

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 18/11/2021

RELATÓRIO Nº. 26 / 2021 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **Outubro/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

O Banco Central elevou a taxa básica de juros novamente em 100 pb. Em decisão unânime, a autoridade monetária elevou a taxa Selic de 6,25 para 7,75%, confirmando as expectativas do mercado, confirmando as expectativas do mercado. O Copom indicou que, diante da deterioração do balanço de riscos e elevação das projeções de inflação, o ritmo de 150 pb de ajuste é o mais adequado para garantir a convergência da inflação para a meta no horizonte relevante, que contempla 2022 e 2023. De acordo com o comunicado, parte da piora recente do balanço de riscos se deve a recentes questionamentos em relação ao arcabouço fiscal, os quais elevaram o risco de desancoragem das expectativas de inflação.

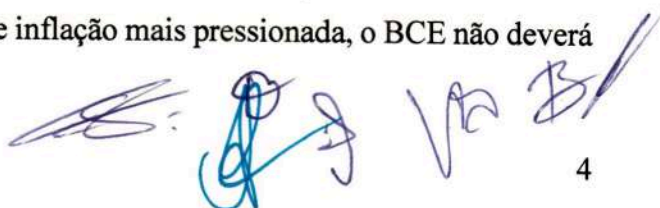
O Copom indicou ser apropriado que a taxa de juros avance ainda mais no território contracionista. Na avaliação sobre o cenário, o comitê pontuou que indicadores recentes mostram evolução da atividade econômica aquém da esperada. Na conjuntura externa, a avaliação é de que o ambiente tem se tornado menos favorável, pois a inflação mais persistente deve ensejar reação por parte dos bancos centrais, tornando o ambiente mais desafiador para economias emergentes. A pressão inflacionária interna segue elevada, com alta principalmente em componentes voláteis, embora também se observem pressões em itens associados à inflação subjacente. Para a próxima reunião, o Banco Central indicou um aperto monetário de mesma magnitude. Mantendo a linha dos comunicados anteriores, o comitê enfatizou que os próximos passos poderão ser ajustados em função da evolução da atividade econômica, do balanço de riscos e das projeções de inflação para o horizonte relevante. Esperamos que o Banco Central eleve a taxa de juros novamente em 150 pb na reunião de dezembro, encerrando o ano com a taxa Selic em 9,25% ao ano. O atual ciclo de aperto monetário deverá ser finalizado em março do próximo ano, com a taxa básica de juros em 10,50%. Em outubro, a prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) variou 1,20%, apresentando aceleração em relação ao avanço de 1,14% no IPCA-15 de setembro. A inflação acumulada em 12 meses apresentou nova aceleração, de 10,08% no fechado de setembro para 10,34% em outubro. A maior surpresa se concentrou no item passagens aéreas, que fez com o núcleo de serviços acelerasse de 0,63% para 1,03%. No entanto, mesmo quando descontamos esse item volátil, a medida de serviços subjacentes também teve aceleração relevante (0,37% para 0,66%), com inflação disseminada entre itens ligados à reabertura econômica, como no caso de alimentação fora do domicílio (0,97%). No sentido oposto, a inflação de bens industriais teve desaceleração (0,98%, ante 1,05%), puxada por bens duráveis e produtos de higiene pessoal, os quais foram parcialmente compensados pela expressiva aceleração de itens de vestuário. Com relação aos núcleos, que são métricas que excluem ou suavizam itens com inflação volátil, a leitura de outubro corroborou essa piora do quadro inflacionário. A média da variação dos núcleos acelerou de 0,68% para 0,82%, alcançando 6,7% em 12 meses. Projeta-se que o IPCA encerre o ano com variação de 9,5%.

[Handwritten signatures and initials]

