

Destino: DIRAF / PRESI

Assunto: **Relatório de Investimentos – Setembro/2021**

Data: 15/10/2021

## RELATÓRIO Nº. 021 / 2021 – COMIV

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 07);
- 2) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Poder Executivo, apresentando os saldos e **performance** dos Fundos de Investimentos, evolução dos saldos dos Fundos de Investimentos, imóveis e CVS, comparativo da rentabilidade com a Meta Atuarial, Evolução e variação dos recursos do FPREV Executivo (páginas 07 a 13);
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 14 a 16);
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 17 a 18);
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 16)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 21 a 22)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (página 23 a 24)
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (página 25 a 26)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 26 a 27)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 28)
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 29 a 35)
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (página 36)
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 37)
- 14) Relatório de Riscos da Carteira (página 38 a 46)
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 47).

## 1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

**Brasil: Copom eleva a Selic para 6,25% e sinaliza juro em território contracionista**

**Mundo: Fed sinaliza que em breve deverá reduzir o programa de compra de ativos**

O Banco Central elevou a taxa básica de juros novamente em 100 pb. Em decisão unânime, a autoridade monetária elevou a taxa Selic de 5,25% para 6,25%, confirmando as expectativas do mercado, e em linha com a sinalização da reunião de agosto. O Copom indicou que no atual estágio do ciclo de elevação de juros, o ritmo de 100 pb de ajuste é o mais adequado para garantir a convergência da inflação para a meta, além de permitir que o Banco Central obtenha mais informações sobre a evolução da atividade e inflação. Com isso, avalia-se que o Copom indica que uma nova aceleração do ritmo de aperto monetário não deverá fazer parte do atual ciclo de alta da Selic.

O Copom indicou ser apropriado elevar a taxa de juros para território contracionista. O comitê continua antevendo recuperação robusta da atividade econômica. Na conjuntura externa, apesar do ambiente ainda favorável para economias emergentes, o risco se elevou com o aperto das condições monetárias e menor crescimento nas economias asiáticas bem como o risco inflacionário em economias desenvolvidas. A pressão inflacionária interna segue elevada, com alta dos preços de bens industriais em meio a aumento de preços de serviços, fruto do aumento da mobilidade, e pressão em componentes voláteis. Para a próxima reunião, em outubro, o Banco Central indicou um aperto monetário de mesma magnitude. Espera-se que o Banco Central eleve a taxa de juros novamente em 100 pb na reunião de novembro, e encerre o ano com a taxa Selic em 8,25% ao ano. O atual ciclo de aperto monetário deverá ser finalizado em fevereiro, com uma alta de 75 pb, levando a taxa de juros para 9,00% a.a.

Em setembro, a prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) variou 1,14%. A inflação acumulada em 12 meses apresentou nova aceleração, de 9,68% em agosto para 10,05% em setembro. Apesar do aumento entre os meses ter sido liderado por preços de energia elétrica e passagem aérea, a leitura de setembro mostra inflação de bens industriais ainda pressionada em um momento de reabertura da economia no qual a inflação de serviços acelera de forma mais disseminada. Com relação aos núcleos, que são métricas que excluem ou suavizam itens com inflação volátil, a leitura de setembro corroborou essa piora do quadro inflacionário. A média da variação dos núcleos acelerou de 0,67% para 0,79%, alcançando 6,4% em 12 meses. A inflação continuará pressionada na leitura final de setembro sobretudo por combustíveis e pelo reajuste de energia elétrica (nova bandeira de escassez hídrica). Projeta-se inflação de 8,8% neste ano.

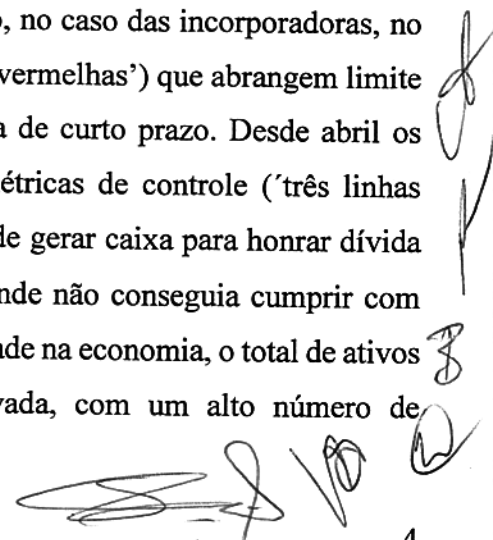
Nos EUA, o Fed manteve a taxa de juros entre 0% e 0,25% e sinalizou a possibilidade de moderação no ritmo de compras de ativos nos próximos meses. O banco central norte-americano reafirmou que manterá

o patamar da taxa de juros e o programa de US\$120 bilhões mensais em compra de ativos, até o avanço substancial em direção ao alcance das metas de pleno emprego e da meta de inflação. Porém, o Fed avalia que no caso de avanço da economia em linha com a expectativa, a necessidade de redução das compras de ativos deverá ser alcançada em breve. Sobre o cenário, o Fed manteve a avaliação que a inflação avançou, mas em decorrência majoritariamente de fatores transitórios. Na entrevista após a reunião, o presidente do Fed, Jerome Powell, mostrou confiança com a recuperação do mercado de trabalho e também reconheceu que problemas de oferta podem tornar a inflação alta mais persistente no curto prazo. Ademais, Powell mencionou que o programa de compras de ativos deverá ser encerrado em meados do próximo ano.

Nas projeções, a novidade ficou por conta da expectativa de alta de juros até 2024. Para 2022, as projeções mostram que a mediana para a taxa de juros se deslocou de 0,1% para 0,3%. Para 2023, a mediana subiu de 0,4% para 0,6%, enquanto que para 2024 (inserida a partir dessa reunião) a mediana está em 1,8%, abaixo da projeção de longo prazo de 2,5%. Essa reunião marca mais um avanço do Fed no sentido de iniciar a redução dos estímulos. O anúncio formal deverá ocorrer na reunião de novembro, com redução das compras já a partir de dezembro. De início, composição deverá contemplar a queda das compras mensais de US\$ 80 bilhões para US\$ 70 bilhões em títulos públicos, e de US\$ 40 bilhões para US\$ 35 bilhões em títulos ligados ao mercado imobiliário (MBS).

O índice de confiança (PMI) da indústria na China apresentou contração (abaixo de 50 pontos) no mês de setembro. As duas principais explicações para a queda do índice no mês de setembro foram as restrições de oferta de energia no país e a dificuldade na disponibilidade de insumos, que impactaram no recuo das ordens e produção, em especial na indústria pesada. Por outro lado, a parcela do PMI que exclui a indústria avançou, passando de 47,5 em agosto para 53,2 em setembro, acima da expectativa de mercado (49,2). O aumento da mobilidade foi a principal justificativa para a melhor do índice, principalmente no setor de serviços.

Na China, a empresa Evergrande, uma das maiores incorporadoras imobiliárias do país, revelou enorme pressão de caixa e liquidez diante da frustração de vendas de propriedades e de outros ativos. O evento ocorre meio à política de desalavancagem da economia. Nesse sentido, no caso das incorporadoras, no ano passado o governo implementou métricas de controle ('três linhas vermelhas') que abrangem limite passivo, limite dívida e capacidade de gerar caixa para honrar dívida de curto prazo. Desde abril os números já mostravam que a Evergrande não conseguia cumprir métricas de controle ('três linhas vermelhas') que abrangem limite passivo, limite dívida e capacidade de gerar caixa para honrar dívida de curto prazo. Desde abril os números já mostravam que a Evergrande não conseguia cumprir com esses limites estabelecidos pelo governo. Em termos de representatividade na economia, o total de ativos da empresa corresponde a 2% PIB, possuindo complexidade elevada, com um alto número de



subsidiárias. O risco maior de uma eventual falência da empresa, no entanto, decorre do potencial contágio para o restante setor de construção, que representa diretamente 14% do PIB.

O Banco Central Europeu (BCE) sinalizou moderação das compras de ativos nos próximos meses. Ainda, o BCE decidiu manter o patamar da taxa de depósito em -0,5%, da taxa de refinanciamento em 0,0% e da taxa de empréstimo em 0,25%. No entanto, ao contrário das últimas reuniões, os membros do BCE julgam que o ritmo de compra de ativos relacionadas ao PEPP deverá ser moderado nos próximos meses.

## Perspectivas Renda Fixa

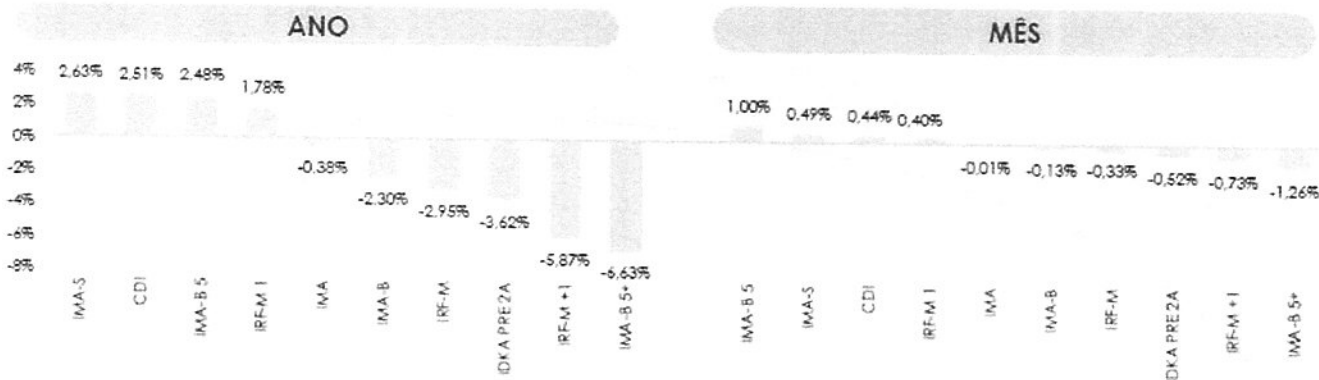
O mês de setembro foi marcado pelo aumento da incerteza com relação a continuidade da recuperação global, novos ventos vindos da China adicionaram ao cenário uma possibilidade de desaceleração mais forte. Nesse sentido, notou-se um aumento na aversão ao risco, que levou a uma queda nos preços dos ativos pelo mundo. Adicionalmente, observou-se uma estabilização nos preços das commodities, porém com uma queda expressiva nos preços do minério de ferro, devido às informações sobre mudanças no mercado imobiliário chinês. Com o descasamento entre oferta e demanda, o ambiente inflacionário continua, o que tem levado os bancos centrais pelo mundo a tomar ações. Nesse sentido, o Banco Central Europeu decidiu reduzir o volume de compras de ativos e o Banco Central Americano, o FED, dá sinais de início desse processo no próximo mês. Por fim, uma escassez de energética tem contribuído negativamente com a inflação e incrementado mais ruídos sobre uma desaceleração mais forte.

No Brasil, seguimos em um ambiente de riscos fiscais crescentes, com muitas idas e vindas sobre a definição do orçamento para 2022, porém com nenhuma solução concreta. A retórica expansionista do governo piora as perspectivas do endividamento e concomitantemente adiciona mais incerteza ao cenário inflacionário. O Banco Central, por sua vez, segue ajustando o discurso na tentativa de ancorar as expectativas do mercado, ao passo que mantém os aumentos na taxa básica de juros na ordem dos 100 pontos para a próxima reunião, porém os investidores permanecem acreditando que o nível de juros necessário para conter a inflação deveria ser superior ao indicado nas comunicações. Adicionalmente, foi reduzida a chance de racionamento de energia, mas a crise hídrica segue no radar trazendo impactos principalmente do lado inflacionário. A gestão (BRAM) segue acreditando em um crescimento da economia neste ano próximo a 5,3% e uma inflação por volta de 8,8%, dito isso, espera-se para o final de 2021 uma Selic de 8,25%.

O mercado de renda fixa segue bastante pressionado pelo cenário mencionado, houve uma abertura na curva de juros em todos os vencimentos, tanto nos ativos prefixados quanto nos atrelados à inflação. Importante destacar a menor volatilidade dos ativos atrelados à inflação e o desempenho positivo para os ativos de curto prazo, representados pelo índice IMA B5. As LFTs, ativos pós fixados em Selic,

seguem com um desempenho positivo e se recuperam bem no ano O Real segue como uma moeda atrativa quando ponderamos o risco pela taxa de juros do Brasil, entretanto o cenário global trouxe um risco adicional fortalecendo o Dólar pelo mundo. O Dólar fechou o mês a 5,44, com uma alta de 5,76% e no ano passou para o campo positivo com uma alta de 4,67%.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Perspectivas Renda Variável

Em setembro foram adicionados novos pontos de atenção ao cenário de crescimento elevado do PIB global para 2022. Dentre diversos fatores, pode se citar o impacto da variante Delta principalmente em países com baixo nível de vacinação, preocupações com inflação acima dos níveis normais, novidades regulatórias na China e seus efeitos colaterais na economia. O S&P 500 teve retorno de -4,76% e o MSCI Emerging Markets -4,29%. Estes índices acumulam retorno no ano de 14,68% e 11,77% respectivamente e em moeda original.

No Brasil, o ambiente global negativo se somou às preocupações em torno do risco fiscal, que, juntamente com o risco político, o risco hidrológico e a inflação são os pontos de atenção internamente. O Ibovespa teve retorno de -6,57 no mês, levando o para retorno negativo de -6,75 no ano. O fluxo do investidor estrangeiro foi levemente negativo em setembro, continuando bastante positivo no ano. A gestão está com visão cautelosa para renda variável no curto prazo. O aumento das incertezas locais e globais motiva tal posicionamento. O excelente comportamento das empresas listadas e o crescimento cíclico do PIB proporcionado pelo mundo pós Covid são os fatores positivos. Para a gestão, o balanço de forças entre a expectativa de novos pacotes de estímulo fiscal nos EUA e o ambiente local mais incerto justificam a adoção de portfolios balanceados em empresas ligadas a commodities e as expostas ao consumo doméstico, com expectativa de crescimento acima do mercado, potencial de consolidação e bem posicionadas para os desafios que temos pela frente. Sobre a performance setorial, o mês foi bem positivo para os setores mais defensivos como: Alimentos Agronegócio, Bens de Capital e Serviços

*[Handwritten signatures and initials]*

Públicos. O plano da China de atingir carbono zero até 2060 continua proporcionando valorização do setor de Petróleo com a expectativa de aumento de consumo da commodity. Ao mesmo tempo, pressiona para baixo o setor de Mineração Siderurgia com a queda dos preços de minério de ferro devido ao desligamento de siderúrgicas no país Setores sensíveis a taxas de juros e ao crescimento local complementam a lista de setores com destaque negativo como Construção Civil, Varejo e Consumo.

## RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	SETEMBRO	2021	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	-4,76%	14,68%	28,09%	44,71%	47,82%
MSCI WORLD USD	-4,29%	11,77%	27,01%	37,92%	37,66%
SMLL CAPS	-6,43%	-5,54%	15,75%	13,69%	78,82%
IBRX100	-6,99%	-5,99%	17,82%	7,71%	45,23%
IDIV	-4,48%	-4,67%	19,58%	7,85%	64,83%
IBOVESPA	-6,57%	-6,75%	17,31%	5,95%	39,87%

Fonte: Carta do Gestor outubro/2021 – BRAM.

*[Handwritten Signatures]*

# Relatório de Investimentos – Setembro/2021

## 2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

### 2.1 SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 319.383.413,83	R\$ 318.043.340,87	(0,2496)	(0,4488)	(0,0053)	-0,7025%	-1,3789%	1,7518%	
BB PREVID TP VII	R\$ 6.903.508,85	R\$ 6.993.034,60	0,6557	0,4531	1,2968	2,4230%	4,6620%	7,6905%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 292.126.309,27	R\$ 295.145.278,23	0,0834	0,1784	1,0334	1,2981%	2,7345%	NC	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 21.505.898,10	0,3900	0,4900	0,4900	1,3762%	2,8400%	NC	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.283.391,61	R\$ 1.550.506,80	0,3700	0,4174	0,4400	1,2325%	1,9636%	2,7608%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 51.974.456,22	R\$ 52.473.526,45	(0,1800)	(0,0400)	0,9600	0,7380%	-0,0800%	4,7900%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 478.165.994,06	R\$ 482.857.113,53	0,0139	0,1338	0,9800	1,1292%	2,2900%	5,7010%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 520.633.244,45	R\$ 369.381.009,30	(0,7756)	(1,4496)	0,3550	-1,8668%	-1,1629%	0,8548%	
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 28.456.070,19	R\$ 28.649.299,15	0,0600	(0,1700)	0,6800	0,5691%	3,0200%	7,0200%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 101.598.955,76	R\$ 91.564.244,38	(0,0400)	0,0900	0,9600	1,0104%	2,1000%	5,4600%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 113.883.345,17	R\$ 112.362.158,91	(0,8100)	(2,3100)	(1,3400)	-4,3997%	-6,9800%	2,7500%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 21.385,93	R\$ 21.564,92	0,1600	0,3100	0,8400	1,3144%	2,3200%	2,7200%	
SANTANDER CP CRESCIMENT INST	R\$ -	R\$ 90.183.517,50	-	-	0,2039	NC	0,2039%	NC	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ -	R\$ 18.025.419,54	-	-	0,5500	NC	0,5500%	NC	
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ -	R\$ 45.058.394,80	-	-	0,5900	NC	0,5900%	NC	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 82.580.457,04	R\$ 103.338.362,43	(0,5800)	(1,5600)	0,6000	-1,5437%	-4,6700%	2,5400%	
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 1.998.010.532,38</b>	<b>R\$ 2.037.152.669,51</b>							

Quadro 1.

### 2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 107.144.334,56	R\$ 104.442.560,46	(2,3187)	(1,8102)	(2,5216)	-6,5055%	-2,2759%	29,3808%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 180.950.260,02	R\$ 173.881.403,64	(3,4200)	(2,7600)	(3,9100)	-9,7577%	2,4700%	17,7200%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 310.289.217,29	R\$ 282.856.309,85	(4,5700)	(6,8215)	(8,8411)	-18,9413%	-7,1011%	-4,8223%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 9.367.603,53	R\$ 9.007.806,04	(3,9400)	(3,4003)	(3,8409)	-10,7705%	-8,1576%	NC	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.593.912,65	R\$ 13.959.879,36	(4,4200)	9,2000	(8,3000)	-4,2896%	14,7025%	12,6515%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$ -	R\$ 12.132.719,27	-	-	(3,7457)	NC	-3,7457%	NC	
ICATU VANGUARDIA DIVIDENDOS FIA	R\$ 130.040.318,19	R\$ 83.564.995,14	(4,9100)	(2,9500)	(6,6100)	-13,8152%	11,0000%	6,9400%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 183.250.047,82	R\$ 171.298.883,15	(3,0800)	(2,2100)	(6,5200)	-11,4015%	-0,5700%	19,2600%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 40.109.943,84	R\$ 37.461.260,03	(4,5500)	(3,1300)	(6,6000)	-13,6401%	-8,4100%	11,4000%	
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 121.331.358,38	R\$ 115.776.507,97	(4,7300)	(3,9400)	(4,5800)	-12,6751%	-0,0600%	21,7900%	
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 101.710.930,00	R\$ 97.024.765,03	2,5800	3,3600	(4,5100)	1,2449%	4,3637%	NC	
SANTANDER CRESC SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 14.949,19	R\$ 13.758,89	(4,1373)	(2,0993)	(7,9602)	-13,6204%	-11,3663%	5,3385%	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 26.587.067,66	R\$ 25.371.834,09	2,5800	3,3200	(4,5700)	1,1421%	17,1200%	30,4300%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 87.074.310,93	R\$ 83.408.633,10	(4,4300)	(5,0700)	(4,2100)	-13,0949%	-1,5400%	15,1700%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 129.251.558,11	R\$ 84.410.723,24	(4,1200)	(2,4400)	(6,9300)	-12,9418%	-8,9200%	11,8700%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 33.037.251,68	R\$ 30.622.087,81	(3,3233)	(3,8217)	(7,3102)	-13,8152%	-9,0200%	6,6815%	
BRASIL CAPITAL RP INSTT FIC AÇÕES	R\$ 51.420.807,48	R\$ 48.062.911,33	(2,6600)	(2,0700)	(6,5300)	-10,8997%	-9,4000%	NC	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 9.353.806,68	R\$ 8.779.997,05	(4,6784)	(3,9220)	(6,1345)	-14,0351%	-12,7502%	NC	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.489.877,60	R\$ 9.405.722,59	-	(0,2726)	(0,8900)	NC	-1,1600%	NC	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 20.625.459,21	R\$ 18.894.402,47	-	(3,9729)	(8,3928)	NC	-12,0323%	NC	
VINCI MOSAICO INSTTUCIONAL FIA	R\$ 110.567.540,40	R\$ 102.856.598,74	(4,1100)	(2,2000)	(6,9700)	-12,7561%	-13,1312%	NC	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ -	R\$ 40.258.951,70	-	-	(3,6000)	NC	-3,6000%	NC	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ -	R\$ 37.523.282,76	(3,7700)	-	(5,2800)	-8,8509%	-0,3682%	NC	
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 1.679.546.358,40</b>	<b>R\$ 1.591.015.993,71</b>							

Quadro 2.

## 2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 23.082.616,81	R\$ 23.588.064,66	6,7517	0,9099	2,1897	10,0818%	20,1609%	29,4863%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 142.748.664,51	R\$ 144.647.674,99	5,1982	1,3098	1,3304	7,9940%	15,6701%	20,5438%
SCHRÖDER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 29.753.755,74	R\$ 30.186.927,02	6,3400	2,0200	1,4600	10,0720%	20,0200%	NC
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 148.366.133,69	R\$ 149.419.559,27	5,3345	3,0908	0,7100	9,3612%	18,6688%	19,8700%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 146.321.116,64	R\$ 145.139.361,06	6,2100	2,2400	(0,8100)	7,7095%	19,0400%	20,6200%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 36.163.559,47	R\$ 37.093.575,08	6,7255	0,4991	2,6015	10,0485%	9,3987%	NC
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 36.087.222,99	R\$ 35.600.844,92	1,8017	2,4250	(1,3478)	2,8650%	2,8411%	NC
<b>TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 562.523.069,85</b>	<b>R\$ 565.676.007,00</b>						
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 4.240.079.960,63</b>	<b>R\$ 4.193.844.670,22</b>						

Quadro 3.

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

**Nota 2:** As movimentações nesse mês tiveram como base a Ata de reunião COMIV nº. 177 e 178/2021: a) Novos Recursos: Ratear entre os fundos SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF (30.659.168/0001-74) e ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF (10.756.541/0001-06).

**Nota 3:** Os recursos aplicados no fundo ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF (10.756.541/0001-06) superaram o limite permitido para alocação, de forma que o Comitê optou por direcionar para o fundo Bradesco DI Premium, para fins de rentabilização, até a próxima reunião do COMIV, onde será discutido e definido a destinação dos referidos recursos, com base no cenário vigente.

**Nota 4:** Com base na Ata nº 178/2021, devidamente autorizado pela Diretoria, foram resgatados R\$ 153 milhões do fundo Caixa Gestão Estratégica, direcionando R\$ 18 milhões no fundo MONGERAL AEGON CP FI RF LP (19.488.768/0001-84), R\$ 90 milhões no fundo SANTANDER RF CP CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP (17.138.474/0001-05) e R\$ 45 milhões no fundo ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI (09.093.883/0001-04).

**Nota 5:** Com base na Ata nº 178/2021, devidamente autorizado pela Diretoria, foi migrado os recursos dos poderes, aplicados no Caixa Consumo (10.577.512/0001-79) para o fundo Caixa FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE QUANTITATIVO (30.068.169/0001-44).

## 2.4 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	jul/21	ago/21	set/21
BRANDESCO	R\$ 200.667.884,37	R\$ 183.233.651,63	R\$ 196.937.808,54
BANCO DO BRASIL	R\$ 898.755.442,05	R\$ 897.006.317,01	R\$ 897.631.838,09
CAIXA	R\$ 1.102.562.440,01	R\$ 1.055.109.497,91	R\$ 916.844.368,55
ITAÚ	R\$ 453.525.225,25	R\$ 446.423.665,97	R\$ 466.641.375,90
SANTANDER	R\$ 140.918.410,88	R\$ 142.763.613,70	R\$ 234.844.951,38
ICATU	R\$ 356.941.920,69	R\$ 373.978.689,31	R\$ 316.140.697,58
SAFRA	R\$ 220.974.786,81	R\$ 255.488.641,34	R\$ 273.849.557,58
BTG PACTUAL	R\$ 351.402.809,81	R\$ 342.740.611,07	R\$ 315.229.717,84
AZ QUEST	R\$ 91.722.177,49	R\$ 87.074.310,93	R\$ 83.408.633,10
OCCAM BRASIL	R\$ 132.484.654,00	R\$ 129.251.558,11	R\$ 84.410.723,24
SCHRÖDER	R\$ 29.165.061,22	R\$ 29.753.755,74	R\$ 30.186.927,02
SULAMÉRICA	R\$ 34.350.025,33	R\$ 33.037.251,68	R\$ 30.622.087,81
PLURAL INVEST	R\$ 71.216.780,96	R\$ 72.250.782,46	R\$ 72.694.420,00
BRASIL CAPITAL	R\$ 52.509.665,05	R\$ 51.420.807,48	R\$ 48.062.911,33
BNP PARIBAS	R\$ 9.735.635,99	R\$ 9.353.806,68	R\$ 8.779.997,05
DAYCOVAL	R\$ -	R\$ 20.625.459,21	R\$ 18.894.402,47
ARX	R\$ -	R\$ -	R\$ 40.258.951,70
MONGERAL	R\$ -	R\$ -	R\$ 18.025.419,54
VINCI PARTNERS	R\$ 113.054.982,71	R\$ 110.567.540,40	R\$ 140.379.881,50
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.259.987.902,62</b>	<b>R\$ 4.240.079.960,63</b>	<b>R\$ 4.193.844.670,22</b>

Quadro 4.

Handwritten signatures and initials, including "VAG" and "B".



## DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC SETEMBRO/2021

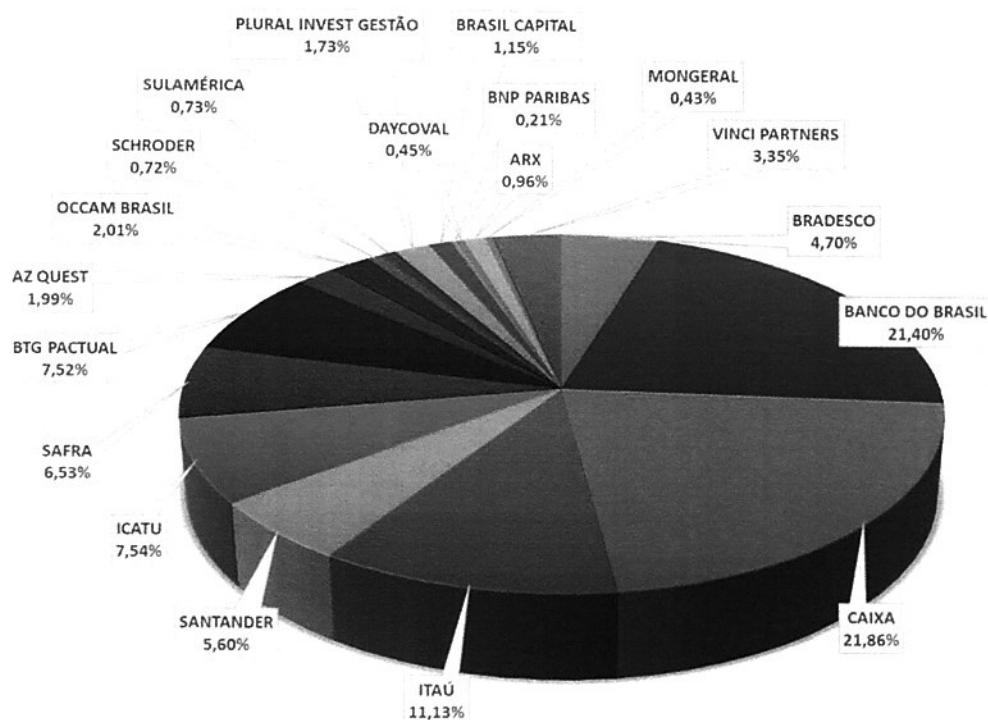


Gráfico 1.

### 2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	31/08/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 167.742.200,99	R\$ 170.578.187,23	1,4896	1,3992	1,6907	4,650%	12,0533%	17,3903%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 175.135.812,05	R\$ 178.113.490,07	1,4991	1,4087	1,7002	4,679%	12,1478%	17,5224%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 184.790.059,75	R\$ 187.975.927,04	1,5229	1,4324	1,7240	4,753%	12,3846%	17,8533%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 181.884.494,17	R\$ 184.976.942,92	1,4992	1,4087	1,7002	4,679%	12,1480%	17,5226%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 709.552.566,96</b>	<b>R\$ 721.644.547,26</b>						

Quadro 5.

