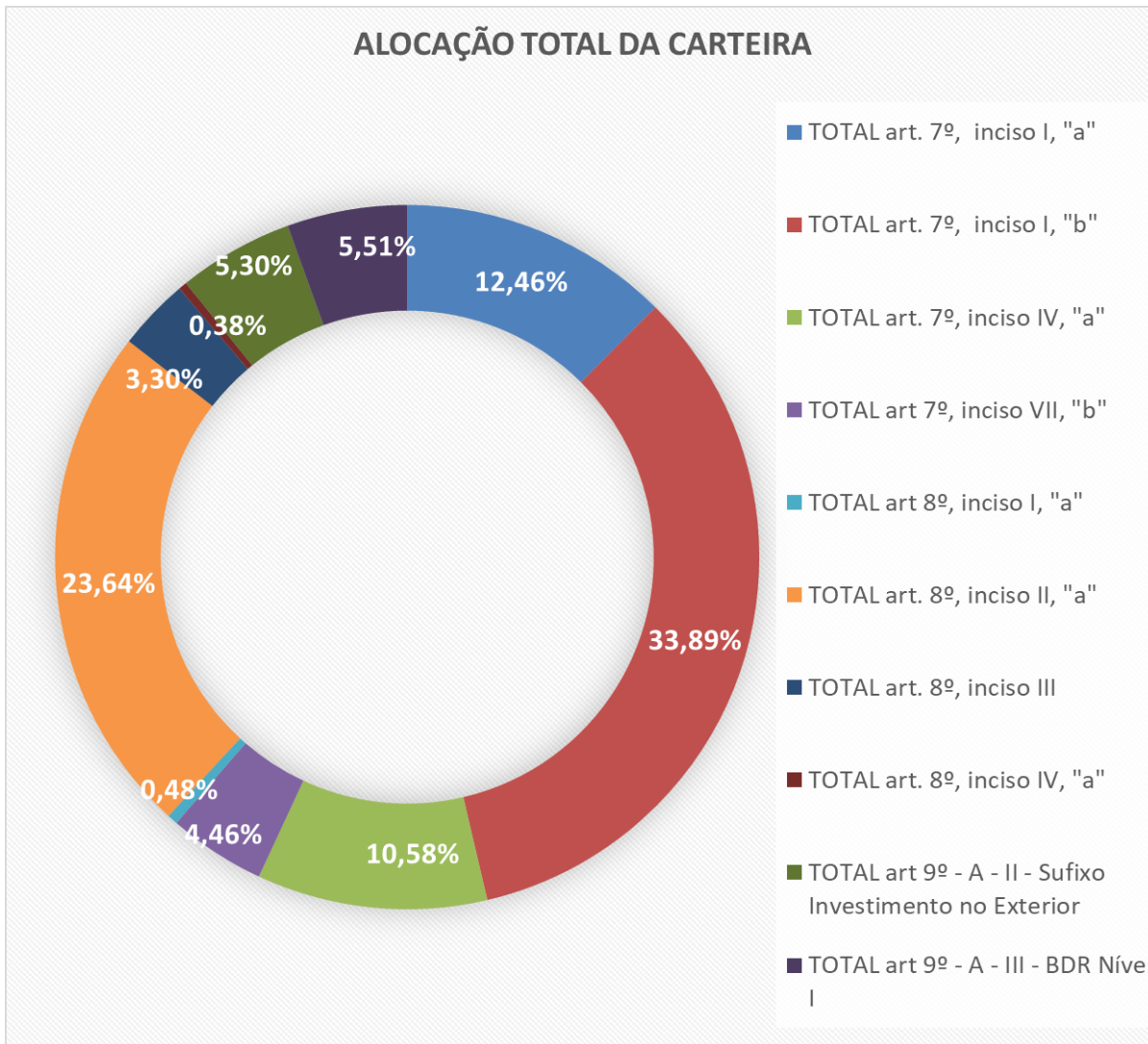


Gráfico 3.

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTT3NDU4



11.4 Enquadramento II – Limites Gerais – art. 13º - Res. CMN 3922/10

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN n° 3.922/2010
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 38.807.964,00	0,63%	20%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 76.459.160,97	1,24%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 168.086.619,73	2,73%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 58.238.540,61	0,95%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 122.788.669,99	1,99%	
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	R\$ 50.145.820,90	0,81%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 422.765.060,34	6,86%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 509.729.128,82	8,28%	
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.120.337,67	0,12%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.130.314,94	0,13%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 49.182.492,16	0,80%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 38.055.548,57	0,62%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.999.296,21	2,48%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 28.731.850,34	0,47%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.608.058,65	0,95%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 70.456.237,12	1,14%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 46.984.364,62	0,76%	
BTG ABSOLUTO INST. FQ FIA	R\$ 228.949.493,23	3,72%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.828.108,17	0,22%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 7.941.806,13	0,13%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.256.195,85	0,15%	
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	R\$ 35.021.379,46	0,57%	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	R\$ 25.348.996,11	0,41%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 53.538.599,32	0,87%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 492.367.703,98	7,99%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 640.552.889,09	10,40%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$ 31.063.490,15	0,50%	
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 107.652.513,38	1,75%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.242.753,11	0,28%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 41.389.565,28	0,67%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 77.192.701,48	1,25%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 34.417.308,95	0,56%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 31.195.468,15	0,51%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 93.399.609,36	1,52%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.463.180,56	1,83%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 157.617.379,80	2,56%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 113.119,53	0,00%	
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 109.828.928,93	1,78%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 104.186.789,94	1,69%	
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 61.624.409,75	1,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 34.095.419,66	0,55%	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 34.040.408,86	0,55%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 82.731.675,55	1,34%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 164.986.079,35	2,68%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 138.946.928,62	2,26%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 64.523.928,69	1,05%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 154.235.894,63	2,50%	
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 12.327,77	0,00%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 32.233.514,06	0,52%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 26.804.565,85	0,44%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 97.670.543,70	1,59%	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 28.159.398,55	0,46%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 38.984.655,51	0,63%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 5.290.907.196,15		

Quadro 42.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

023

Nota: Enquadramento II Limite por fundo de Investimento - Art. 13. As aplicações em cotas de um mesmo fundo de investimento não podem exceder a 20% (vinte por cento) das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social.