Nos EUA, o Fed divulgou a ata da reunião de outubro, na qual os membros reafirmaram a intenção de iniciar em breve o processo de redução dos estímulos. Em linhas gerais, o comitê defende que, diante da evolução da economia, o início da redução da compra de ativos no mercado americano poderá ter início já em meados de novembro. A redução seria composta pela diminuição mensal de US\$ 10 bilhões nas compras de títulos públicos (atualmente em US\$ 80 bilhões ao mês) e US\$ 5 bilhões em títulos do mercado imobiliário (atualmente em US\$ 40 bilhões ao mês). O programa de compras seria finalizado em meados do próximo ano. A necessidade de aumento de juros em 2022, no entanto, não é defendida de maneira majoritária pelo comitê. Sobre o cenário econômico, os membros seguem com a avaliação de que a aceleração recente da inflação reflete um movimento temporário, ainda que reconheçam o prolongamento acima do esperado dos choques. Na atividade, a avaliação é de continuidade da expansão, ainda que com alguma perda de força na margem em decorrência dos efeitos da variante Delta. Ainda nos EUA, o PIB do 3º trimestre avançou abaixo do esperado na margem. No 3º trimestre, o crescimento anualizado de 2% veio abaixo da expectativa de mercado (2,6%). A desaceleração em relação ao 2º trimestre (6,7%) foi reflexo sobretudo do consumo das famílias (1,6%, ante 12%), que contou com contribuição positiva de serviços (sobretudo viagens, transporte e saúde) e negativa de bens. Investimentos residenciais se retraíram 1,97% por conta da oferta limitada de material de construção, mas foram compensados pelo crescimento de investimentos não-residenciais. Por fim, a contribuição positiva dos estoques foi inferior ao esperado. No ano, a expectativa para o PIB dos EUA é de crescimento de 5,8%.

Na China, o PIB avançou 4,9% no terceiro trimestre, ante 7,9% no trimestre anterior, abaixo da expectativa do mercado (5,0%). Com relação ao desempenho da atividade em setembro, a produção industrial, na comparação interanual, avançou 3,1%, abaixo do consenso de mercado (3,8%). Já as vendas no varejo tiveram expansão de 4,4%, acima da (3,5%), enquanto os investimentos em ativos fixos (FAI) expandiram 7,3%, ante expectativa de 7,9%. Nossa expectativa é de crescimento de 8,1%, embora as recentes frustrações insiram viés de baixa para a projeção. Esse viés de baixa também se mantém para a projeção de 5% em 2022, decorrente da incerteza que envolve o desempenho do mercado imobiliário.

O Banco Central Europeu (BCE) manteve a política monetária inalterada, com o patamar da taxa de depósito em -0,5%, da taxa de refinanciamento em 0,0% e da taxa de empréstimo em 0,25%. O total do Programa Pandêmico de Compras Emergenciais (PEPP, na sigla em inglês) foi mantido em € 1,85 trilhão em compra de ativos, com horizonte de compras até março de 2022 ou até o BCE considerar encerrado o cenário de crise do coronavírus. Em sua entrevista após a reunião, a presidente do BCE, Christine Lagarde, ressaltou que a inflação mais alta é fenômeno temporário, devendo avançar ainda mais no curto prazo, mas desacelerar no próximo ano. Nesse contexto de inflação mais pressionada, o BCE não deverá

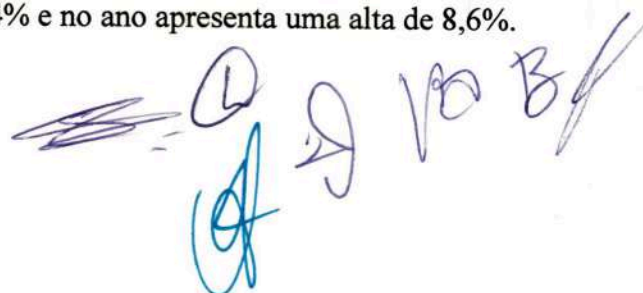


renovar o PEPP após março do próximo ano. Ainda assim, com a projeção de inflação no horizonte mais longo (2023) distante da meta (1,5% ante 2%), o BCE deverá manter a política monetária acomodatória por um período prolongado.

Perspectivas Renda Fixa

No mês de outubro, os investidores se atentaram ao cenário inflacionário mais robusto pelo mundo, que segue pressionado devido à uma alta nos preços de energia, principalmente derivados de petróleo. Além disso, o descasamento entre oferta e demanda continua sem uma solução, o que mantém os estoques da indústria muito baixos, facilitando um repasse de preços. Com isso, os Bancos Centrais seguem aumentando a relevância desse cenário em suas projeções e iniciam ajustes em suas políticas monetárias. Nesse sentido, o Banco Central americano, que iniciará a redução das compras de ativos no próximo mês, vê os investidores intensificarem as apostas em um aumento de juros para o final do próximo ano. Por fim, a desaceleração de China segue no radar, sendo esse o principal catalizador de uma queda da atividade mundial, devido a sua reestruturação que castiga com maior vigor o setor imobiliário.