Nota 1: Títulos Públicos atualizados pelo valor de aquisição acrescido da taxa de juros. (Ver quadro 6).

**2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS**

SEGMENTO	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\$ 170.578.187,23	R\$ 178.113.490,07	R\$ 187.975.927,04	R\$ 184.976.942,92
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 6.

**2.7 ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA**

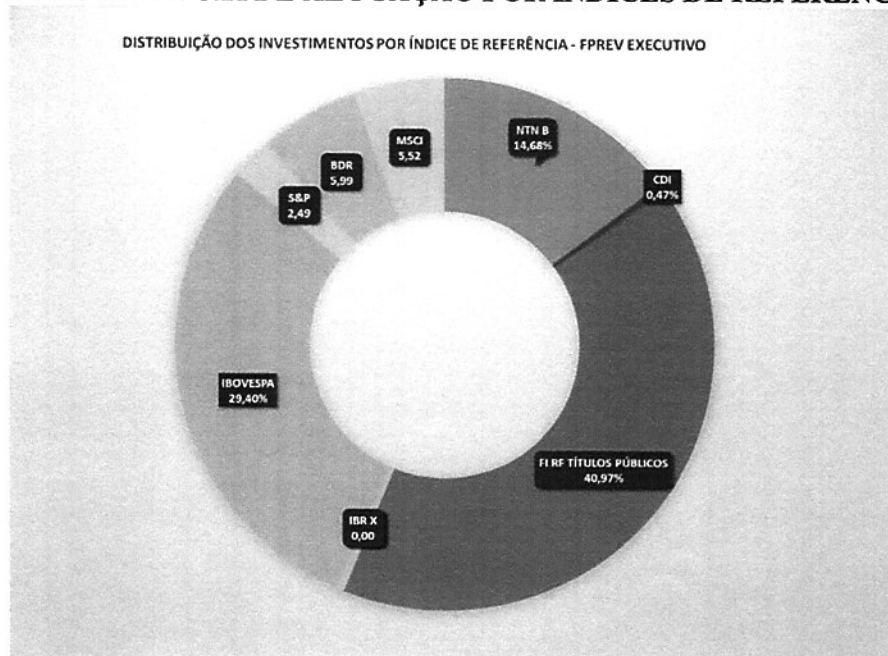


Gráfico 2.

**2.8 SALDOS CVS – FPREV**

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/08/2021	30/09/2021
CVS - A	R\$ 1.117.826,22	R\$ 1.100.372,90
CVS - B	R\$ 7.232.180,10	R\$ 7.119.202,30
CVS - C	R\$ 145.006,68	R\$ 142.742,60
CVS - D	R\$ 793.104,84	R\$ 780.715,32
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 9.288.117,84</b>	<b>R\$ 9.143.033,12</b>

Quadro 7.

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

**2.9 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
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 257.095,90</b>	<b>R\$ 1.305.762,08</b>	<b>R\$ 1.562.857,98</b>

Quadro 8.

**2.10 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\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 130.907,16</b>	<b>R\$ 602.186,40</b>	<b>R\$ 733.093,56</b>

Quadro 9.

**2.11 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO**

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	31/08/2021	30/09/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.240.079.960,63	R\$ 4.193.844.670,22	84,1045%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 709.552.566,96	R\$ 721.644.547,26	14,4721%
TÍTULOS CVS	R\$ 9.288.117,84	R\$ 9.143.033,12	0,1834%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 61.835.325,18	1,2401%
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ 8.000.000,00	R\$ -	0,0000%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00	0,0000%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 5.028.755.971,61</b>	<b>R\$ 4.986.467.576,78</b>	<b>100,00%</b>

Quadro 10.

## 2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
set/20	R\$ 4.651.365.387,53	-3,05%	-10,10%	-3,39%
out/20	R\$ 4.549.328.612,79	-2,19%	-12,07%	-7,68%
nov/20	R\$ 4.700.643.285,36	3,33%	-9,15%	-5,39%
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%

Quadro 11.

## 2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

## 1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 09/2020		RS 4.651.365.387,53	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
10/2020	RS 38.961.921,68	RS 112.188.198,10	RS -73.226.276,42
11/2020	RS 39.697.646,11	RS 116.368.518,74	RS -76.670.872,63
12/2020	RS 117.527.713,10	RS 175.934.562,52	RS -58.406.849,42
01/2021	RS 584.279,15	RS 82.104.432,44	RS -81.520.153,29
02/2021	RS 40.864.605,59	RS 44.974.382,51	RS -4.109.776,92
03/2021	RS 41.485.170,47	RS 10.665.619,53	RS 30.819.550,94
04/2021	RS 41.308.639,76	RS 10.074.221,86	RS 31.234.417,90
05/2021	RS 41.318.216,48	RS 14.353.928,89	RS 26.964.287,59
06/2021	RS 50.044.250,01	RS 10.611.950,64	RS 39.432.299,37
07/2021	RS 47.181.791,70	RS 9.896.860,10	RS 37.284.931,60
08/2021	RS 26.480.105,00	RS 11.394.062,81	RS 15.086.042,19
09/2021	RS 41.572.477,52	RS 10.674.589,38	RS 30.897.888,14
Saldo dos Investimentos em 09/2021		RS 4.986.467.576,78	

## 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	10,2464%	6,8990%	1,1600%
Juros	5,4500%	4,0603%	0,4432%
Meta	16,2548%	11,2393%	1,6083%
Rentabilidade em %	9,3254%	1,0900%	-1,4554%
Rentabilidade em RS	RS 417.316.700,20	RS 52.378.080,15	RS -73.186.282,97
Resultado em %	-5,9606%	-9,1239%	-3,0152%
Resultado em RS	RS -310.160.101,45	RS -487.536.295,59	RS -154.065.930,85

Quadro 12.

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

### 3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO– FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.108.609,32	R\$ 5.126.742,57	(0,7756)	(1,4496)	0,3550	-1,8668%	-1,1629%	0,8548%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 88.427,53	R\$ 89.167,60	0,1600	0,3100	0,8400	1,3144%	2,3200%	2,7200%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 1.987.209,29	R\$ 2.000.703,31	0,0600	(0,1700)	0,6800	0,5691%	3,0200%	7,0200%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF I.P	R\$ -	R\$ 75.480,30	-	-	(1,3400)	-1,3400%	-1,3400%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ -	R\$ 75.741,27	-	-	(0,6000)	-0,6000%	-0,6000%	NC
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 354.408,82	R\$ 358.071,45	0,0800	0,1784	1,0334	1,2946%	2,7345%	NC
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 7.538.654,96</b>	<b>R\$ 7.725.906,50</b>						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 515.096,48	R\$ 481.068,70	(4,9100)	(2,9500)	(6,6100)	-13,8152%	-11,0000%	6,9400%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.494.804,33	R\$ 1.362.647,53	(4,5700)	(6,8215)	(8,8411)	-18,9413%	-15,3143%	-0,8600%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ -	R\$ 484.035,22	-	-	(3,7457)	-3,7457%	-3,7457%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$ 2.097.286,94	R\$ 1.951.992,00	(4,1200)	(2,4400)	(6,9300)	-12,9418%	-8,9200%	11,8700%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 137.374,80	R\$ 128.403,91	(2,6600)	(2,0700)	(6,5300)	-10,8997%	-9,4000%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 403.216,25	R\$ 384.786,16	2,5800	3,3200	(4,5700)	1,1421%	17,1200%	NC
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 158.168,39	R\$ 150.881,04	2,5800	3,3600	(4,6100)	1,1389%	17,4500%	NC
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 5.285.798,79</b>	<b>R\$ 4.943.814,56</b>						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.522.745,31	R\$ 1.510.446,93	6,2100	2,2400	(0,8100)	7,7095%	19,0400%	20,6200%
<b>TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 1.522.745,31</b>	<b>R\$ 1.510.446,93</b>						

<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 14.347.199,06</b>	<b>R\$ 14.180.167,99</b>						
--------------------	--------------------------	--------------------------	--	--	--	--	--	--

Quadro 13.

**Nota 1:** Com base na Ata COMIV nº. 178/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Ratear entre os fundos Safra IMA Institucional FIC FI RF e Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF.

**Nota 2:** Com base na Ata nº 178/2021, devidamente autorizado pela Diretoria, foi migrado os recursos dos poderes, aplicados no Caixa Consumo (10.577.512/0001-79) para o fundo Caixa FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE QUANTITATIVO (30.068.169/0001-44).

#### 3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.397.728,33	R\$ 2.439.066,29	1,5229	1,4324	1,7240	3,1812%	12,3477%	16,1624%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 2.397.728,33</b>	<b>R\$ 2.439.066,29</b>						

Quadro 14.

**3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV**

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	31/08/2021	30/09/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 7.538.654,96	R\$ 7.725.906,50
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 5.285.798,79	R\$ 4.943.814,56
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.522.745,31	R\$ 1.510.446,93
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.397.728,33	R\$ 2.439.066,29
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 16.744.927,39</b>	<b>R\$ 16.619.234,28</b>

Quadro 15.

**3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação**



Gráfico 3.

*[Handwritten signatures and initials]*

## 3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

### 1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 09/2020		RS 13.772.193,11	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
10/2020	RS 143.453,76	RS 0,00	RS 143.453,76
11/2020	RS 143.747,84	RS 0,00	RS 143.747,84
12/2020	RS 133.342,71	RS 0,00	RS 133.342,71
01/2021	RS 286.790,86	RS 0,00	RS 286.790,86
02/2021	RS 143.097,24	RS 0,00	RS 143.097,24
03/2021	RS 143.973,76	RS 0,00	RS 143.973,76
04/2021	RS 144.001,52	RS 0,00	RS 144.001,52
05/2021	RS 144.070,46	RS 0,00	RS 144.070,46
06/2021	RS 144.136,78	RS 0,00	RS 144.136,78
07/2021	RS 174.168,74	RS 0,00	RS 174.168,74
08/2021	RS 152.615,42	RS 0,00	RS 152.615,42
09/2021	RS 152.252,38	RS 0,00	RS 152.252,38
Saldo dos Investimentos em 09/2021		RS 16.619.234,28	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,2464 %	6,8990 %	1,1600 %
Juros	5,4500 %	4,0603 %	0,4432 %
Meta	16,2548 %	11,2393 %	1,6083 %
Rentabilidade em %	6,4276 %	-0,2064 %	-1,6598 %
Rentabilidade em RS	RS 941.389,70	RS -32.774,47	RS -277.939,49
Resultado em %	-8,4531 %	-10,2893 %	-3,2165 %
Resultado em RS	RS -1.436.984,34	RS -1.815.830,37	RS -547.255,27

Quadro 16.

**4. RECURSOS DO MPE – FPREV**

**4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.571.389,73	R\$ 7.598.264,65	(0,7756)	(1,4496)	0,3550	-1,8668%	-1,1629%	0,8548%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.066.342,19	R\$ 40.004.642,72	(0,2000)	(0,5000)	(0,1500)	-0,8480%	-1,6500%	1,2946%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 77.926.198,75	R\$ 77.922.059,24	(0,2496)	(0,4488)	(0,0053)	-0,7025%	-1,3789%	1,7519%
BRDESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 812.143,42	-	-	0,4900	NC	0,4900%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FIA RF	R\$ -	R\$ 809.947,63	-	-	(0,6000)	NC	-0,6000%	NC
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.196.056,81	R\$ 3.229.086,35	0,0834	0,1784	1,0334	1,2981%	3,1227%	NC
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 128.759.987,48</b>	<b>R\$ 130.376.144,01</b>						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 27.264.879,79	R\$ 25.458.498,57	(3,7800)	(3,6600)	(6,6300)	-13,4476%	-7,3911%	NC
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.621.068,77	R\$ 1.515.209,28	(2,6600)	(2,0700)	(6,5300)	-10,8997%	-7,9938%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.797.602,59	R\$ 3.624.022,93	2,5800	3,3200	(4,5700)	1,1421%	1,1421%	NC
BB AÇÕES VALOR	R\$ 22.108.047,88	R\$ 21.550.566,69	(2,3187)	(1,8102)	(2,5216)	-6,5055%	8,9860%	NC
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 54.791.599,03</b>	<b>R\$ 52.148.297,47</b>						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 4.595,51	R\$ -
<b>TOTAL RECURSOS</b>	<b>R\$ 183.556.182,02</b>	<b>R\$ 182.524.441,48</b>

Quadro 17.

Nota: Com base na Ata COMIV nº. 178/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Ratear entre os fundos Safra IMA Institucional FIC FI RF e Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF.



## 4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

### 1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 09/2020		RS 158.582.971,80	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
10/2020	RS 1.490.094,20	RS 9.164,74	RS 1.480.929,46
11/2020	RS 1.503.550,04	RS 9.164,74	RS 1.494.385,30
12/2020	RS 1.579.792,66	RS 12.799,56	RS 1.566.993,10
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
Saldo dos Investimentos em 09/2021		RS 182.524.441,48	

### 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	10,2464 %	6,8990 %	1,1600 %
Juros	5,4500 %	4,0603 %	0,4432 %
Meta	16,2548 %	11,2393 %	1,6083 %
Rentabilidade em %	1,7718 %	-1,7725 %	-1,4574 %
Rentabilidade em RS	RS 2.979.177,75	RS -3.137.753,69	RS -2.675.234,71
Resultado em %	-12,4580 %	-11,6972 %	-3,0173 %
Resultado em RS	RS -24.314.596,66	RS -23.015.614,63	RS -5.627.443,27

Quadro 18.

**5. RECURSOS DO DPE – FPREV****5.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos –DPE/FPREV**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 7.727.428,36	R\$ 7.754.857,13	(0,7756)	(1,4496)	0,3550	-1,8668%	-1,1629%	0,8548%
BRADESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.525.617,34	R\$ 8.512.488,48	(0,2000)	(0,5000)	(0,1500)	-0,8480%	-1,6500%	1,3000%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.373.212,22	R\$ 9.462.291,22	(0,0200)	0,0800	0,9500	1,0106%	1,6900%	4,9800%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 566.941,02	-	-	0,4900	NC	0,4900%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ -	R\$ 565.408,19	-	-	(0,6000)	NC	-0,6000%	NC
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.034.605,97	R\$ 2.055.632,53	0,0834	0,1784	1,0334	1,2981%	1,6836%	NC
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 27.660.863,89</b>	<b>R\$ 28.917.618,57</b>						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.090.019,84	R\$ 1.018.839,07	(2,6600)	(2,0700)	(6,5300)	-10,8997%	-1,5661%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	R\$ 991.232,58	R\$ 925.560,40	(3,7800)	(3,6600)	(6,6300)	-13,4476%	-6,6806%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 2.327.816,67	R\$ 2.221.417,55	2,5800	3,3200	(4,5700)	1,1421%	1,1421%	NC
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ -	R\$ 14.906,07	-	-	(3,7457)	NC	-3,7457%	NC
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 15.456,97	R\$ -	(5,3208)	(4,0389)	-	-9,1448%	-0,0417%	NC
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 4.424.526,06</b>	<b>R\$ 4.180.723,09</b>						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 18.285,14	R\$ -
<b>TOTAL RECURSOS</b>	<b>R\$ 32.103.675,09</b>	<b>R\$ 33.098.341,66</b>

Quadro 19.