11.5 Enquadramento III – Limites Gerais – art. 14º - Res. CMN 3922/10

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	RS 7.120.337,67	RS 248.037.532,98	2,87%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	RS 509.729.128,82	RS 9.277.694.744,55	5,49%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 422.765.060,34	RS 7.701.081.218,58	5,49%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	RS 122.788.669,99	RS 1.098.659.963,05	11,18%	
BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI	RS 50.145.820,90	RS 1.417.181.864,81	3,54%	
BB FIA BDR - NIVEL I	RS 168.086.619,73	RS 2.396.743.051,17	7,01%	
BB MM GLOBAL SELECT	RS 58.238.540,61	RS 2.529.172.574,05	2,30%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 70.456.237,12	RS 631.584.812,26	11,16%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 38.055.548,57	RS 3.276.976.164,01	1,16%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 58.608.058,65	RS 1.241.205.562,42	4,72%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 49.182.492,16	RS 1.152.512.113,97	4,27%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	RS 28.731.850,34	RS 503.177.927,29	5,71%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	RS 152.999.296,21	RS 1.419.483.989,90	10,78%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	RS 492.367.703,98	RS 12.444.051.491,75	3,96%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 53.538.599,32	RS 218.489.919,55	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 640.552.889,09	RS 12.561.638.596,69	5,10%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 113.119,53	RS 2.626.754.965,66	0,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	RS 34.095.419,66	RS 723.867.535,77	4,71%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	RS 157.617.379,80	RS 2.631.453.374,95	5,99%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	RS 104.186.789,94	RS 923.668.055,52	11,28%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	RS 12.327,77	RS 166.923.439,39	0,01%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	RS 154.235.894,63	RS 2.180.881.081,62	7,07%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	RS 77.192.701,48	RS 999.787.061,37	7,72%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 93.399.609,36	RS 824.519.977,45	11,33%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 112.463.180,56	RS 604.309.300,74	18,61%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 138.946.928,62	RS 1.091.655.164,39	12,73%	
BTG ABSOLUTO INST. FIO FIA	RS 228.949.493,23	RS 1.896.702.011,80	12,07%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	RS 164.986.079,35	RS 3.983.843.860,12	4,14%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	RS 76.459.160,97	RS 1.900.035.039,47	4,02%	
OCCAM FIC FIA	RS 82.731.675,55	RS 1.010.020.909,77	8,19%	
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	RS 97.670.543,70	RS 1.094.729.532,50	8,92%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	RS 26.804.565,85	RS 368.066.288,15	10,59%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	RS 38.984.655,51	RS 542.903.933,54	5,72%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	RS 31.063.490,15	RS 506.222.631,32	6,14%	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	RS 38.807.964,00	RS 873.571.747,14	4,44%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	RS 41.389.565,28	RS 135.056.267.739,99	0,03%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	RS 34.417.308,95	RS 37.339.613.996,37	0,09%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	RS 7.941.806,13	RS 87.352.824,95	9,09%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	RS 8.130.314,94	RS 205.904.381,47	3,95%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	RS 46.984.364,62	RS 476.428.583,05	9,86%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	RS 17.242.753,11	RS 154.789.214,50	11,14%	
GUEPARDO INSTITUCIONAL FIC FIA	RS 28.159.398,55	RS 703.850.641,65	4,00%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	RS 32.233.514,06	RS 19.919.461.267,17	0,16%	
TOTAL	RS 4.798.586.858,80			

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	RS 64.523.928,69	RS 2.394.295.587,10	2,69%	5%
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	RS 109.828.928,93	RS 2.374.573.482,34	4,63%	
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULT	RS 25.348.996,11	RS 385.338.764,40	6,58%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	RS 13.828.108,17	RS 993.885.542,59	1,39%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	RS 9.256.195,85	RS 186.152.675,59	4,97%	
BTG PACTUAL CRED CORP I FIC FI RF CP	RS 35.021.379,46	RS 1.405.415.305,82	2,49%	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	RS 34.040.408,86	RS 777.989.992,71	4,38%	
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	RS 107.652.513,38	RS 1.904.562.600,94	5,65%	
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI	RS 61.624.409,75	RS 1.907.070.007,57	3,23%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 31.195.468,15	RS 1.086.649.624,61	2,87%	
TOTAL	RS 492.320.337,35			
TOTAL	RS 5.290.907.196,15			

Quadro 43.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

024

Nota 1: Art. 14 O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em um mesmo fundo de investimento deverá representar, no máximo, 15% (quinze por cento) do patrimônio líquido (PL) do fundo;

Nota 2: Art. 14 § 1º O limite de que trata o caput será de até 5% (cinco por cento) do patrimônio líquido dos fundos de investimento de que tratam os incisos VII do art. 7º, III e IV do art. 8º (ver Enquadramento 1);

Nota 3: Art. 14 § 3º. Em caso de os limites de que tratam o caput e o § 1º deste artigo serem ultrapassados em decorrência de resgate de cotas do fundo por outros cotistas, o regime próprio de previdência social deverá adequar-se em até 120 dias. Nesse caso, registra-se o fundo Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF (CNPJ: 10.756.541/0001-06);

Nota 4: Art. 21. § 1º As aplicações que apresentem prazos para vencimento, resgate, carência ou para conversão de cotas de fundos de investimento previstas em seu regulamento então vigente poderão ser mantidas em carteira até a respectiva data, caso superior ao prazo previsto no caput. Assim, considera-se que o fundo Caixa FI Brasil 2024 VI TP RF encontra-se enquadrado, pois o resgate dessa aplicação ocorrerá no vencimento dos TPF que compõe a carteira do fundo, ou seja, em 16/08/2024;