No Brasil, passamos por mais um mês turbulento. A discussão no entorno da mudança da regra do Teto de Gastos, aumentou a incerteza dos investidores devido à falta de previsibilidade sobre a condução das políticas econômicas e fiscal. Essa mudança tinha o intuito de abarcar um novo Bolsa Família ou uma extensão do auxílio emergencial, e a chamada PEC dos precatórios seria o caminho para isso. Entretanto, a pressão para um aumento substancial nesse ajuste, levou o governo a rever a regra de correção do Teto. Essas mudanças, até o momento, não colocam as contas do governo em trajetória insustentável, porém geram turbulência e pressionam adicionalmente a inflação. Nesse sentido, o Banco Central seguiu realizando ajustes na taxa de juros, elevando em 150 pontos e direcionando o mercado para mais 150 na próxima reunião. O nível de Selic terminal foi elevado para 9,75% para o primeiro trimestre de 2022, segundo o cenário da Bram. O mercado de renda fixa experimentou níveis de juros que não estávamos mais acostumados a ver. A alta foi generalizada, tanto para ativos atrelados à inflação quando para prefixados. O movimento foi mais acentuado na porção mais curta de juros, provocando um fenômeno na curva chamado de achatamento, que faz com que as taxas de longo prazo sejam semelhantes às de curto. Por outro lado, as LFTs, ativos posfixados em Selic, seguem com resultados superiores no mês e no ano, com 118% e 106,75% do CDI. O Real, apesar da alta do Dólar, teve um desempenho relativo menos intenso do que o esperado para ambientes como este, além de contar com um cenário global mais incerto. O Dólar fechou o mês a 5,643, com uma alta de 3,74% e no ano apresenta uma alta de 8,6%.



RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Perspectivas Renda Variável

Outubro foi um mês de antagonismo no comportamento das bolsas. Enquanto as bolsas dos países desenvolvidos recuperaram as perdas ocorridas em setembro, as bolsas dos países em desenvolvimento tiveram performances menores e até negativas, como ocorreu com o Brasil, influenciadas por fatores como 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 +6,91% e o MSCI Emerging Markets +0,93%. Estes índices acumulam retorno no ano de +22,61% e -2,05% respectivamente e em moeda original. No Brasil, além dos fatores globais, as preocupações em torno do risco fiscal aumentaram significativamente provocando nova rodada de revisões pra baixo na expectativa de crescimento do PIB para 2022 e alta atípica das taxas de juros futuras, combinação que impacta negativamente a precificação das ações. O Ibovespa teve retorno de -6,74% no mês, levando-o para retorno negativo de -13,04% no ano. O fluxo do investidor estrangeiro foi positivo em outubro, atingindo assim um patamar bastante positivo no ano. A gestão está com visão cautelosa para renda variável no curto prazo, motivada pelo aumento das incertezas locais e globais. O excelente comportamento das empresas listadas e o crescimento cíclico do PIB proporcionado pelo mundo pós Covid são os fatores positivos. Risco político, inflação, risco fiscal e risco hídrico permanecem como pontos de atenção. O balanço de forças entre a expectativa de novos pacotes de estímulo fiscal nos EUA e o ambiente local mais incerto justificam, para a gestão, 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 pela frente. Sobre a performance setorial, o mês foi menos negativo para setores considerados como domésticos defensivos como Alimentos & Agronegócio e Bebidas, que teoricamente sofrem menos impactos em cenário de crescimento do PIB menor que o anteriormente previsto. Na ponta contrária, os

[Handwritten signatures and initials]

Relatório de Investimentos – Outubro/2021


AMAZONPREV
Folha nº 007
Diego

setores sensíveis a taxas de juros e ao crescimento local foram os destaques negativos como Construção Civil, Varejo, Saúde e Consumo.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	OUTUBRO	2021	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	6,91%	22,61%	40,84%	51,61%	69,83%
MSCI WORLD USD	5,59%	18,02%	38,46%	42,14%	57,01%
SMLL CAPS	-12,53%	-17,73%	3,62%	-2,77%	38,93%
IBRX100	-6,81%	-12,40%	10,40%	-1,79%	22,56%
IDIV	-4,23%	-8,71%	13,78%	1,74%	41,65%
IBOVESPA	-6,74%	-13,04%	10,16%	-3,47%	18,39%

Fonte: Carta do Gestor novembro/2021 – BRAM.