**Nota 1:** Com base na Ata COMIV nº. 178/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Ratear entre os fundos Safra IMA Institucional FIC FI RF e Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF.

**Nota 2:** Com base na Ata nº 178/2021, devidamente autorizado pela Diretoria, foi migrado os recursos dos poderes, aplicados no Caixa Consumo (10.577.512/0001-79) para o fundo Caixa FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE QUANTITATIVO (30.068.169/0001-44).

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1. Investimentos - Defensoria

Saldo dos Investimentos em 09/2020		R\$ 19.894.994,44	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
10/2020	R\$ 952.657,42	R\$ 0,00	R\$ 952.657,42
11/2020	R\$ 969.890,42	R\$ 19.728,47	R\$ 950.161,95
12/2020	R\$ 2.981.491,21	R\$ 92.070,31	R\$ 2.889.420,90
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
Saldo dos Investimentos em 09/2021		R\$ 33.098.341,66	

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

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	10,2464 %	6,8990 %	1,1600 %
Juros	5,4500 %	4,0603 %	0,4432 %
Meta	16,2548 %	11,2393 %	1,6083 %
Rentabilidade em %	1,2943 %	-1,0786 %	-0,5370 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 335.633,04	R\$ -305.145,94	R\$ -172.395,61
Resultado em %	-12,8687 %	-11,0733 %	-2,1114 %
Resultado em R\$	R\$ -3.856.292,37	R\$ -3.476.010,10	R\$ -688.732,84

Quadro 20.

## 6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 161.651.695,53	R\$ 162.225.484,25	(0,7756)	(1,4496)	0,3550	-1,8668%	-1,1629%	0,8548%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.091.797,70	R\$ 51.089.083,65	(0,2496)	(0,4488)	(0,0053)	-0,7025%	-1,3789%	1,7518%
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 166.456.886,19	R\$ 168.177.128,96	0,0834	0,1784	1,0334	1,2981%	1,6834%	NC
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 1.856.699,67	-	-	0,4900	NC	0,4900%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ -	R\$ 1.851.679,71	-	-	(0,6000)	NC	-0,6000%	NC
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 41.180.570,03	R\$ 41.278.857,60	(0,0200)	0,0800	0,9500	1,0106%	1,6900%	4,9800%
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 420.380.949,45</b>	<b>R\$ 426.478.933,84</b>						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 9.737.711,32	R\$ -	(5,3208)	(4,0389)	-	-9,1448%	-6,7010%	-1,0371%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.538.305,46	R\$ 3.307.246,03	(2,6600)	(2,0700)	(6,5300)	-10,8997%	-7,9938%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 11.232.426,93	R\$ 10.719.018,59	2,5800	3,3200	(4,5700)	1,1421%	1,1421%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 4.864.491,85	R\$ 4.542.204,47	(3,7800)	(3,6600)	(6,6300)	-13,4476%	-7,3912%	NC
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ -	R\$ 9.390.649,23	-	-	(3,7457)	NC	-3,7457%	NC
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 29.372.935,56</b>	<b>R\$ 27.959.118,32</b>						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 28.122.318,28	R\$ 28.738.122,18	6,7517	0,9099	2,1897	10,0818%	17,5861%	NC
<b>TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 28.122.318,28</b>	<b>R\$ 28.738.122,18</b>						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 29.849,60	R\$ -						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 477.906.052,89</b>	<b>R\$ 483.176.174,34</b>						

Quadro 21.

**Nota 1:** Com base na Ata COMIV nº. 178/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Ratear entre os fundos - Safra IMA Institucional FIC FI RF e Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF.

**Nota 2:** Com base na Ata nº 178/2021, devidamente autorizado pela Diretoria, foi migrado os recursos dos poderes, aplicados no Caixa Consumo (10.577.512/0001-79) para o fundo Caixa FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE QUANTITATIVO (30.068.169/0001-44).

## 6.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO

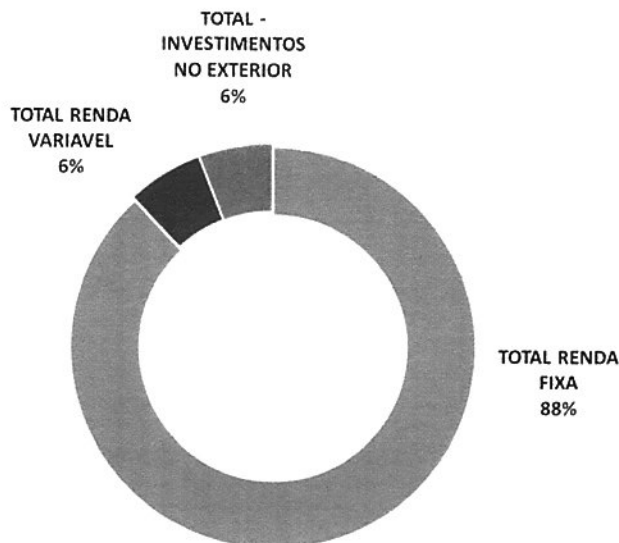


Gráfico 4.

## 6.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

### 1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 09/2020		RS 427.232.997,60	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
10/2020	RS 3.325.215,77	RS 305.986,37	RS 3.019.229,40
11/2020	RS 3.555.836,55	RS 303.719,14	RS 3.252.117,41
12/2020	RS 6.779.546,58	RS 408.928,65	RS 6.370.617,93
01/2021	RS 3.459.800,94	RS 280.567,30	RS 3.179.233,64
02/2021	RS 3.471.253,44	RS 284.979,37	RS 3.186.274,07
03/2021	RS 3.427.904,40	RS 367.719,45	RS 3.060.184,95
04/2021	RS 3.574.036,92	RS 317.977,95	RS 3.256.058,97
05/2021	RS 3.591.371,99	RS 308.689,08	RS 3.282.682,91
06/2021	RS 3.620.988,47	RS 346.178,51	RS 3.274.809,96
07/2021	RS 3.670.676,51	RS 315.553,25	RS 3.355.123,26
08/2021	RS 3.690.680,27	RS 318.681,54	RS 3.371.998,73
09/2021	RS 3.738.023,51	RS 317.532,32	RS 3.420.491,19
Saldo dos Investimentos em 09/2021		RS 483.176.174,34	

### 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	10,2464 %	6,8990 %	1,1600 %
Juros	5,4500 %	4,0603 %	0,4432 %
Meta	16,2548 %	11,2393 %	1,6083 %
Rentabilidade em %	3,1128 %	0,4863 %	0,3870 %
Rentabilidade em RS	RS 13.914.354,32	RS 2.257.984,46	RS 1.849.630,26
Resultado em %	-11,3045 %	-9,6666 %	-1,2020 %
Resultado em RS	RS -58.676.463,35	RS -49.903.796,72	RS -5.836.738,59

Quadro 22.

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 41.428.422,93	R\$ 41.575.474,67	(0,7756)	(1,4496)	0,3550	-1,8668%	-1,1629%	0,8548%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 31.132.951,51	R\$ 31.454.693,89	0,0834	0,1784	1,0334	1,2981%	2,7345%	6,0468%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.213.891,74	R\$ 21.212.764,83	(0,2496)	(0,4488)	(0,0053)	-0,7025%	-1,3789%	1,7518%
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ -	R\$ 298.342,90	-	-	0,4900	NC	0,4900%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ -	R\$ 298.342,89	-	-	(0,6000)	NC	-0,6000%	NC
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.536.461,89	R\$ 7.575.830,72	(0,0200)	0,0800	0,9500	1,0106%	1,6900%	4,9800%
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 101.311.728,07</b>	<b>R\$ 102.415.449,90</b>						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 955.916,41	R\$ 893.492,88	(2,6600)	(2,0700)	(6,5300)	-10,8997%	-1,5661%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 1.664.705,39	R\$ 1.588.615,54	2,5800	3,3238	(4,5700)	1,1459%	5,9896%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 517.346,84	R\$ 483.071,04	(3,7800)	(3,6600)	(6,6300)	-13,4476%	5,8478%	NC
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ -	R\$ 9.390.649,23	-	-	(3,7457)	NC	-3,7457%	NC
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 12.875.679,96</b>	<b>R\$ 12.355.828,69</b>						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/08/2021	30/09/2021	jul/21	ago/21	set/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 537.856,51	R\$ 549.634,13	6,7517	0,9099	2,1897	10,0818%	5,5985%	NC
<b>TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 537.856,51</b>	<b>R\$ 549.634,13</b>						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 7.463,96	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 114.732.728,50</b>	<b>R\$ 115.320.912,72</b>

Quadro 23.

Nota 1: Com base na Ata COMIV nº. 178/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Ratear entre os fundos Safra IMA Institucional FIC FI RF e Icatu Vanguarda Inflação Longa FI RF.

Nota 2: Com base na Ata nº 178/2021, devidamente autorizado pela Diretoria, foi migrado os recursos dos poderes, aplicados no Caixa Consumo (10.577.512/0001-79) para o fundo Caixa FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE QUANTITATIVO (30.068.169/0001-44).

7.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação



Gráfico 5.

*[Handwritten signatures and initials]*

## 7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

### 1. Investimentos - Tribunal de Contas

<b>Saldo dos Investimentos em 09/2020</b>	RS 106.676.016,00
---	-------------------

Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
10/2020	RS 521.775,18	RS 0,00	RS 521.775,18
11/2020	RS 1.032.124,86	RS 0,00	RS 1.032.124,86
12/2020	RS 521.263,88	RS 0,00	RS 521.263,88
01/2021	RS 7.943,52	RS 0,00	RS 7.943,52
02/2021	RS 1.040.178,80	RS 0,00	RS 1.040.178,80
03/2021	RS 523.658,87	RS 0,00	RS 523.658,87
04/2021	RS 4.964,70	RS 0,00	RS 4.964,70
05/2021	RS 1.036.389,86	RS 67.687,34	RS 968.702,52
06/2021	RS 521.558,25	RS 32.206,97	RS 489.351,28
07/2021	RS 523.292,11	RS 39.670,93	RS 483.621,18
08/2021	RS 587.761,57	RS 32.116,97	RS 555.644,60
09/2021	RS 596.685,79	RS 32.206,97	RS 564.478,82

<b>Saldo dos Investimentos em 09/2021</b>	RS 115.320.912,72
---	-------------------

### 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	10,2464 %	6,8990 %	1,1600 %
Juros	5,4500 %	4,0603 %	0,4432 %
Meta	16,2548 %	11,2393 %	1,6083 %
Rentabilidade em %	1,7581 %	-1,0537 %	0,0207 %
Rentabilidade em R\$	RS 1.931.188,51	RS -1.199.294,41	RS 23.705,40
Resultado em %	-12,4698 %	-11,0510 %	-1,5626 %
Resultado em R\$	RS -15.912.002,40	RS -13.986.376,54	RS -1.821.590,48

Quadro 24.

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 09/2020			RS 5.377.524.560,48
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
10/2020	RS 45.395.118,01	RS 112.503.349,21	RS -67.108.231,20
11/2020	RS 46.902.795,82	RS 116.701.131,09	RS -69.798.335,27
12/2020	RS 129.523.150,14	RS 176.448.361,04	RS -46.925.210,90
01/2021	RS 7.353.548,08	RS 82.470.359,61	RS -75.116.811,53
02/2021	RS 48.107.390,60	RS 45.312.469,30	RS 2.794.921,30
03/2021	RS 48.138.137,76	RS 11.102.576,72	RS 37.035.561,04
04/2021	RS 47.625.538,29	RS 10.441.370,66	RS 37.184.167,63
05/2021	RS 48.721.181,28	RS 14.868.417,77	RS 33.852.763,51
06/2021	RS 57.352.219,15	RS 11.054.322,46	RS 46.297.896,69
07/2021	RS 54.658.695,67	RS 10.359.164,41	RS 44.299.531,26
08/2021	RS 33.721.603,56	RS 11.820.129,43	RS 21.901.474,13
09/2021	RS 48.886.060,70	RS 11.040.110,10	RS 37.845.950,60
Saldo dos Investimentos em 09/2021			RS 5.817.206.681,26

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	10,2464 %	6,8990 %	1,1600 %
Juros	5,4500 %	4,0603 %	0,4432 %
Meta	16,2548 %	11,2393 %	1,6083 %
Rentabilidade em %	8,3474 %	0,8915 %	-1,2716 %
Rentabilidade em R\$	RS 437.418.443,52	RS 49.961.096,10	RS -74.438.517,12
Resultado em %	-6,8018 %	-9,3024 %	-2,8344 %
Resultado em R\$	RS -414.356.440,57	RS -579.733.923,96	RS -168.587.691,31

Quadro 25.

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

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

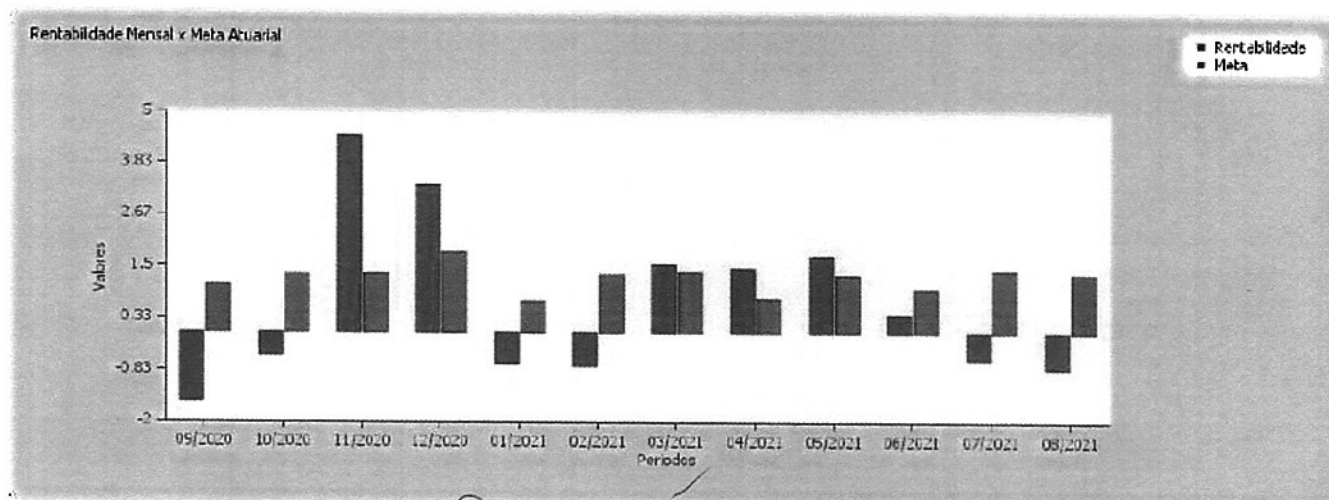


Gráfico 6.