11.6 Enquadramento IV – Limites Gerais – art. 14º - A - Res. CMN 3922/10

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA NOVEMBRO/2021) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (DEZEMBRO/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.439.434,96	R\$ 1.338.874.178,06	0,0930%	5%
CAIXA	R\$ 420.388,15	R\$ 1.217.522.682,54	0,2896%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 574.744,24	R\$ 467.466.047,61	0,0813%	
BANCO SAFRA	R\$ 105.879,73	R\$ 368.456.936,66	0,3480%	
BRADESCO	R\$ 550.350,66	R\$ 398.033.483,05	0,0723%	
ICATU VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 34.408,75	R\$ 314.250.959,55	0,9133%	
BANCO BTG	R\$ 209.137,40	R\$ 320.345.978,95	0,1532%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 305.005,20	R\$ 261.900.735,78	0,0859%	
VINCI PARTNERS	R\$ 42.469,53	R\$ 136.655.199,21	0,3218%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 14.652,83	R\$ 82.731.675,55	0,5646%	
PLURAL INVEST GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 35.871,89	R\$ 75.806.874,23	0,2113%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 16.259,11	R\$ 76.459.160,97	0,4703%	
BC GESTAO RECURSOS LTDA	R\$ 7.191,10	R\$ 46.984.364,62	0,6534%	
ARX INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 35.272,51	R\$ 38.807.964,00	0,1100%	
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA	R\$ 23.109,64	R\$ 32.233.514,06	0,1395%	
MONGERAL AEGON	R\$ 8.602,73	R\$ 34.040.408,86	0,3957%	
SUL AMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 28.481,18	R\$ 26.804.565,85	0,0941%	
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADM REC LTDA	R\$ 7.534,67	R\$ 17.242.753,11	0,2288%	
GUEPARDO INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 1.629,47	R\$ 28.159.398,55	1,7281%	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	R\$ 56.771,92	R\$ 8.130.314,94	0,0143%	

Quadro 44.

Nota 1: Art. 14-A. O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica.

Nota 2: Para fins desse enquadramento, é aplicado o Ranking ANBIMA, atualizado bimestralmente, para o Gestores de Recursos de Terceiros.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



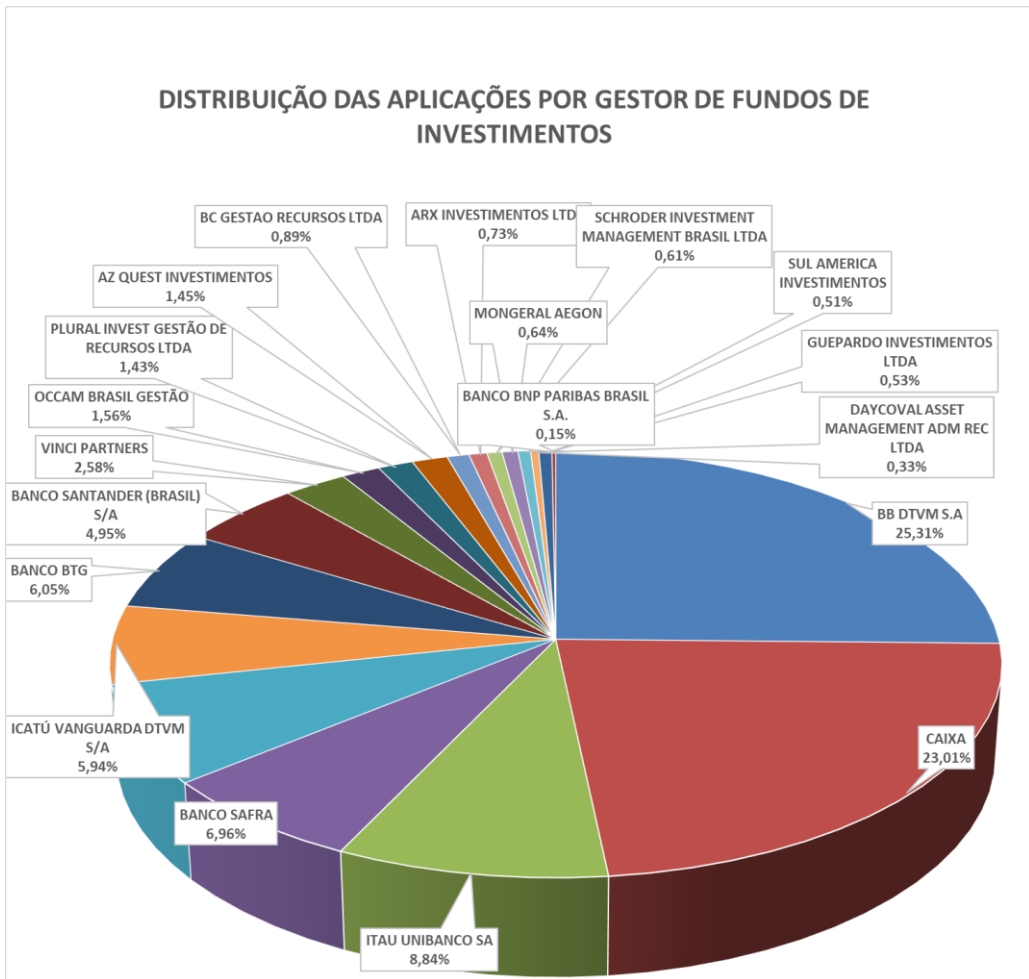


Gráfico 4.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.290.907.196,15
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 752.788.585,51
TÍTULOS - CVS	R\$ 8.712.029,37
IMÓVEIS	R\$ 68.293.435,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 39.050.926,31
TOTAL	R\$ 6.159.752.172,34