Relatório de Investimentos – Outubro/2021

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1 SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 318.043.340,87	R\$ 312.870.899,14	(0,4488)	(0,0053)	(1,6263)	-2,0730%	-2,9828%	0,1673%	
BB PREVID TP VII	R\$ 6.993.034,60	R\$ 6.958.332,45	0,4531	1,2968	(0,4962)	1,2509%	4,1426%	6,6309%	
BB PREVID IDKA 2	R\$ 295.145.278,23	R\$ 291.447.818,79	0,1784	1,0334	(1,2527)	-0,0543%	1,4475%	NC	
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 21.505.898,10	R\$ 31.207.930,25	0,4900	0,4900	0,5800	1,5681%	3,4400%	3,7000%	
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 1.550.506,80	R\$ 1.042.533,44	0,4174	0,4400	0,4800	1,3434%	1,9636%	2,7608%	
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 52.473.526,45	R\$ 51.689.742,67	(0,0400)	0,9600	(1,4900)	-0,5841%	-0,6000%	3,4900%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 482.857.113,53	R\$ 476.850.170,86	0,1338	0,9800	(1,2440)	-0,1428%	1,0251%	4,1883%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 369.381.009,30	R\$ 366.938.551,71	(1,4496)	0,3550	(0,6612)	-1,7537%	-1,8165%	0,2959%	
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 28.649.299,15	R\$ 27.951.898,20	(0,1700)	0,6800	(2,4300)	-1,9335%	0,6800%	0,5100%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 91.564.244,38	R\$ 90.429.620,94	0,0900	0,9600	(1,2400)	-0,2022%	0,9600%	0,8300%	
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 112.362.158,91	R\$ 108.016.291,75	(2,3100)	(1,3400)	(3,8700)	-7,3490%	-10,5800%	-1,4100%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 21.564,92	R\$ 21.488,30	0,3100	0,8400	(0,3600)	0,7885%	1,9600%	2,2700%	
SANTANDER CP CRESCIMENT INST	R\$ 90.183.517,50	R\$ 90.794.427,45	-	0,2039	0,6774	0,8827%	0,8827%	NC	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 18.025.419,54	R\$ 18.135.389,47	-	0,5500	0,6100	1,1634%	4,6800%	NC	
ITAU HIGH GRADE RF DP FIC FI	R\$ 45.058.394,80	R\$ 45.342.289,80	-	0,5900	0,6300	1,2237%	3,6400%	NC	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 103.338.362,43	R\$ 119.449.312,72	(1,5600)	0,6000	(3,2300)	-4,1680%	-7,7500%	-0,5100%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 2.037.152.669,51	R\$ 2.039.146.697,94							

Quadro 1.

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 104.442.560,46	R\$ 98.654.658,58	(1,8102)	(2,5216)	(5,5414)	-9,5900%	-7,6913%	19,5523%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 173.881.403,64	R\$ 152.083.088,08	(2,7600)	(3,9100)	(12,5400)	-18,2792%	-10,3800%	5,5600%	
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 282.856.309,85	R\$ 245.916.427,77	(6,8215)	(8,8411)	(13,0596)	-26,1524%	-26,3739%	-15,7950%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 9.007.806,04	R\$ 8.242.696,55	(3,4003)	(3,8409)	(8,4938)	-15,0005%	-15,9585%	NC	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.959.879,36	R\$ 13.919.665,54	9,2000	(8,3000)	(0,2881)	-0,1521%	14,3721%	12,7894%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$ 12.132.719,27	R\$ 11.401.729,95	-	(3,7457)	(6,0249)	-9,5449%	0,3647%	NC	
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 83.564.995,14	R\$ 77.745.949,22	(2,9500)	(6,6100)	(6,9600)	-15,6732%	-17,2000%	1,5259%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 171.298.883,15	R\$ 158.388.978,17	(2,2100)	(6,5200)	(7,5400)	-15,4785%	-8,0600%	9,7300%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 37.461.260,03	R\$ 34.170.667,43	(3,1300)	(6,6000)	(8,7800)	-17,4673%	-16,4500%	2,9800%	
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 115.776.507,97	R\$ 103.040.621,54	(3,9400)	(4,5800)	(11,0000)	-18,4222%	-11,0500%	9,9500%	
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 97.024.765,03	R\$ 104.428.962,65	3,3600	(4,5100)	7,6300	6,2292%	12,3266%	NC	
SANTANDER CRESC SENIOR (TOP AÇÕES)	R\$ 13.758,89	R\$ 12.585,69	(2,0993)	(7,9602)	(8,5268)	-17,5757%	-18,9239%	-1,7306%	
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 25.371.834,09	R\$ 27.286.372,18	3,3200	(4,5700)	7,5500	6,0424%	25,9600%	43,5600%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.408.633,10	R\$ 77.749.002,16	(5,0700)	(4,2100)	(6,7900)	-15,2409%	-1,5400%	15,1700%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 84.410.723,24	R\$ 80.726.208,91	(2,4400)	(6,9300)	(4,9000)	-13,6501%	-13,3800%	6,7200%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 30.622.087,81	R\$ 27.079.702,67	(3,8217)	(7,3102)	(11,5680)	-21,1651%	-19,5446%	-2,1465%	
BRASIL CAPITAL RP INSTIT FIC AÇÕES	R\$ 48.062.911,33	R\$ 41.695.707,73	(2,0700)	(6,5300)	(13,2500)	-20,5932%	-21,4000%	NC	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.779.997,05	R\$ 8.056.412,45	(3,9220)	(6,1345)	(8,2413)	-17,2482%	-19,9407%	NC	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.405.722,59	R\$ 9.357.215,73	(0,2726)	(0,8900)	(0,5157)	-1,6699%	-1,6699%	NC	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 18.894.402,47	R\$ 17.128.365,89	(3,9729)	(8,3928)	(9,3469)	-20,2545%	-20,2545%	NC	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 102.856.598,74	R\$ 94.240.457,25	(2,2000)	(6,9700)	(8,3800)	-16,6411%	-20,4108%	NC	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 40.258.951,70	R\$ 37.510.403,40	-	(3,6000)	(6,8300)	-10,1841%	-3,6000%	NC	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 37.523.282,76	R\$ 34.475.505,29	-	(5,2800)	(8,1200)	-12,9713%	-8,4583%	NC	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.591.015.993,71	R\$ 1.463.311.384,83							