*(Assinaturas manuscritas)*



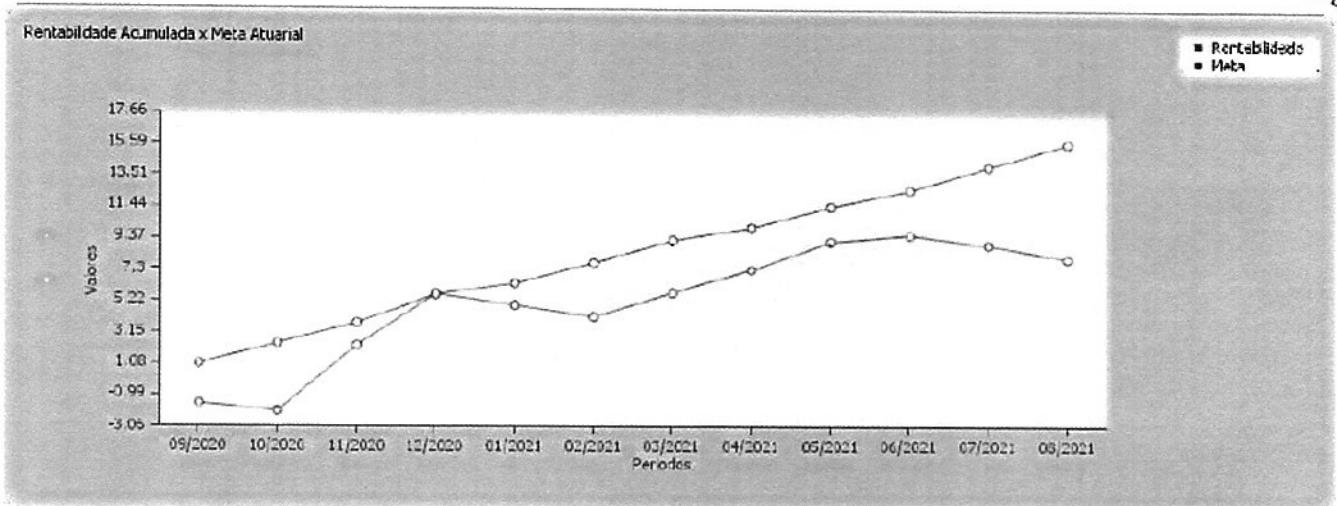


Gráfico 7.

## 9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

### 9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.408.660,37	R\$ 1.007.393,61
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 5.891.644,37	R\$ 5.932.827,20
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 13.552.100,38	R\$ 13.614.810,52
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 266.529,44	R\$ 264.295,10
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 4.698,02	R\$ 335.908,41
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 21.123.632,60</b>	<b>R\$ 21.155.234,86</b>

Quadro 26.

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

### 9.2 FPPM – Fundo de Proteção Previdenciária dos Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ -	R\$ -
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 1.944,20	R\$ 4.721,67
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 10.073,15	R\$ 10.073,15
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 12.017,35</b>	<b>R\$ 14.794,82</b>

Quadro 27.

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

**9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM**

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>

Quadro 28.

**9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 433.028,15	R\$ 491.616,21
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 63.758,87	R\$ 642.106,29
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 2.182,48	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 498.969,50</b>	<b>R\$ 1.133.722,50</b>

Quadro 29.

**9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 810.362,09	R\$ 979.934,84
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 211.751,43	R\$ 211.751,43
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 38.602,37	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 1.060.715,89</b>	<b>R\$ 1.191.686,27</b>

Quadro 30.

**9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.232.908,06	R\$ 6.461.339,79
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 559.450,60	R\$ 668.333,79
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 6.792.359,66</b>	<b>R\$ 7.129.673,58</b>

Quadro 31.

**9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.339.819,40	R\$ 1.382.039,13
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 1.005.485,09	R\$ 1.000.433,67
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 18.992,83
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.345.304,49</b>	<b>R\$ 2.401.465,63</b>

Quadro 32.

**10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO**

**10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 4.402.504,76	R\$ 2.108.526,79
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 48.332.344,21	R\$ 48.503.901,67
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 52.734.848,97</b>	<b>R\$ 50.612.429,46</b>

Quadro 33.

**10.2 Taxa de Administração - ALE**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>

Quadro 34.

**10.3 Taxa de Administração - TCE**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>

Quadro 35.

**10.4 Taxa de Administração – TJ/AM**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 153.975,40	R\$ 308.853,71
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 153.543,02	R\$ 156.029,03
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 307.518,42</b>	<b>R\$ 464.882,74</b>

Quadro 36.

**10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE**

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/08/2021	30/09/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 144.453,59	R\$ 216.538,07
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 144.453,59</b>	<b>R\$ 216.538,07</b>

<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 53.186.820,98</b>	<b>R\$ 51.293.850,27</b>
--------------------	--------------------------	--------------------------

Quadro 37.

## 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	RS 724.083.613,55	12,45%	10,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
<b>TOTAL art. 7º, inciso I, "a"</b>	<b>RS 724.083.613,55</b>				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	RS 6.993.034,60				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	RS 500.419.891,41				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	RS 482.857.113,53				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	RS 52.473.526,45				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	RS 642.165.734,24	34,33%	22,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	RS 91.564.244,38				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	RS 112.437.639,21				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	RS 106.939.482,12				
<b>TOTAL art. 7º, inciso I, "b"</b>	<b>RS 1.995.850.665,94</b>				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	RS 14.760.564,71				
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	RS 30.719.036,55				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	RS 58.316.979,54				
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	RS 48.517.131,22	10,68%	13,00%	40,00%	art. 7º, inciso IV, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	RS 468.267.248,59				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	RS 110.732,52				
<b>TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"</b>	<b>RS 620.691.693,13</b>				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	RS 30.650.002,46				
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	RS 90.183.517,50				
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	RS 45.058.394,80	3,16%	3,00%	5,00%	art. 7º, inciso VII, "b"
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	RS 18.025.419,54				
<b>TOTAL art. 7º, inciso VII, "b"</b>	<b>RS 183.917.334,30</b>				
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>RS 3.524.543.306,92</b>	<b>60,63%</b>			

Quadro 38.

## 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\$ 31.409.334,48	0,54%	3,00%	30,00%	art 8º, inciso I, "a"
<b>TOTAL art 8º, inciso I, "a"</b>	<b>R\$ 31.409.334,48</b>				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 37.461.260,03				
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 173.881.403,64				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 125.993.127,15				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 171.298.883,15				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 115.776.507,97				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.046.063,84				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 284.218.957,38				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 13.758,89				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.408.633,10				
OCCAM FIC FIA	R\$ 86.362.715,24	25,75%	30,00%	30,00%	art 8º, inciso II, "a"
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 102.856.598,74				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 30.622.087,81				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 54.926.102,39				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.007.806,04				
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 40.258.951,70				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.894.402,47				
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.779.997,05				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$ 31.412.959,02				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 37.523.282,76				
<b>TOTAL art 8º, inciso II, "a"</b>	<b>R\$ 1.496.743.498,37</b>				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 43.909.694,56	2,43%	3,00%	3,00%	art 8º, inciso III
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 97.175.646,07				
<b>TOTAL art 8º, inciso III</b>	<b>R\$ 141.085.340,63</b>				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.959.879,36				
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.405.722,59	0,40%	2,00%	5,00%	art 8º, inciso IV, "a"
<b>TOTAL art 8º, inciso IV, "a"</b>	<b>R\$ 23.365.601,95</b>				
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 1.692.603.775,43</b>	<b>29,11%</b>			

Quadro 39.

## 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\$ 52.875.820,97				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 144.647.674,99				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 30.186.927,02	5,17%	5,00%		art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 37.093.575,08			10,00%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 35.600.844,92				
<b>TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior</b>	<b>R\$ 300.404.842,98</b>				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 149.419.559,27	5,09%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 146.649.807,99				
<b>TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I</b>	<b>R\$ 296.069.367,26</b>				
<b>TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 596.474.210,24</b>	<b>10,26%</b>			
<b>TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES</b>	<b>R\$ 5.813.621.292,59</b>	<b>100%</b>			

Quadro 40.

ALOCAÇÃO TOTAL DA CARTEIRA

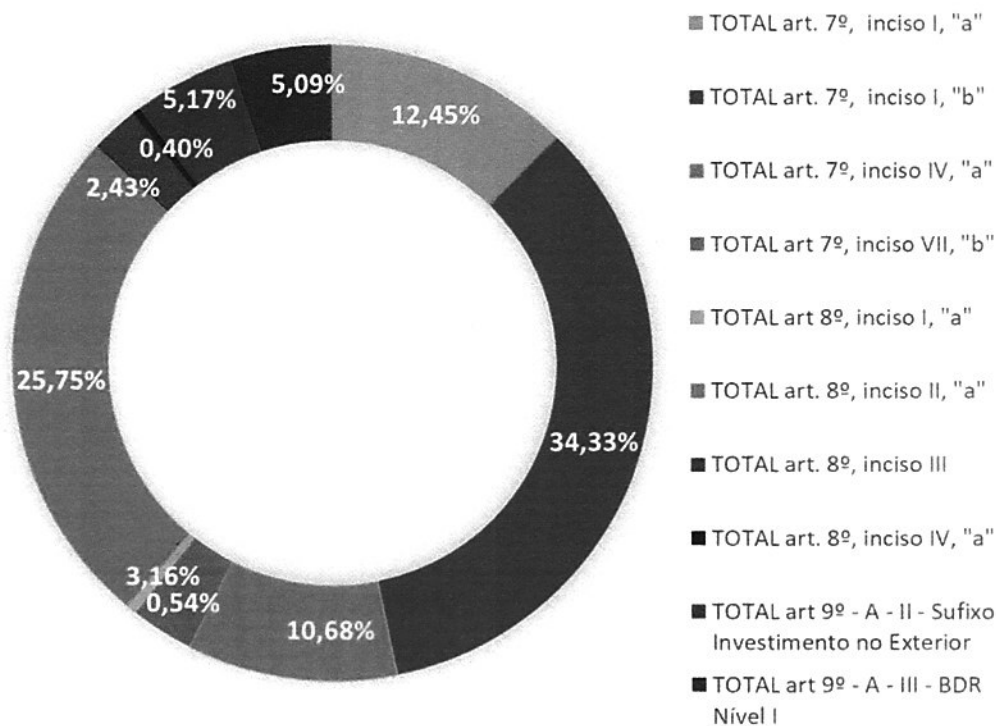


Gráfico 8.

*[Handwritten signatures and initials]*

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 40.258.951,70	0,68%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.408.633,10	1,41%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 149.419.559,27	2,53%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 52.875.820,97	0,90%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 125.993.127,15	2,13%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 468.267.248,59	7,93%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 500.419.891,41	8,48%	
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 6.993.034,60	0,12%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.779.997,05	0,15%	
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.517.131,22	0,82%	
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 30.719.036,55	0,52%	
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 173.881.403,64	2,95%	
BRDESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 31.409.334,48	0,53%	
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.316.979,54	0,99%	
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 14.760.564,71	0,25%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 54.926.102,39	0,93%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 284.218.957,38	4,82%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.959.879,36	0,24%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.007.806,04	0,15%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.405.722,59	0,16%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.473.526,45	0,89%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 482.857.113,53	8,18%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 642.165.734,24	10,88%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$ 31.412.959,02	0,53%	
CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 90.183.517,50	1,53%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.894.402,47	0,32%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 37.093.575,08	0,63%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 35.600.844,92	0,60%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 30.650.002,46	0,52%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 91.564.244,38	1,55%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.437.639,21	1,91%	
ICATÚ VANGUARDIA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.046.063,84	1,42%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 171.298.883,15	2,90%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 37.461.260,03	0,63%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 110.732,52	0,00%	
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 97.175.646,07	1,65%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 115.776.507,97	1,96%	
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 45.058.394,80	0,76%	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 18.025.419,54	0,31%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 86.362.715,24	1,46%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 146.649.807,99	2,48%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 106.939.482,12	1,81%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 43.909.694,56	0,74%	
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 13.758,89	0,00%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 144.647.674,99	2,45%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 30.186.927,02	0,51%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 30.622.087,81	0,52%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 102.856.598,74	1,74%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 37.523.282,76	0,64%	
<b>TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO</b>	<b>R\$ 5.089.537.679,04</b>		20%

Quadro 41.

**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	R\$ 6.993.034,60	R\$ 240.484.283,62	2,91%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 500.419.891,41	R\$ 9.863.752.148,95	5,07%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 468.267.248,59	R\$ 8.803.716.462,70	5,32%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 125.993.127,15	R\$ 1.165.304.307,75	10,81%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 149.419.559,27	R\$ 1.785.522.167,06	8,37%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 52.875.820,97	R\$ 2.239.794.062,67	2,36%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 14.760.564,71	R\$ 882.739.880,68	1,67%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 30.719.036,55	R\$ 3.865.180.591,77	0,79%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 58.316.979,54	R\$ 1.164.277.281,46	5,01%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.517.131,22	R\$ 1.351.295.808,04	3,59%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 31.409.334,48	R\$ 584.740.914,40	5,37%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 173.881.403,64	R\$ 2.170.284.029,75	8,01%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 482.857.113,53	R\$ 11.104.044.700,20	4,35%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.473.526,45	R\$ 214.143.376,75	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 642.165.734,24	R\$ 15.341.053.159,31	4,19%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ -	R\$ 418.048.583,42	0,00%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 110.732,52	R\$ 3.275.640.848,90	0,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 37.461.260,03	R\$ 984.203.936,75	3,81%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 171.298.883,15	R\$ 3.356.109.147,78	5,10%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 115.776.507,97	R\$ 1.231.650.839,97	9,40%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 13.758,89	R\$ 1.195.949.184,16	0,00%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 144.647.674,99	R\$ 1.973.726.587,17	7,33%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 84.046.063,84	R\$ 1.303.812.974,47	6,45%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 91.564.244,38	R\$ 1.017.145.285,28	9,00%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.437.639,21	R\$ 751.418.028,98	14,96%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 106.939.482,12	R\$ 1.353.651.560,76	7,90%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 284.218.957,38	R\$ 2.403.304.462,99	11,83%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 146.649.807,99	R\$ 3.440.944.721,55	4,26%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.408.633,10	R\$ 2.227.299.560,63	3,74%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 86.362.715,24	R\$ 1.191.393.271,47	7,25%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 102.856.598,74	R\$ 1.640.952.244,33	6,27%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 30.622.087,81	R\$ 660.464.359,27	4,64%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 37.523.282,76	R\$ 605.400.421,31	6,20%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 31.412.959,02	R\$ 468.658.477,76	6,70%	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 40.258.951,70	R\$ 926.088.302,27	4,35%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 37.093.575,08	R\$ 116.958.924.891,80	0,03%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 35.600.844,92	R\$ 38.354.210.042,69	0,09%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.007.806,04	R\$ 95.218.197,61	9,46%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.779.997,05	R\$ 305.220.195,92	2,88%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 54.926.102,39	R\$ 682.148.581,22	8,05%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.894.402,47	R\$ 187.621.708,70	10,07%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 30.186.927,02	R\$ 14.748.506.910,84	0,20%	
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.741.169.402,16</b>			

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	R\$ 43.909.694,56	R\$ 1.823.132.593,52	2,41%	5%
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 97.175.646,07	R\$ 2.487.417.356,50	3,91%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.959.879,36	R\$ 976.797.651,50	1,43%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.405.722,59	R\$ 189.848.151,53	4,95%	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 18.025.419,54	R\$ 529.418.909,97	3,40%	
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 90.183.517,50	R\$ 2.137.441.586,33	4,22%	
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 45.058.394,80	R\$ 987.746.643,66	4,56%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 30.650.002,46	R\$ 1.044.038.703,70	2,94%	
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 348.368.276,88</b>			

Quadro 42.