Quadro 45.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTT3NDU4



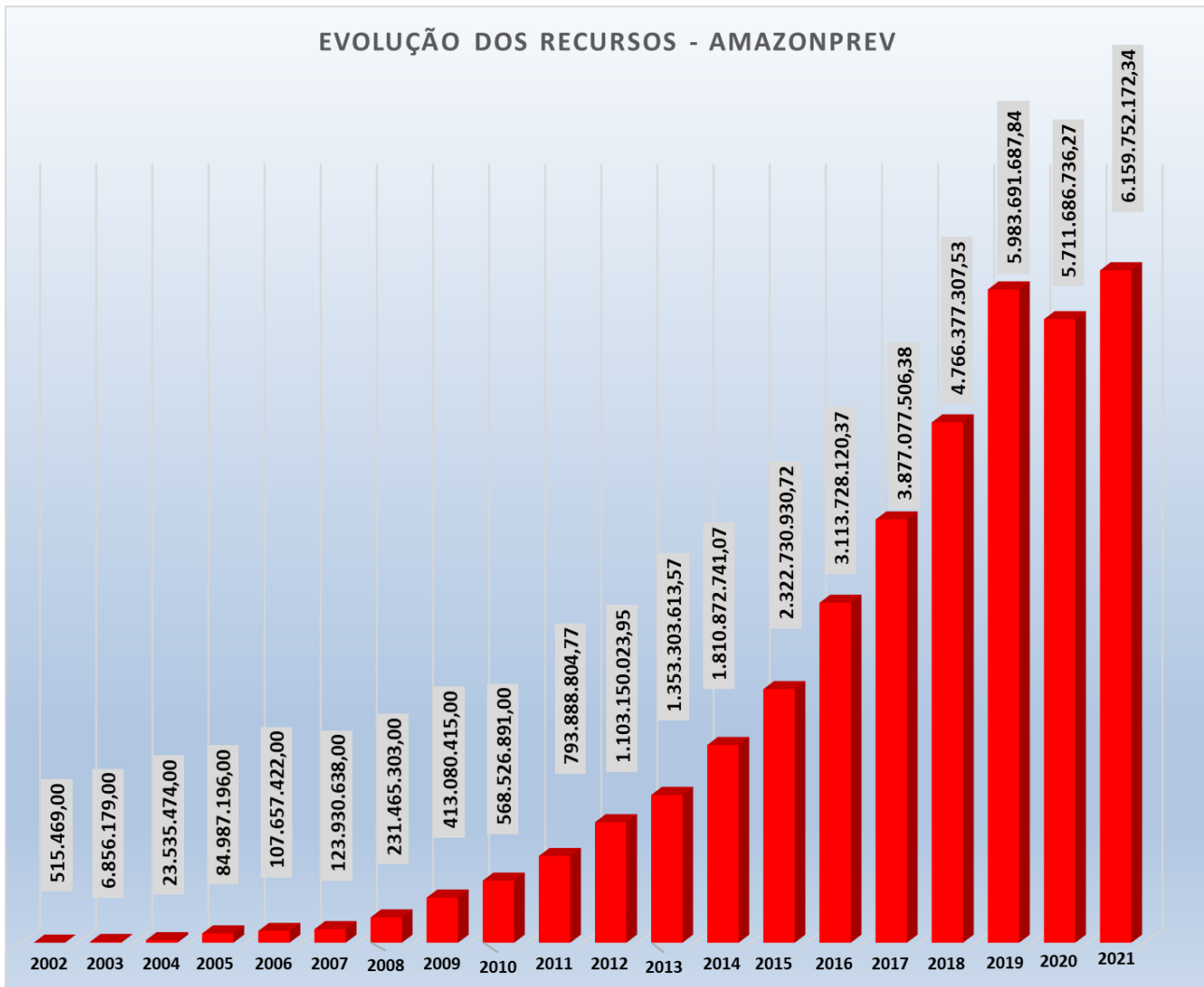


Gráfico 05.



AMAZONPREV
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



***RELATÓRIO DE
RISCOS
FPREV -
AMAZONPREV***

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

TOTAL RENDA FIXA	R\$	3.592.885.298,29
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$	1.661.420.852,88
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$	653.587.522,61
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$	5.907.893.673,78

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	dez21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOUREIRO	R\$ 743.334.839,23	R\$ 752.788.585,51							
TOTAL - art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 743.334.839,23	R\$ 752.788.585,51							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	dez21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 7.079.089,17	R\$ 7.120.337,67	0,20	1,62%	0,17%	-0,95	6,57%	0,58%	6,57%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 53.088.094,00	R\$ 53.538.599,32	0,20	5,15%	0,53%	-1,01	-2,18%	0,85%	-2,18%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 488.617.878,32	R\$ 492.367.703,98	0,20	2,77%	0,29%	-2,29	4,31%	0,77%	4,31%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 595.078.999,88	R\$ 599.992.481,32	0,40	2,32%	0,24%	-1,00	-0,11%	0,83%	-0,11%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 92.691.813,36	R\$ 93.399.609,36	0,25	2,81%	0,29%	-2,29	4,14%	0,76%	4,14%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 112.883.548,91	R\$ 112.463.180,56	0,25	9,09%	0,94%	0,00	-6,96%	-0,37%	-6,96%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 136.099.023,98	R\$ 138.946.928,62	0,20	6,49%	0,67%	0,00	-4,86%	-0,10%	-4,86%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 506.154.654,50	R\$ 509.729.128,82	0,20	2,61%	0,27%	-2,26	4,65%	0,71%	4,65%
TOTAL - art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.991.693.102,12	R\$ 2.007.557.969,65							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso IV, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	dez21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfl	R\$ 468.639.244,19	R\$ 422.765.060,34	0,50	2,83%	0,29%	0,00	-0,40%	0,91%	-0,40%
Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	R\$ 48.800.475,79	R\$ 49.182.492,16	0,40	2,68%	0,28%	0,00	-0,16%	0,78%	-0,16%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ 58.516.836,21	R\$ 58.608.058,65	0,20	2,92%	0,30%	-2,32	3,67%	0,77%	3,67%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 299.531,26	R\$ 75.287,33	0,20	0,14%	0,01%	0,00	4,21%	0,69%	4,21%
Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 112.154,15	R\$ 113.119,53	0,40	1,10%	0,11%	-1,05	4,53%	0,86%	4,53%
Bradesco FI RF Ref DI Premium	R\$ 32.001.271,71	R\$ 32.260.545,52	0,20	0,16%	0,02%	0,00	4,94%	0,81%	4,94%
TOTAL - art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 608.369.513,31	R\$ 563.004.563,53							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso VII, "b"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	dez21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 30.854.744,78	R\$ 31.195.468,15	0,40	3,93%	0,41%	-3,99	4,86%	1,10%	4,86%
Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	R\$ 25.973.110,33	R\$ 34.040.408,86	0,45	0,30%	0,03%	-0,06	6,29%	0,84%	6,29%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	R\$ 99.044.974,59	R\$ 107.652.513,38	0,30	0,36%	0,04%	-0,05	5,99%	0,77%	5,99%
BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	R\$ 7.702.655,51	R\$ 35.021.379,46	0,60	0,52%	0,05%	-0,10	8,16%	0,74%	8,16%
Itau High Grade RF Cred Priv FICFI	R\$ 53.345.940,97	R\$ 61.624.409,75	0,25	0,26%	0,03%	-0,03	5,16%	0,81%	5,16%
TOTAL - art. 7º, inciso VII, "b"	R\$ 216.921.426,18	R\$ 269.534.179,60							

Quadro 1.