Quadro 2.

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

Relatório de Investimentos – Outubro/2021

AMAZONPREV
Folha nº 1009
Djege

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS			VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 23.588.064,66	R\$ 25.182.870,35	0,9099	2,1897	6,7610	10,0914%	28,2851%	40,8590%	
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 144.647.674,99	R\$ 156.015.767,96	1,3098	1,3304	7,8592	10,7256%	24,7608%	30,8169%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 30.186.927,02	R\$ 32.469.444,97	2,0200	1,4600	7,5613	11,3361%	29,4200%	NC	
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 149.419.559,27	R\$ 165.334.100,53	3,0908	0,7100	10,6509	14,8808%	31,3081%	34,9820%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 145.139.361,06	R\$ 157.505.056,03	2,2400	(0,8100)	8,5200	10,0521%	29,1800%	32,7900%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 37.093.575,08	R\$ 39.805.451,96	0,4991	2,6015	7,3109	10,6522%	17,3968%	NC	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 35.600.844,92	R\$ 39.480.371,99	2,4250	(1,3478)	10,8973	12,0556%	14,0480%	NC	
TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	R\$ 565.676.007,00	R\$ 615.793.063,79							
TOTAL GERAL	R\$ 4.193.844.670,22	R\$ 4.118.251.146,56							

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), porém, conforme observado pelo Comitê de Investimentos, foi decidido direcionar parte dos recursos para o fundo Bradesco DI Premium, em substituição ao fundo do Icatu Vanguarda, devido aos limites do PL do fundo.

2.4 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	ago/21	set/21	out/21
BRANDESCO	R\$ 183.233.651,63	R\$ 196.937.808,54	R\$ 184.333.551,77
BANCO DO BRASIL	R\$ 897.006.317,01	R\$ 897.631.838,09	R\$ 900.448.679,84
CAIXA	R\$ 1.055.109.497,91	R\$ 916.844.368,55	R\$ 906.880.195,19
ITAU	R\$ 446.423.665,97	R\$ 466.641.375,90	R\$ 445.393.007,89
SANTANDER	R\$ 142.763.613,70	R\$ 234.844.951,38	R\$ 246.822.781,10
ICATU	R\$ 373.978.689,31	R\$ 316.140.697,58	R\$ 304.143.760,11
SAFRA	R\$ 255.488.641,34	R\$ 273.849.557,58	R\$ 304.240.740,93
BTG PACTUAL	R\$ 342.740.611,07	R\$ 315.229.717,84	R\$ 277.436.005,59
AZ QUEST	R\$ 87.074.310,93	R\$ 83.408.633,10	R\$ 77.749.002,16
OCCAM BRASIL	R\$ 129.251.558,11	R\$ 84.410.723,24	R\$ 80.726.208,91
SCHRODER	R\$ 29.753.755,74	R\$ 30.186.927,02	R\$ 32.469.444,97
SULAMÉRICA	R\$ 33.037.251,68	R\$ 30.622.087,81	R\$ 27.079.702,67
PLURAL INVEST	R\$ 72.250.782,46	R\$ 72.694.420,00	R\$ 79.285.823,95
BRASIL CAPITAL	R\$ 51.420.807,48	R\$ 48.062.911,33	R\$ 41.695.707,73
BNP PARIBAS	R\$ 9.353.806,68	R\$ 8.779.997,05	R\$ 8.056.412,45
DAYCOVAL	R\$ 20.625.459,21	R\$ 18.894.402,47	R\$ 17.128.365,89
ARX	R\$ -	R\$ 40.258.951,70	R\$ 37.510.403,40
MONGERAL	R\$ -	R\$ 18.025.419,54	R\$ 18.135.389,47
VINCI PARTNERS	R\$ 110.567.540,40	R\$ 140.379.881,50	R\$ 128.715.962,54
TOTAL	R\$ 4.240.079.960,63	R\$ 4.193.844.670,22	R\$ 4.118.251.146,56