**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 Bradesco IBRX Alpha (14.099.976/0001-78);

**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;

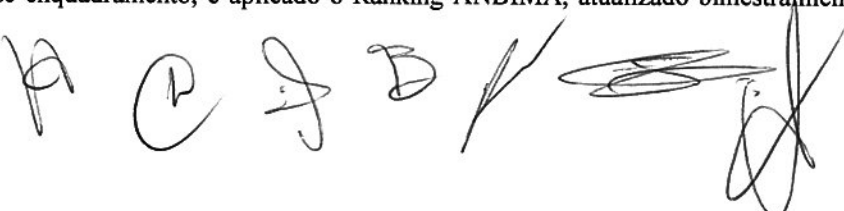
**11.6 Enquadramento IV – Limites Gerais – art. 14º - A - Res. CMN 3922/10**

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA AGOSTO/2021) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (SETEMBRO/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
CAIXA	R\$ 437.770,53	R\$ 1.208.909.333,24	0,2762%	5%
BB DTVM S.A	R\$ 1.353.479,55	R\$ 1.303.968.681,99	0,0963%	
BRDESCO	R\$ 539.258,92	R\$ 357.604.450,14	0,0663%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 33.984,03	R\$ 333.106.342,23	0,9802%	
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 759.690,97	R\$ 466.881.424,54	0,0615%	
BANCO BTG	R\$ 223.395,72	R\$ 316.592.365,37	0,1417%	
BANCO SAFRA	R\$ 106.705,47	R\$ 297.498.984,67	0,2788%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 302.558,31	R\$ 234.844.951,38	0,0776%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 15.854,77	R\$ 86.362.715,24	0,5447%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 15.881,18	R\$ 83.408.633,10	0,5252%	
PLURAL INVEST GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 34.343,62	R\$ 72.694.420,00	0,2117%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 26.256,99	R\$ 30.622.087,81	0,1166%	
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA	R\$ 27.145,78	R\$ 30.186.927,02	0,1112%	
VINCI PARTNERS	R\$ 42.251,64	R\$ 140.379.881,50	0,3322%	
ARX INVESTIMENTOS LTDA	R\$ 32.993,44	R\$ 40.258.951,70	0,1220%	
MONGERAL AEGON	R\$ 8.142,66	R\$ 18.025.419,54	0,2214%	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	R\$ 55.954,49	R\$ 8.779.997,05	0,0157%	
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADM REC LTDA	R\$ 7.255,98	R\$ 18.894.402,47	0,2604%	
BC GESTAO RECURSOS LTDA	R\$ 9.154,92	R\$ 54.926.102,39	0,6000%	

Quadro 43.

**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.



DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

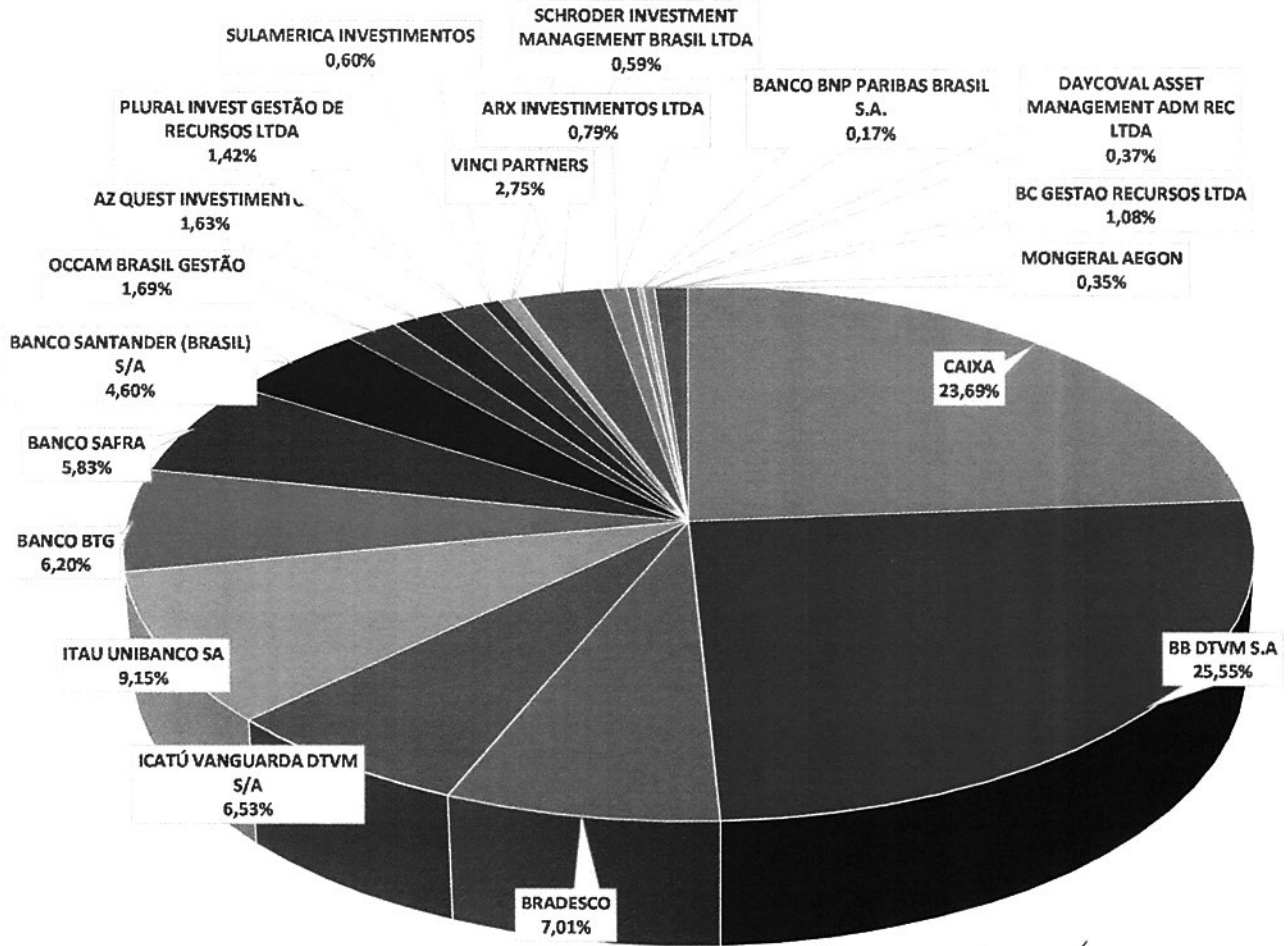


Gráfico 9.

*(Handwritten signatures and scribbles)*

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.089.537.679,43
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 724.083.613,55
TÍTULOS - CVS	R\$ 9.143.033,12
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 17.040.038,58
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 5.901.639.689,86</b>

Quadro 44.

EVOLUÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

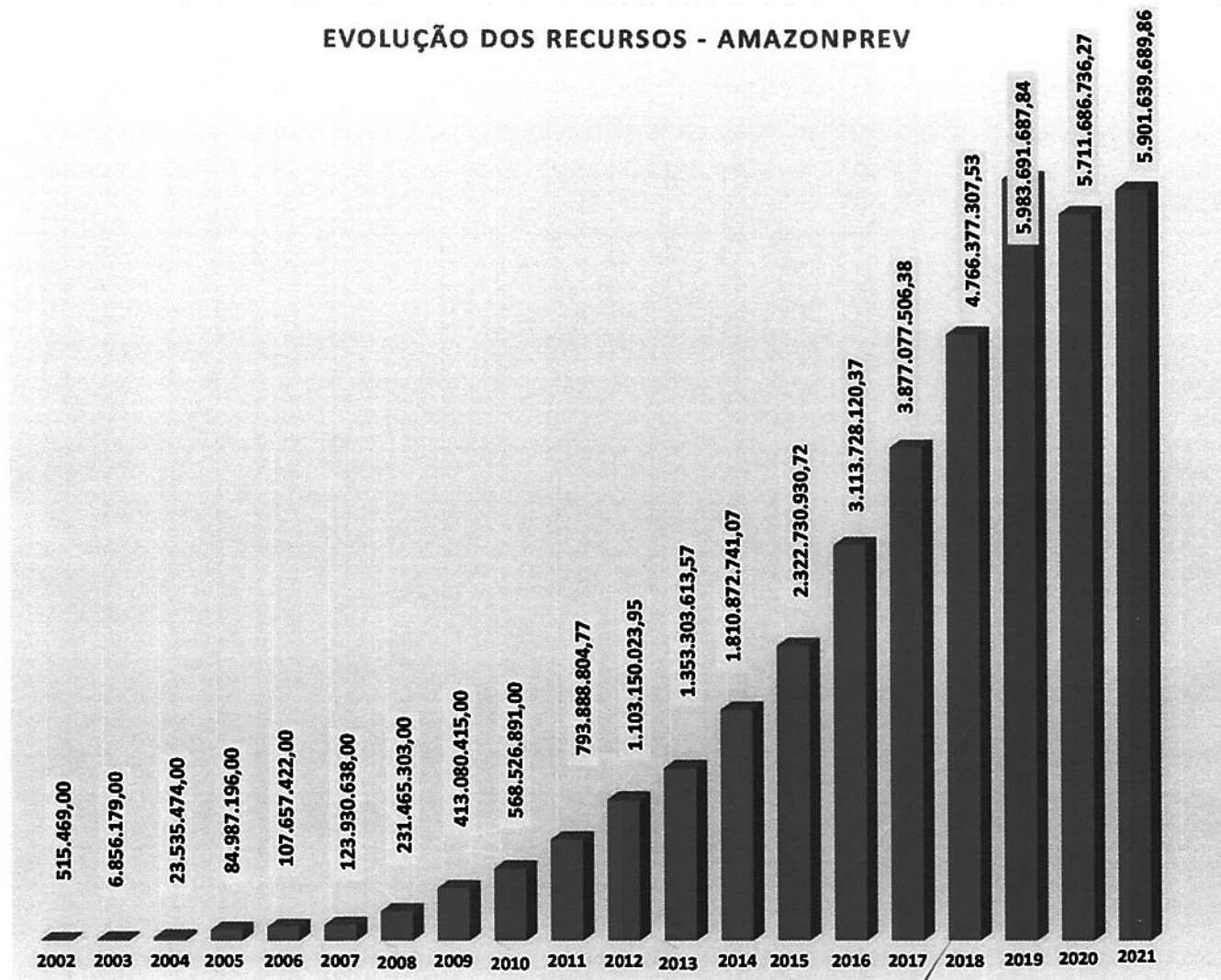


Gráfico 10.

*[Handwritten signatures and initials]*

## 13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) <b>Novos Recursos:</b> Ratear entre os fundos MONGERAL AEGON CP FI RF LP (19.488.768/0001-84); SANTANDER RF CP CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP (17.138.474/0001-05); ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI (09.093.883/0001-04); BTG PACTUAL CP I FIC DE FI RF CP (: 14.171.644/0001-57), até o limite legal permitido, passando a ser rateados entre os fundos GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03) e fundo VINCI SELECTION EQUITIES FIA (15.603.945/0001-75).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2021
FPREV ALE:	<b>Novos Recursos:</b> Ratear entre os fundos MONGERAL AEGON CP FI RF LP (19.488.768/0001-84); SANTANDER RF CP CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP (17.138.474/0001-05); ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI (09.093.883/0001-04); BTG PACTUAL CP I FIC DE FI RF CP (: 14.171.644/0001-57), até o limite legal permitido, passando a ser rateados entre os fundos GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03) e fundo VINCI SELECTION EQUITIES FIA (15.603.945/0001-75).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2021
FPREV MPE/PGJ:	<b>Novos Recursos:</b> Ratear entre os fundos MONGERAL AEGON CP FI RF LP (19.488.768/0001-84); SANTANDER RF CP CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP (17.138.474/0001-05); ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI (09.093.883/0001-04); BTG PACTUAL CP I FIC DE FI RF CP (: 14.171.644/0001-57), até o limite legal permitido, passando a ser rateados entre os fundos GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03) e fundo VINCI SELECTION EQUITIES FIA (15.603.945/0001-75).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2021
FPREV - DPE/AM	<b>Novos Recursos:</b> Ratear entre os fundos MONGERAL AEGON CP FI RF LP (19.488.768/0001-84); SANTANDER RF CP CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP (17.138.474/0001-05); ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI (09.093.883/0001-04); BTG PACTUAL CP I FIC DE FI RF CP (: 14.171.644/0001-57), até o limite legal permitido, passando a ser rateados entre os fundos GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03) e fundo VINCI SELECTION EQUITIES FIA (15.603.945/0001-75).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2021
FPREV - TJ/AM	<b>Novos Recursos:</b> Ratear entre os fundos MONGERAL AEGON CP FI RF LP (19.488.768/0001-84); SANTANDER RF CP CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP (17.138.474/0001-05); ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI (09.093.883/0001-04); BTG PACTUAL CP I FIC DE FI RF CP (: 14.171.644/0001-57), até o limite legal permitido, passando a ser rateados entre os fundos GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03) e fundo VINCI SELECTION EQUITIES FIA (15.603.945/0001-75).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2021
FPREV - TCE/AM	<b>Novos Recursos:</b> Ratear entre os fundos MONGERAL AEGON CP FI RF LP (19.488.768/0001-84); SANTANDER RF CP CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI LP (17.138.474/0001-05); ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI (09.093.883/0001-04); BTG PACTUAL CP I FIC DE FI RF CP (: 14.171.644/0001-57), até o limite legal permitido, passando a ser rateados entre os fundos GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC FIA (38.280.883/0001-03) e fundo VINCI SELECTION EQUITIES FIA (15.603.945/0001-75).	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2021
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE, FPPM)	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público, facilitando a operacionalização dos pagamentos das folhas de inativos e pensionistas desses órgãos. Devem ser observados os limites para aplicação conforme legislação vigente.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2021
RECURSOS COMPREV	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2021
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos repassados pelo Poder Executivo, devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica. Aos valores repassados pelos demais órgãos serão mantidas as aplicações atuais. Havendo necessidade, a GERAF/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/11/2021

Quadro 45.