Relatório de Anual Investimentos - 2021

029

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso I, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	R\$ 27.930.416,82	R\$ 28.731.850,34	0,90	20,48%	2,11%	-10,90	-15,28%	2,87%	-15,28%
TOTAL - art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 27.930.416,82	R\$ 28.731.850,34							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso II, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Ações Valor FICFIA	R\$ 117.978.963,89	R\$ 122.788.669,99	2,00	19,99%	2,06%	-15,12	-4,76%	4,08%	-4,76%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 147.266.685,61	R\$ 152.999.296,21	1,50	22,55%	2,32%	-10,17	-9,84%	3,89%	-9,84%
BTG Pactual Absolut Inst FIC FIA	R\$ 230.529.545,52	R\$ 228.949.493,23	3,00	23,83%	2,45%	-9,04	-31,79%	-0,69%	-31,79%
Caixa FIA Consumo	R\$ -	R\$ -	1,60	23,53%	2,42%	-10,57	-26,98%	-0,02%	-26,98%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	R\$ 76.484.317,50	R\$ 77.192.701,48	2,00	18,24%	1,88%	-9,60	-18,26%	0,93%	-18,26%
Itau Acoes Dunamis Fc	R\$ 156.101.613,81	R\$ 157.617.379,80	2,00	17,88%	1,84%	-6,97	-8,51%	0,97%	-8,51%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 33.466.421,25	R\$ 34.095.419,66	2,50	20,30%	2,09%	-10,50	-16,64%	1,88%	-16,64%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	R\$ -	R\$ -	2,00	22,41%	2,31%	-11,17	-17,09%	0,39%	-17,09%
Itau Small Cap Valuation Fc Acoes	R\$ 100.650.594,60	R\$ 104.186.789,94	2,00	23,55%	2,43%	-9,66	-10,06%	3,51%	-10,06%
Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	R\$ 12.064,20	R\$ 12.327,77	2,50	21,04%	2,16%	-12,22	-20,59%	2,18%	-20,59%
Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	R\$ -	R\$ -	0,75	20,79%	2,14%	-11,97	-13,46%	2,86%	-13,46%
Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	R\$ -	R\$ -	2,00	21,03%	2,16%	-12,23	-20,54%	2,18%	-20,54%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 74.798.444,07	R\$ 76.459.160,97	2,00	19,15%	1,97%	-10,73	-9,74%	2,22%	-9,74%
Occam Fc de FIA	R\$ 79.939.581,88	R\$ 82.731.675,55	2,50	20,06%	2,07%	-12,30	-12,74%	3,49%	-12,74%
Sul America Equities FIA	R\$ 25.543.886,19	R\$ 26.804.565,85	1,50	20,90%	2,15%	-11,50	-20,36%	4,94%	-20,36%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 7.886.600,35	R\$ 7.941.806,13	2,50	19,11%	1,97%	-9,78	-19,00%	0,73%	-19,00%
Vinci Mosaico Institucional FIA	R\$ 97.551.401,37	R\$ 97.670.543,70	1,97	20,54%	2,12%	-10,27	-12,82%	0,12%	-12,82%
Vinci Selection Equities FIA	R\$ 34.255.367,85	R\$ 38.984.655,51	4,00	18,66%	1,92%	-10,60	-11,49%	2,66%	-11,49%
Brasil Capital Rp Inst Fc de FIA	R\$ 45.872.728,26	R\$ 46.984.364,62	3,12			-5,83		2,42%	
Bnpp Action Fc FIA	R\$ 7.836.757,83	R\$ 8.130.314,94	2,02	19,94%	2,05%	-11,80	-16,02%	3,75%	-16,02%
Daycoval Ibovespa Ativo FIA	R\$ 16.548.724,79	R\$ 17.242.753,11	3,50	21,49%	2,21%	-11,29	-18,36%	4,19%	-18,36%
Cx FIC FIA BR Acoes Livre Quantitativo	R\$ 11.342.056,59	R\$ 11.997.742,88	2,00	20,99%	2,16%	-7,51	5,61%	5,78%	5,61%
Guepardo Institucional FIC FIA	R\$ -	R\$ 28.159.398,55	2,05	25,04%	2,58%	-14,33	9,85%	-0,34%	9,85%
BB Acoes Quantitativo Fc	R\$ -	R\$ 50.145.820,90	2,00	19,59%	2,02%	-14,31	-6,26%	3,56%	-6,26%
ARX Income Inst Fc FIA	R\$ 37.533.248,57	R\$ 38.807.964,00	2,32	19,46%	2,00%	-10,58	-6,50%	3,40%	-6,50%
TOTAL - art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.301.599.004,13	R\$ 1.409.902.844,79							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso III	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
Saifa S P Reais Pb FI Mult	R\$ 61.204.048,00	R\$ 64.523.928,69	1,00	13,22%	1,36%	-5,08	32,11%	5,42%	32,11%
BTG Pactual S&P 500 Brl FI Mult	R\$ -	R\$ 25.348.996,11	0,20	13,44%	1,39%	-5,10	33,76%	5,48%	33,76%
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	R\$ 104.058.940,69	R\$ 109.828.928,93	0,80	13,38%	1,38%	-5,12	32,74%	5,54%	32,74%
TOTAL - art. 8º, inciso III	R\$ 165.262.988,69	R\$ 199.701.853,73							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso IV, "a"	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BTG Pactual Economia Real FI Partic Mult	R\$ 13.877.804,75	R\$ 13.828.108,17	2,00			-5,90	13,62%	-0,36%	13,62%
BTG Pa Inv de Im FI Participac Mult Cl A	R\$ 9.309.964,96	R\$ 9.256.195,85	2,15			0,00		-0,58%	
TOTAL - art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 23.187.769,71	R\$ 23.084.304,02							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 56.000.961,48	R\$ 58.238.540,61	0,08	17,65%	1,83%	-10,91	32,35%	4,00%	32,35%
Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	R\$ 152.880.147,40	R\$ 154.235.894,63	1,00	16,24%	1,68%	-11,57	23,65%	0,89%	23,65%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	R\$ 31.713.226,62	R\$ 32.233.514,06	1,00	17,38%	1,80%	-9,75	28,48%	1,64%	28,48%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 39.539.540,73	R\$ 34.417.308,95	0,80	32,67%	3,36%	-24,25	5,29%	-12,95%	5,29%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 39.523.473,43	R\$ 41.389.565,28	0,80	18,03%	1,86%	-10,58	23,24%	4,72%	23,24%
TOTAL - art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 319.657.349,66	R\$ 320.514.823,53							

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	SALDO ANTERIOR	SALDO ATUAL	TAXA ADM %	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	dez/21	2021
							RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nível I	R\$ 163.204.312,77	R\$ 168.086.619,73	0,50	17,23%	1,78%	-11,63	33,49%	2,99%	33,49%
Saifa Consumo Americano FIA Bdr Nível I	R\$ 159.482.829,04	R\$ 164.986.079,35	1,50	17,50%	1,81%	-10,16	33,92%	3,45%	33,92%
TOTAL - TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 322.687.141,81	R\$ 333.072.699,08							

Quadro 2.