Quadro 4.

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC OUTUBRO/2021

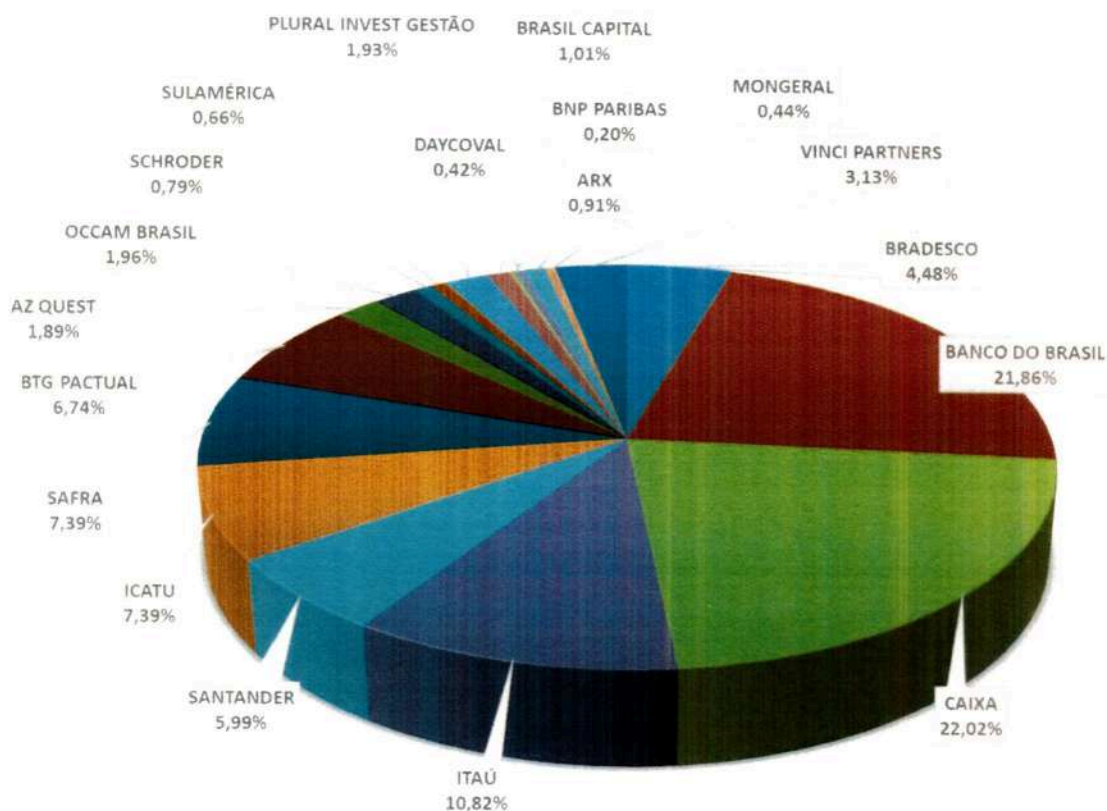


Gráfico 1.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)						
	30/09/2021	29/10/2021	jul/21	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 167.742.200,99	R\$ 173.616.446,69	1,4896	1,3992	1,6907	1,7812	4,950%	14,0491%	17,8443%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 175.135.812,05	R\$ 181.302.953,06	1,4991	1,4087	1,7002	1,7907	4,980%	14,1560%	17,9768%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 184.790.059,75	R\$ 191.386.841,83	1,5229	1,4324	1,7240	1,8145	5,053%	14,4239%	18,3091%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 181.884.494,17	R\$ 188.289.338,62	1,4992	1,4087	1,7002	1,7907	4,980%	14,1562%	17,9771%
TOTAL GERAL	R\$ 709.552.566,96	R\$ 734.595.580,20							

Quadro 5.