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



GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS



**AMAZONPREV**  
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



**RELATÓRIOS - 2021**

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

# Relatório de Investimentos – Setembro/2021

AMAZONPREV  
Folha nº 029  
Queiroz

TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.457.150.335,88
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.663.917.813,50
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 596.474.210,24
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.717.542.359,62

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	set/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOURO	R\$ 724.083.613,55						
<b>TOTAL - art. 7º, inciso I, "a"</b>	<b>R\$ 724.083.613,55</b>						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "b"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	set/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 6.993.034,60	1,58%	0,16%	-0,61	7,69%	1,30%	4,66%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 52.473.526,45	5,03%	0,52%	-1,01	-0,36%	0,96%	-4,12%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 482.857.113,53	2,47%	0,26%	-1,44	5,69%	0,98%	2,30%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 593.661.832,57	2,43%	0,25%	-1,00	0,85%	0,35%	-1,16%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 91.564.244,38	2,53%	0,26%	-1,56	5,46%	0,96%	2,10%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 112.437.639,21	8,30%	0,86%	-2,25	2,75%	-1,34%	-6,98%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 106.939.482,12	6,18%	0,64%	-1,49	2,54%	-0,60%	-4,67%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 500.419.891,41	2,28%	0,24%	-1,12	6,05%	1,03%	2,73%
<b>TOTAL - art. 7º, inciso I, "b"</b>	<b>R\$ 1.947.346.764,27</b>						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso IV, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	set/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfi	R\$ 468.267.248,59	2,67%	0,28%	-0,71	1,75%	-0,01%	-1,38%
Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	R\$ 48.517.131,20	2,85%	0,29%	-0,84	1,30%	-0,15%	-1,65%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ 58.316.979,54	2,64%	0,27%	-1,52	4,98%	0,95%	1,69%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 1.550.506,80	0,32%	0,03%	-0,34	2,77%	0,44%	2,42%
Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 110.732,52	0,68%	0,07%	-0,58	2,72%	0,84%	2,32%
Bradesco FI RF RefDI Premium	R\$ 25.040.025,11	0,18%	0,02%	-0,12	3,26%	0,49%	2,84%
<b>TOTAL - art. 7º, inciso IV, "a"</b>	<b>R\$ 601.802.623,76</b>						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso VII, "b"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	set/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 30.650.002,46	3,20%	0,33%	-1,36	7,02%	0,68%	3,02%
Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	R\$ 18.025.419,54	0,35%	0,04%	-0,06	5,40%	0,55%	4,05%
Santander RF Créd Priv Crescimento Institucional F	R\$ 90.183.517,50	0,39%	0,04%	-0,09	4,74%	0,60%	3,85%
Itau High Grade RF Cred Priv FICFI	R\$ 45.058.394,80	0,26%	0,03%	-0,08	3,65%	0,59%	3,00%
<b>TOTAL - art. 7º, inciso VII, "b"</b>	<b>R\$ 183.917.334,30</b>						



# Relatório de Investimentos – Setembro/2021

AMAZONPREV

Folha nº 040

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso I, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	set/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	R\$ 31.409.334,48	20,11%	2,07%	-10,90	14,94%	-6,63%	-7,39%
<b>TOTAL - art. 8º, inciso I, "a"</b>	<b>R\$ 31.409.334,48</b>						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso II, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	set/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Ações Valor FICFIA	R\$ 125.993.127,15	20,52%	2,12%	-15,12	29,38%	-2,52%	-2,28%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 173.881.403,64	20,10%	2,07%	-10,17	17,72%	-3,91%	2,47%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 284.218.957,38	20,87%	2,15%	-9,04	-4,83%	-8,84%	-15,32%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	R\$ 84.046.063,84	18,05%	1,86%	-9,60	6,94%	-6,61%	-11,00%
Itau Acoes Dunamis Fc	R\$ 171.298.883,15	18,08%	1,86%	-6,97	19,26%	-6,52%	-0,57%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 37.461.260,03	19,48%	2,01%	-10,50	11,40%	-6,60%	-8,41%
Itau Small Cap Master FIA	R\$ 115.776.507,97	21,06%	2,17%	-9,56	24,98%	-4,11%	1,96%
Sant Seleoao Crescimento Acoes Fc FI	R\$ -	20,46%	2,10%	-12,23	5,40%	-7,96%	-11,34%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 83.408.633,10	19,62%	2,02%	-10,73	15,17%	-4,21%	-1,54%
Occam Fc de FIA	R\$ 86.362.715,24	20,30%	2,09%	-12,30	11,87%	-6,93%	-8,92%
Sul America Equities FIA	R\$ 30.622.087,81	19,81%	2,04%	-11,50	6,68%	-7,31%	-9,02%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 9.007.806,04	18,71%	1,93%	-9,78	7,56%	-3,84%	-8,15%
Vinci Mosaico Institucional FIA	R\$ 102.856.598,74	19,13%	1,97%	-10,27	11,25%	-6,97%	-8,19%
Vinci Selection Equities FIA	R\$ 37.523.282,76	17,85%	1,84%	-10,60	11,77%	-5,28%	-5,55%
Brasil Capital Master 30 II FIA	R\$ 54.926.102,50	19,99%	2,06%	-10,06	14,54%	-6,29%	-5,65%
Bnpp Action Fc FIA	R\$ 8.779.997,05	19,80%	2,04%	-11,80	11,21%	-6,13%	-9,31%
Daycoval Ibovespa Ativo FIA	R\$ 18.894.402,47	20,67%	2,13%	-11,29	9,84%	-8,39%	-10,54%
Caixa FIC FIA Acoes Livre Quantitativo	R\$ 12.132.719,27	20,18%	2,08%	-7,47	25,32%	-3,72%	4,66%
ARX Income Inst Fc FIA	R\$ 40.258.951,70	18,61%	1,92%	-10,58		-3,60%	-3,00%
<b>TOTAL - art. 8º, inciso II, "a"</b>	<b>R\$ 1.477.463.258,73</b>						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso III	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	set/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
Safra S P Reais Pb FI Mult	R\$ 43.909.694,86	13,75%	1,42%	-6,78	30,43%	-4,57%	17,12%
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	R\$ 97.175.646,07	13,90%	1,44%	-7,01	30,80%	-4,61%	17,45%
<b>TOTAL - art. 8º, inciso III</b>	<b>R\$ 141.085.340,93</b>						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso IV, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	set/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BTG Pactual Economia Real FIP	R\$ 13.959.879,36						
<b>TOTAL - art. 8º, inciso IV, "a"</b>	<b>R\$ 13.959.879,36</b>						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	set/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 52.875.820,97	18,90%	1,96%	-10,91	29,49%	2,19%	20,16%
Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	R\$ 144.647.674,99	16,61%	1,72%	-5,30	20,85%	1,33%	15,97%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	R\$ 30.186.927,02	18,86%	1,95%	-9,75	29,65%	1,46%	20,32%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 35.600.844,92	32,32%	3,32%	-10,83		-1,35%	8,91%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 37.093.575,08	18,83%	1,94%	-10,58		2,57%	10,44%
<b>TOTAL - art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior</b>	<b>R\$ 300.404.842,98</b>						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	set/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nível I	R\$ 149.419.559,27	18,23%	1,88%	-11,63	19,87%	0,71%	18,67%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nível I	R\$ 146.649.807,99	18,13%	1,87%	-10,16	20,62%	-0,81%	19,04%
<b>TOTAL - TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I</b>	<b>R\$ 296.069.367,26</b>						

## Quadro 1.

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

**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.

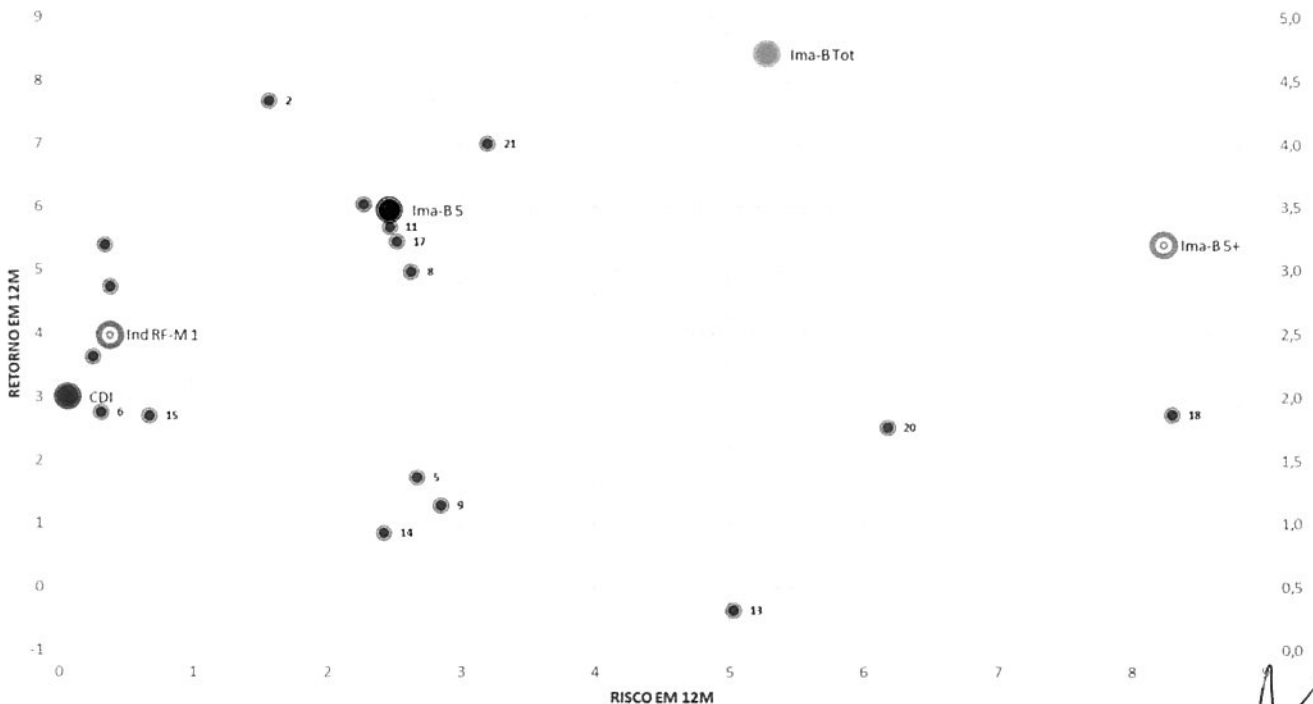


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

*[Assinaturas manuscritas]*



Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
2	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Tit Publ VII FI	7,69	1,58	D+000	D+000
4	art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Idka 2 FI	6,05	2,28	D+001	D+001
5	art. 7º, inciso IV, "a"	BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfi	1,75	2,67	D+003	D+003
6	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	2,77	0,32	D+000	D+000
8	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	4,98	2,64	D+001	D+001
9	art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	1,30	2,85	D+003	D+004
11	art. 7º, inciso I, "b"	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	5,69	2,47	D+000	D+000
13	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	-0,36	5,03	D+000	D+000
14	art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	0,85	2,43	D+000	D+000
15	art. 7º, inciso IV, "a"	Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	2,72	0,68	D+000	D+001
17	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	5,46	2,53	D+000	D+001
18	art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	2,75	8,30	D+000	D+001
20	art. 7º, inciso I, "b"	Safra Ima Institucional Fc FI RF	2,54	6,18	D+003	D+004
21	art. 7º, inciso VII, "b"	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	7,02	3,20	D+005	D+006
22	art. 7º, inciso VII, "b"	Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	5,40	0,35	D+000	D+001
23	art. 7º, inciso VII, "b"	Santander RF Créd Priv Crescimento Institucio	4,74	0,39	D+000	D+001
24	art. 7º, inciso VII, "b"	Itau High Grade RF Cred Priv FICFI	3,65	0,26	D+000	D+000