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

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



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

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

Nota 3: DRAWDOWN: Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período. Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, conseqüentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

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



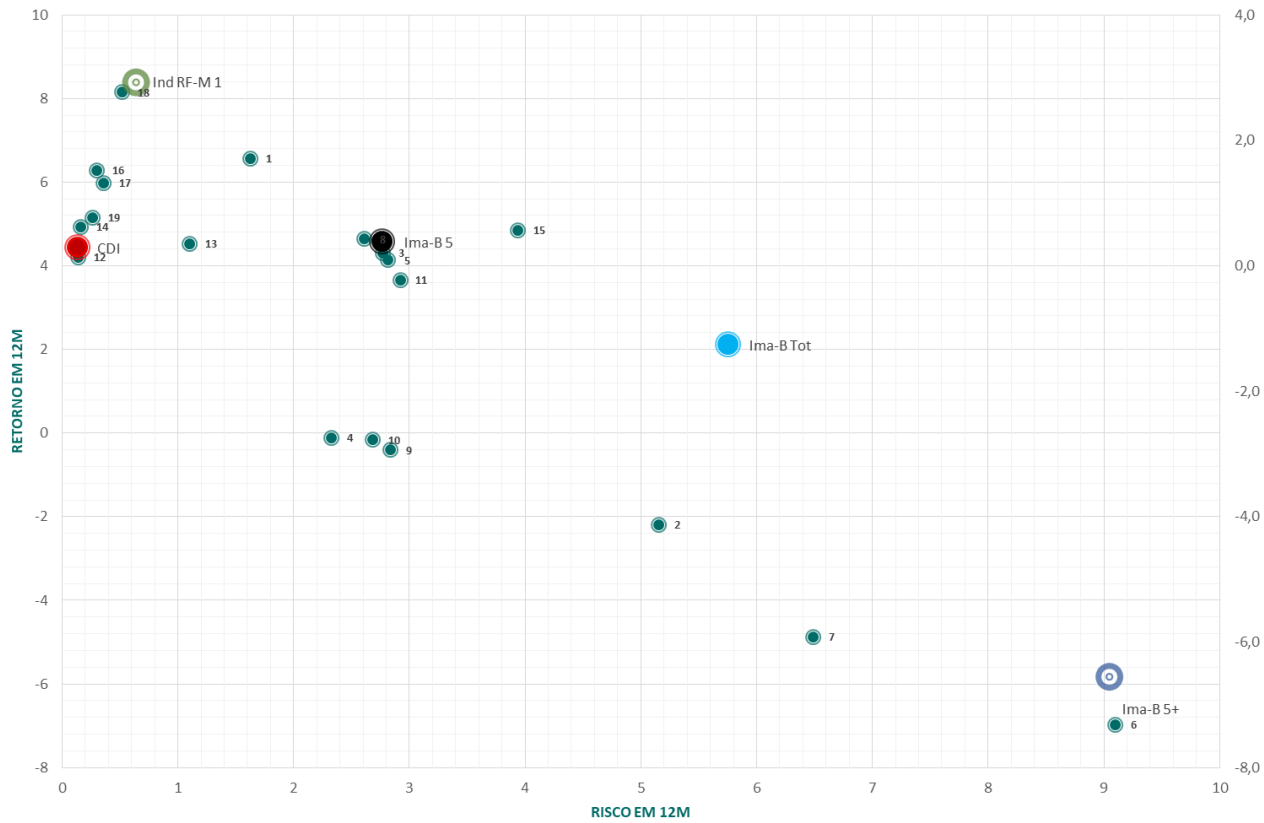


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Tit Publ VII FI	6,57	1,62	D+000	D+000
2	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	-2,18	5,15	D+000	D+000
3	art. 7º, inciso I, "b"	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	4,31	2,77	D+000	D+000
4	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	-0,11	2,32	D+000	D+000
5	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	4,14	2,81	D+000	D+001
6	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	-6,96	9,09	D+000	D+001
7	art. 7º, inciso I, "b"	Safra Ima Institucional Fc FI RF	-4,86	6,49	D+003	D+004
8	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Idka 2 FI	4,65	2,61	D+001	D+001
9	art. 7º, inciso IV, "a"	BB Prev RF Alocacao Ativa Fc fi	-0,40	2,83	D+003	D+003
10	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	-0,16	2,68	D+003	D+004
11	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	3,67	2,92	D+001	D+001
12	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	4,21	0,14	D+000	D+000
13	art. 7º, inciso IV, "a"	Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	4,53	1,10	D+000	D+001
14	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco FI RF Ref DI Premium	4,94	0,16	D+000	D+000
15	art. 7º, inciso VII, "b"	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	4,86	3,93	D+005	D+006
16	art. 7º, inciso VII, "b"	Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	6,29	0,30	D+000	D+001
17	art. 7º, inciso VII, "b"	Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	5,99	0,36	D+000	D+001
18	art. 7º, inciso VII, "b"	BTG Pact Cre Cor I FICFI RF Cred Priv	8,16	0,52	D+030	D+031
19	art. 7º, inciso VII, "b"	Itau High Grade RF Cred Priv FICFI	5,16	0,26	D+000	D+000

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI/ SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4





Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
 Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
 Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
 Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARÃES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
 Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
 Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
 AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
 Acesso: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
 e valide o código: MTT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