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

[Assinaturas manuscritas em azul]

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa		Renda Fixa	
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	BRASESCO	BRASESCO	BRASESCO	BRASESCO
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\$ 173.616.446,69	R\$ 181.302.953,06	R\$ 191.386.841,83	R\$ 188.289.338,62
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

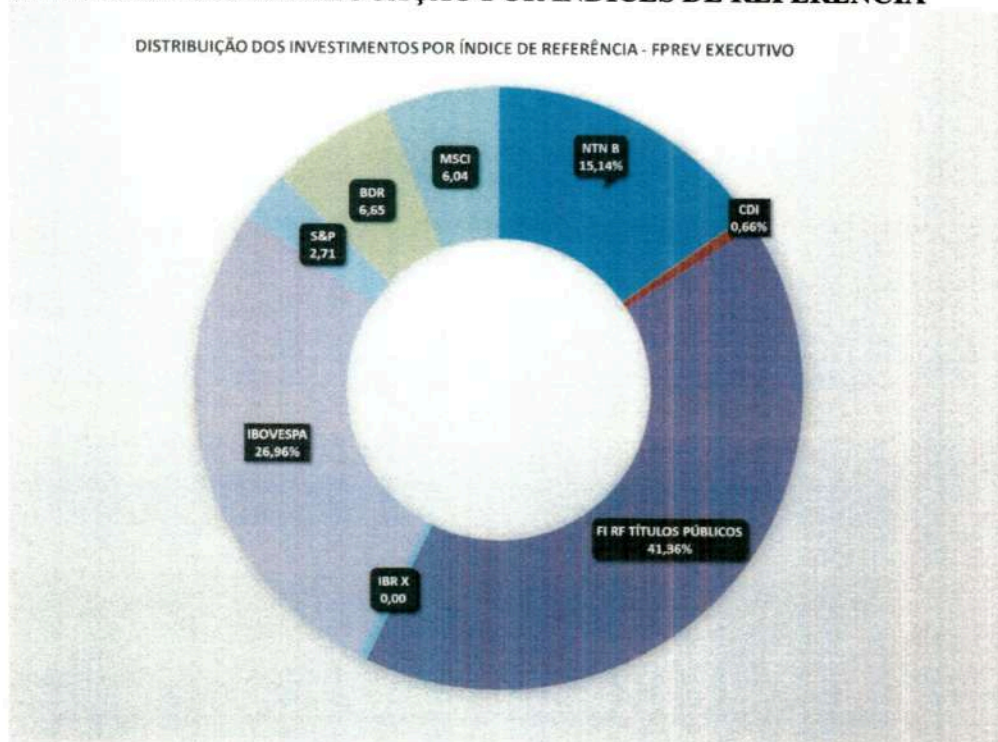


Gráfico 2.

2.8 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	30/09/2021	29/10/2021
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
TOTAL	R\$ 9.288.117,84	R\$ 9.143.033,12

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.

[Assinatura]

Relatório de Investimentos – Outubro/2021

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
out/21	R\$ 26.887,32	R\$ 145.084,32	R\$ 171.971,64
TOTAL	R\$ 283.983,22	R\$ 1.450.846,40	R\$ 1.734.829,62

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\$ -
TOTAL	R\$ 130.907,16	R\$ 602.186,40	R\$ 733.093,56

Quadro 9.

2.11 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	30/09/2021	29/10/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.193.844.670,22	R\$ 4.117.801.389,32	83,5459%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 721.644.547,26	R\$ 734.595.580,20	14,9042%
TÍTULOS CVS	R\$ 9.143.033,12	R\$ 9.143.033,12	0,1855%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 61.835.325,18	1,2546%
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -	R\$ -	0,0000%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 5.413.894,22	0,1098%
TOTAL	R\$ 4.986.467.576,78	R\$ 4.928.789.222,04	100,00%

Quadro 10.

Luigi

[Handwritten signature]

2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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%
out/21	R\$ 4.928.789.222,04	-1,16%	2,51%	8,34%

Quadro 11.