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

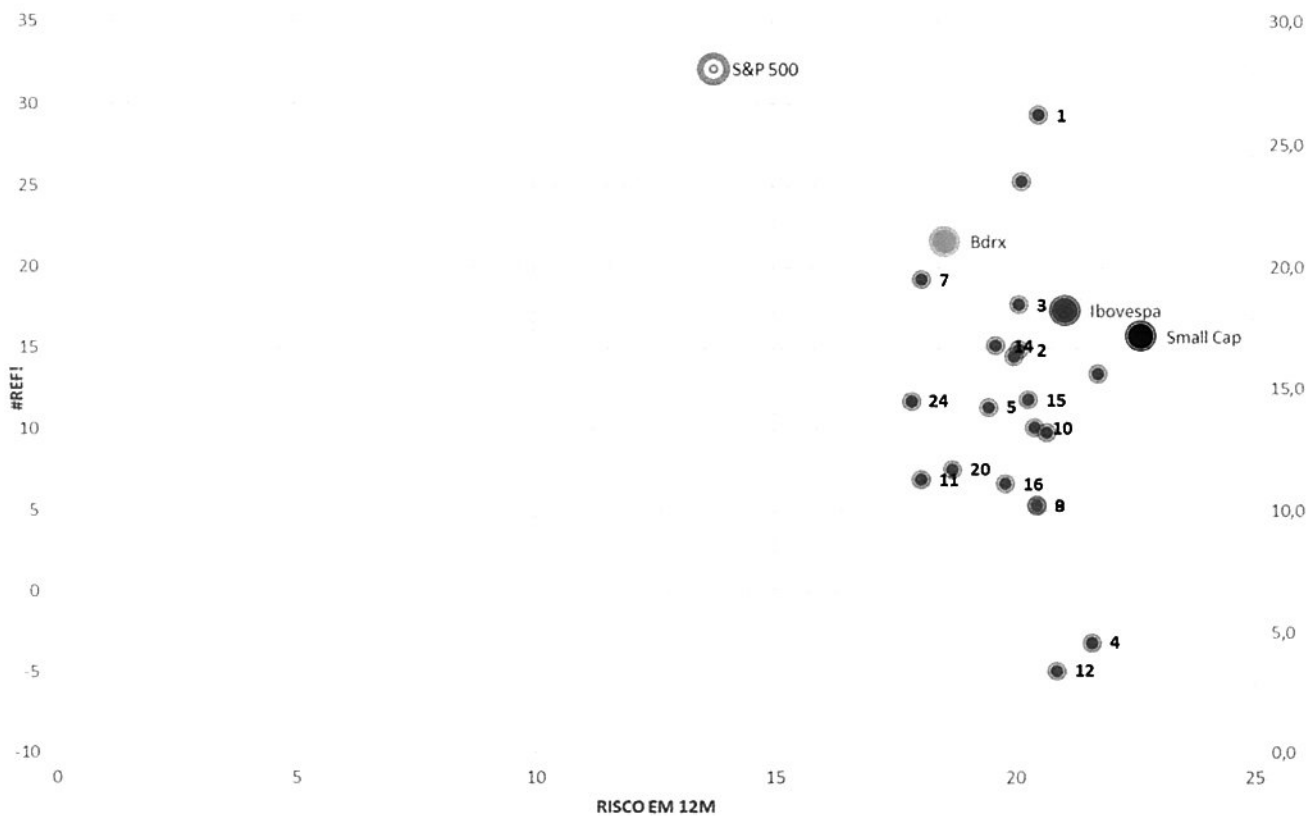


Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

*[Handwritten signatures and initials]*

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso II, "a"	BB Ações Valor FICFIA	29,38	20,52	D+030	D+032
2	art. 8º, inciso I, "a"	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	14,94	20,11	D+000	D+002
3	art. 8º, inciso II, "a"	Bradesco FIA Mid Small Caps	17,72	20,10	D+001	D+003
4	art. 8º, inciso II, "a"	Caixa FIA Consumo	-3,11	21,61	D+001	D+003
5	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	11,40	19,48	D+002	D+002
6	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	13,48	21,76	D+021	D+023
7	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Acoes Dunamis Fc	19,26	18,08	D+021	D+023
8	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	5,40	20,46	D+027	D+029
9	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	5,36	20,46	D+001	D+003
10	art. 8º, inciso II, "a"	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	10,14	20,43	D+001	D+003
11	art. 8º, inciso II, "a"	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	6,94	18,05	D+001	D+003
12	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	-4,83	20,87	D+001	D+032
14	art. 8º, inciso II, "a"	Az QuestSmall Mid Caps Inst Fc de FIA	15,17	19,62	D+027	D+029
15	art. 8º, inciso II, "a"	Occam Fc de FIA	11,87	20,30	D+001	D+003
16	art. 8º, inciso II, "a"	Sul America Equities FIA	6,68	19,81	D+001	D+003
20	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	7,56	18,71	D+001	D+003
24	art. 8º, inciso II, "a"	Vinci Selection Equities FIA	11,77	17,85	D+060	D+062
25	art. 8º, inciso II, "a"	Brasil Capital Master 30 II FIA	14,54	19,99	D+000	D+002
26	-	BNP Paribas Master Acoes FI			D+000	D+003
29	art. 8º, inciso II, "a"	Daycoval Ibovespa Ativo FIA	9,84	20,67	D+012	D+014
30	art. 8º, inciso II, "a"	Caixa FIC FIA Acoes Livre Quantitativo	25,32	20,18	D+013	D+015
31	art. 8º, inciso II, "a"	ARX Income Inst Fc FIA		18,61	D+001	D+003

Quadro 3. Legenda Gráfico 2.

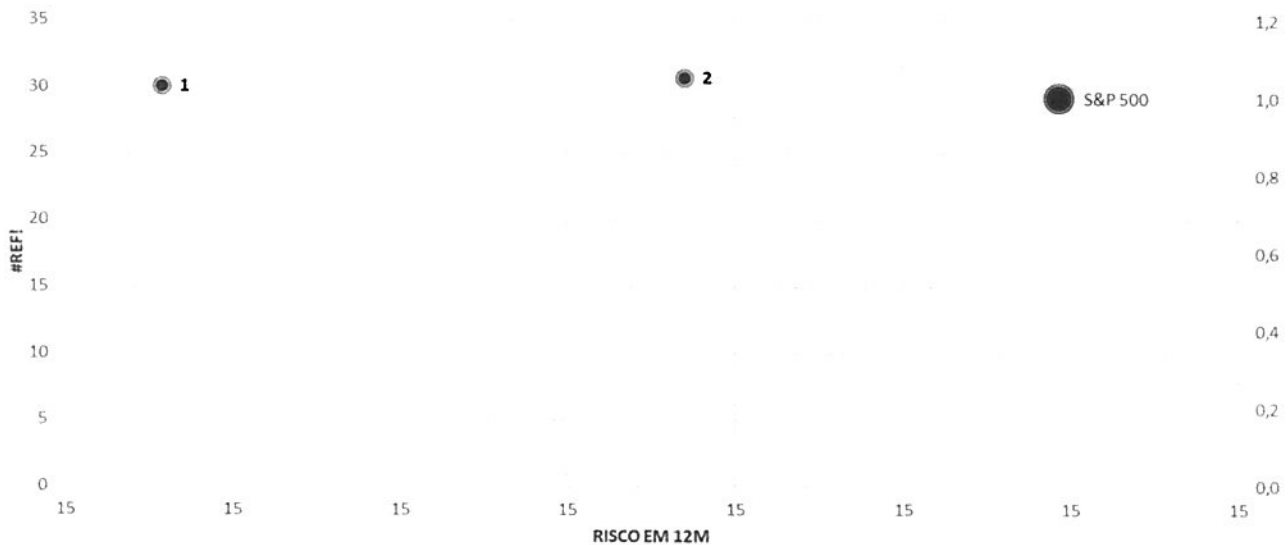


Gráfico 3: Art. 8-III,º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso III	Safrá SP Reais Pb FI Mult	30,12	14,73	D+001	D+002
2	art. 8º, inciso III	Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	30,77	14,89	D+000	D+001

Quadro 4. Legenda Gráfico 3.

Handwritten signatures and initials, including 'V', 'B', and a large signature.

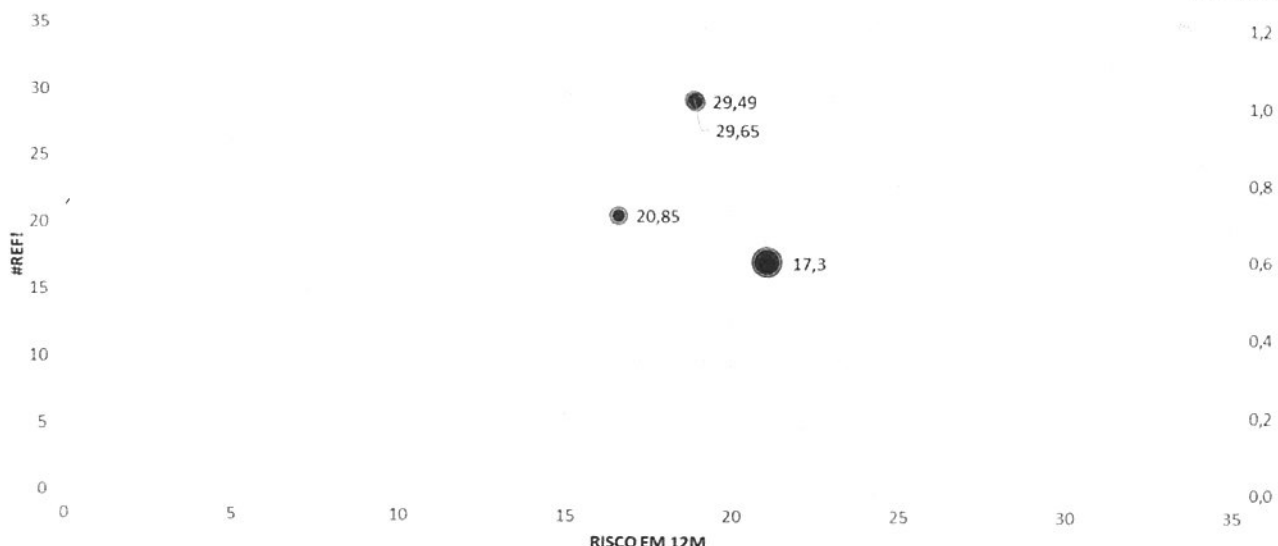


Gráfico 4: Art. 9º-A-II Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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	29,49	18,90	D+001	D+005
2	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	20,85	16,61	D+001	D+008
3	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	29,65	18,86	D+001	D+004
4	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	32,32	18,83	D+001	D+006
5	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	17,3	18,83	D+001	D+006

Quadro 5. Legenda Gráfico 4.

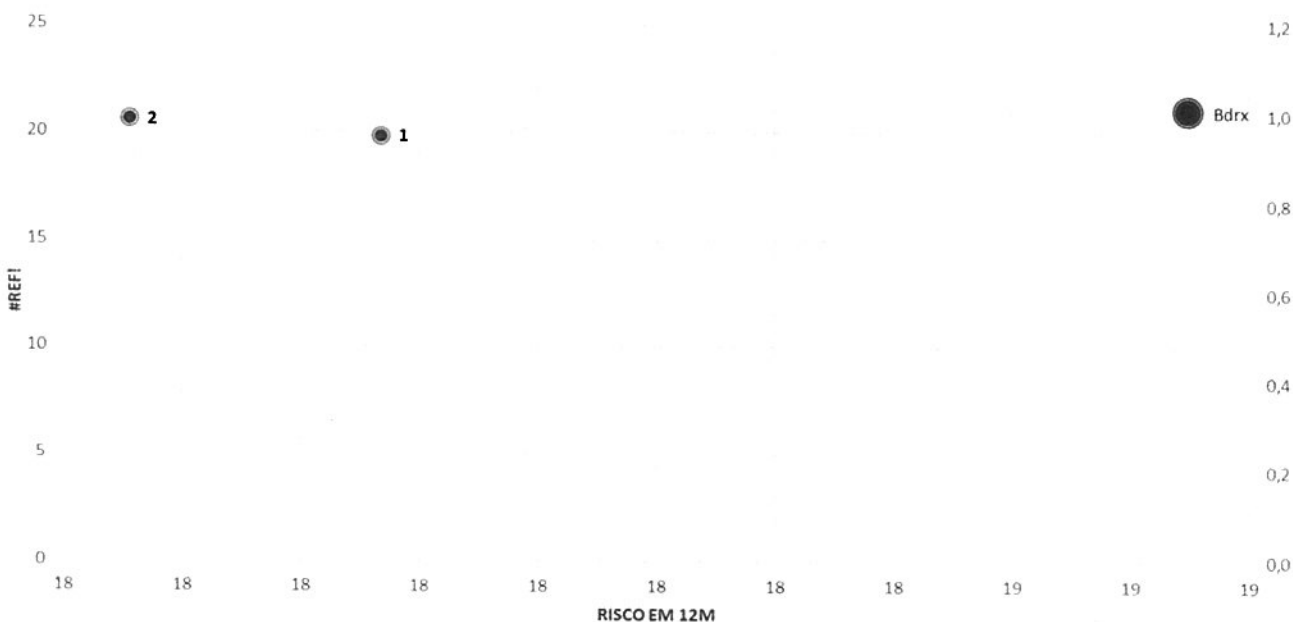


Gráfico 5: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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	19,87	18,23	D+001	D+004
2	art 9º - A - III - BDR Nível I	Safrá Consumo Americano FIA Bdr Nível I	20,62	18,13	D+001	D+004

Quadro 6. Legenda Gráfico 5.

Handwritten signatures and initials: J, B, and a large signature.

## 2. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

DATA BASE EM 30.09.21

TABELA - DURATION &amp; YIELD POR CLASSE

Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,57	1,69%	56,4%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,60	1,62%	15,0%
CDB	1,08	0,70%	0,0%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	0,74	2,46%	0,9%
BOND	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,65	-	16,9%
Over	0,00	-	10,8%
Carteira Crédito	3,33	1,68%	72,3%
Crédito - Contribuição Fundo	1,21	1,22%	72,3%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	3,43	1,22%	100,0%

Quadro 03

TABELA - RATING EXTERNO\*

Rating	Financeiro	% PL
AAA	220.632.249	20,6%
AA+	40.780.903	3,8%
AA	138.743.763	12,9%
AA-	104.201.319	9,7%
A+	69.948.635	6,5%
DPGE	0	0,0%
A	7.860.738	0,7%
A-	16.767.015	1,6%
BBB+	0	0,0%
BBB	0	0,0%
BBB-	7.432.198	0,7%
BB+	0	0,0%
BB	0	0,0%
BB-	0	0,0%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	0	0,0%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Rating	169.764.247	15,8%
Tesouro / Over	297.141.619	27,7%
Total	1.073.272.687	100,0%

\* Rating Externo é o menor rating atribuído entre o S&amp;P, Moody's e Fitch.

Quadro 04.

TABELA - SETOR		
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	177.119.127	16,5%
Bancos	160.646.634	15,0%
Serviço	128.985.328	12,0%
Saneamento	83.204.673	7,8%
Conc. Rodoviárias	80.796.204	7,5%
Varejo	44.588.740	4,2%
Logística	22.092.041	2,1%
Shopping Center	21.745.155	2,0%
Infraestrutura	20.993.941	2,0%
Indústria e Comércio	14.854.093	1,4%
Holding	10.121.342	0,9%
Óleo e Gás	8.384.344	0,8%
Mineração e Siderurgia	2.599.446	0,2%
Tesouro / Over	297.141.619	27,7%
<b>Total</b>	<b>1.073.272.687</b>	<b>100,0%</b>

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLACÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 30/09/2021)


## PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 15 de outubro de 2021, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de setembro/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 Outubro de 2021.

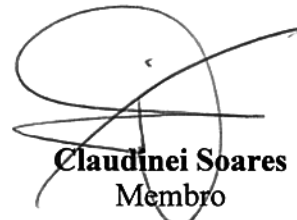
  
**Alan Nascimento**  
Coordenador

  
**Bruno Costa Novo**  
Secretário

  
**Bruno Barroso**  
Membro

  
**Leonardo Cavalcanti**  
Membro

  
**Andreza de Souza Silva**  
Membro

  
**Claudinei Soares**  
Membro

  
**André Luiz Bentes**  
Membro

**Marcos Souza**  
Membro