033

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso II, "a"	BB Ações Valor FICFIA	-4,76	19,99	D+030	D+032
2	art. 8º, inciso II, "a"	Bradesco FIA Mid Small Caps	-9,84	22,55	D+001	D+003
3	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	-31,79	23,83	D+001	D+032
4	art. 8º, inciso II, "a"	Caixa FIA Consumo	-26,98	23,53	D+001	D+003
5	art. 8º, inciso II, "a"	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	-18,26	18,24	D+001	D+003
6	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Acoes Dunamis Fc	-8,51	17,88	D+021	D+023
7	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	-16,64	20,30	D+002	D+002
8	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	-17,09	22,41	D+021	D+023
9	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Small Cap Valuation Fc Acoes	-10,06	23,55	D+001	D+003
10	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	-20,59	21,04	D+001	D+003
11	art. 8º, inciso II, "a"	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	-13,46	20,79	D+001	D+003
12	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	-20,54	21,03	D+027	D+029
13	art. 8º, inciso II, "a"	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	-9,74	19,15	D+027	D+029
14	art. 8º, inciso II, "a"	Occam Fc de FIA	-12,74	20,06	D+001	D+003
15	art. 8º, inciso II, "a"	Sul America Equities FIA	-20,36	20,90	D+001	D+003
16	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	-19,00	19,11	D+001	D+003
17	art. 8º, inciso II, "a"	Vinci Mosaico Institucional FIA	-12,82	20,54	D+001	D+003
18	art. 8º, inciso II, "a"	Vinci Selection Equities FIA	-11,49	18,66	D+060	D+062
19	art. 8º, inciso II, "a"	Brasil Capital Rp Inst Fc de FIA			D+030	D+032
20	art. 8º, inciso II, "a"	Bnpp Action Fc FIA	-16,02	19,94	D+027	D+029
21	art. 8º, inciso II, "a"	Daycoval Ibovespa Ativo FIA	-18,36	21,49	D+012	D+014
22	art. 8º, inciso II, "a"	Cx FIC FIA BR Acoes Livre Quantitativo	5,61	20,99	D+013	D+015
23	art. 8º, inciso II, "a"	ARX Income Inst Fc FIA	-6,50	19,46	D+001	D+003
24	art. 8º, inciso II, "a"	BB Acoes Quantitativo Fc	-6,26	19,59	D+001	D+003
25	art. 8º, inciso II, "a"	Guepardo Institucional FIC FIA	9,85	25,04	D+030	D+032

Quadro 3. Legenda Gráfico 2.

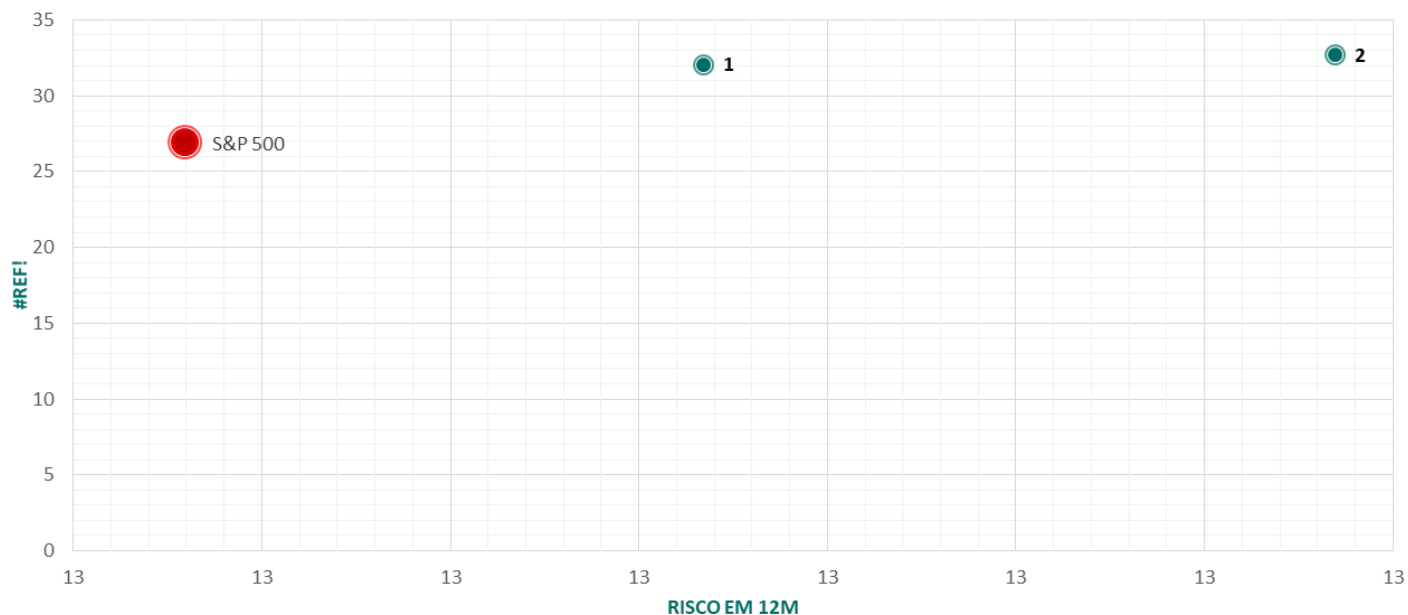


Gráfico 3: Art. 8-III,º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso III	Safra S P Reais Pb FI Mult	32,11	13,22	D+001	D+002
2	art. 8º, inciso III	Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	32,74	13,38	D+000	D+001

Quadro 4. Legenda Gráfico 3.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MIT3NDU4



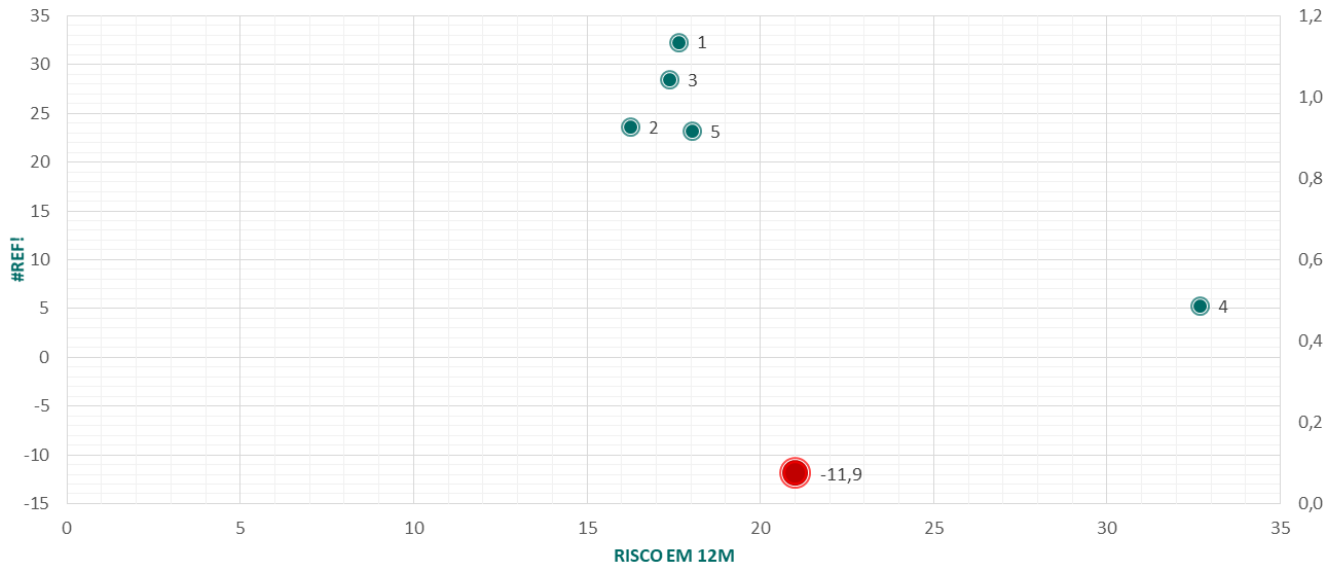


Gráfico 4: Art. 9º-A-II Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	BB Mult Global Select Equity Ie FI	32,35	17,65	D+001	D+005
2	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	23,65	16,24	D+001	D+008
3	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	28,48	17,38	D+001	D+004
4	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	5,29	32,67	D+001	D+006
5	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	23,24	18,03	D+001	D+006

Quadro 5. Legenda Gráfico 4.

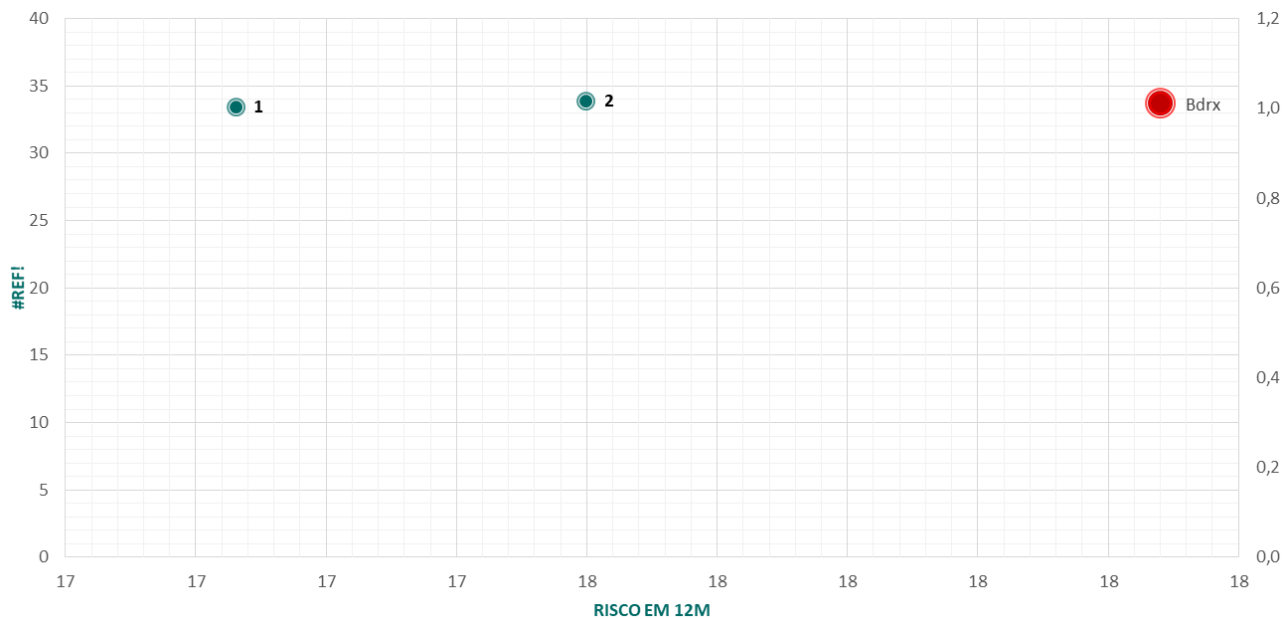


Gráfico 5: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTT3NDU4



Relatório de Anual Investimentos - 2021

035

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art 9º - A - III - BDR Nível I	BB Acoes Esg FIA - Bdr Nível I	33,49	17,23	D+001	D+004
2	art 9º - A - III - BDR Nível I	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nível I	33,92	17,50	D+001	D+004

Quadro 6. Legenda Gráfico 5.

Documento Assinado por: BRUNO RENE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARAES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRE LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS

Acesse: <https://www.portaldosegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MTI3NDU4



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 15 de fevereiro de 2022, apresenta o Relatório de Anual Investimentos de 2021, 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.

Todas as operações efetuadas, são acompanhadas pelo Controles Internos, e aprovadas pela Diretoria, com base nas Atas de Reunião do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev.

Manaus – AM, 15 de fevereiro de 2022.

Alan Nascimento
Coordenador

Bruno Costa Novo
Secretário

Bruno Barroso
Membro

Leonardo Cavalcanti
Membro

Wellington Bentes
Membro

Claudinei Soares
Membro

André Luiz Bentes
Membro

Marcos Souza
Membro

Documento Assinado por: BRUNO REINE DA SILVA BARROSO em 21/03/2022 15:07:21
Documento Assinado por: MARCOS ROBERTO NASCIMENTO DE SOUZA em 21/03/2022 15:09:47

Documento Assinado por: BRUNO DAMASCENO COSTA NOVO em 21/03/2022 14:03:23
Documento Assinado por: ALAN CYNARA B NASCIMENTO em 21/03/2022 14:03:53
Documento Assinado por: WELLINGTON GUIMARÃES BENTES em 21/03/2022 14:06:13
Documento Assinado por: ANDRÉ LUIS BENTES DE SOUZA em 21/03/2022 14:08:47
Documento Assinado por: CLAUDINEI SOARES em 21/03/2022 14:25:41

Documento assinado eletronicamente 127458/2022
AMAZONPREV - FUNDO PREVIDENCIÁRIO DO ESTADO DO AMAZONAS
Acesse: <https://www.portaldesegurado.am.gov.br/validar>
e valide o código: MT13NDU4