2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1. Investimentos - Executivo

Saldo dos Investimentos em 10/2020		R\$ 4.550.382.196,07		
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)	
11/2020	R\$ 39.697.646,11	R\$ 116.368.518,74	RS -76.670.872,63	
12/2020	R\$ 117.527.713,10	R\$ 175.934.562,52	RS -58.406.849,42	
01/2021	R\$ 584.279,15	R\$ 82.104.432,44	RS -81.520.153,29	
02/2021	R\$ 40.864.605,59	R\$ 44.974.382,51	RS -4.109.776,92	
03/2021	R\$ 41.485.170,47	R\$ 10.665.619,53	RS 30.819.550,94	
04/2021	R\$ 41.308.639,76	R\$ 10.074.221,86	RS 31.234.417,90	
05/2021	R\$ 41.318.216,48	R\$ 14.353.928,89	RS 26.964.287,59	
06/2021	R\$ 50.044.250,01	R\$ 10.611.950,64	RS 39.432.299,37	
07/2021	R\$ 47.181.791,70	R\$ 9.896.860,10	RS 37.284.931,60	
08/2021	R\$ 26.480.105,00	R\$ 11.394.062,81	RS 15.086.042,19	
09/2021	R\$ 41.572.477,52	R\$ 10.674.589,38	RS 30.897.888,14	
10/2021	R\$ 43.880.558,88	R\$ 10.627.718,85	RS 33.252.840,03	
Saldo dos Investimentos em 10/2021		R\$ 4.928.789.222,15		

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	10,6727%	8,2352%	1,2500%
Juros	5,4500%	4,5215%	0,4432%
Meta	16,7043%	13,1290%	1,6987%
Rentabilidade em %	7,9771%	-0,8001%	-1,8236%
Rentabilidade em RS	R\$ 354.142.420,58	R\$ -38.553.114,51	R\$ -90.931.194,66
Resultado em %	-7,4781%	-12,3126%	-3,4635%
Resultado em RS	R\$ -387.374.589,57	R\$ -670.852.853,84	R\$ -175.638.411,01

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.

(Handwritten signatures and initials)

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					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.126.742,57	R\$ 5.092.842,96	(1,4496)	0,3550	(0,6612)	-1,7537%	-1,8165%	0,2959%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 89.167,60	R\$ 88.850,79	0,3100	0,8400	(0,3600)	0,7885%	1,9600%	2,2700%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 2.000.703,31	R\$ 1.952.000,81	(0,1700)	0,6800	(2,4300)	-1,9335%	0,5100%	4,3000%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO LONGA FI RF I P	R\$ 75.480,30	R\$ 72.560,93	-	(1,3400)	(3,8700)	-5,1581%	-5,1581%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 75.741,27	R\$ 73.296,77	-	(0,6000)	(3,2300)	-3,8106%	-3,8106%	NC
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 358.071,45	R\$ 353.585,67	0,1784	1,0334	(1,2527)	-0,0543%	1,4475%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 7.725.906,50	R\$ 7.633.137,93						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 481.068,70	R\$ 447.569,49	(2,9500)	(6,6100)	(6,9600)	-15,6732%	-17,2000%	1,5400%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.362.647,53	R\$ 1.184.691,32	(6,8215)	(8,8411)	(13,0596)	-26,1524%	-26,3739%	-15,7950%
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 484.035,22	R\$ 454.872,38	-	(3,7457)	(6,0249)	-9,5449%	0,3647%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$ 1.951.992,00	R\$ 1.856.381,63	(2,4400)	(6,9300)	(4,9000)	-13,6501%	-13,3800%	6,7200%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 128.403,91	R\$ 111.393,42	(2,0700)	(6,5300)	(13,2500)	-20,5932%	-21,4000%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 384.786,16	R\$ 583.059,50	3,3200	(4,5700)	7,5500	6,0424%	25,9600%	NC
ITAÚ MM SP500 BRL FIC	R\$ 150.881,04	R\$ 162.395,14	3,3600	(4,6100)	7,6300	6,1179%	26,4100%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.943.814,56	R\$ 4.800.362,88						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.510.446,93	R\$ 1.639.135,15	2,2400	(0,8100)	8,5200	10,0521%	29,1800%	32,7900%
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.510.446,93	R\$ 1.639.135,15						

TOTAL GERAL	R\$ 14.180.167,99	R\$ 14.072.635,96						
--------------------	--------------------------	--------------------------	--	--	--	--	--	--

Quadro 13.

Nota: Com base na Ata COMIV nº. 179/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o fundo SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO (21.595.829/0001-54)

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.439.066,29	R\$ 2.439.066,29	1,4324	1,7240	1,8145	5,0534%	14,3863%	16,5769%
TOTAL GERAL	R\$ 2.439.066,29	R\$ 2.439.066,29						

Quadro 14.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	30/09/2021	29/10/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	R\$ 7.725.906,50	R\$ 7.633.137,93
FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.943.814,56	R\$ 4.800.362,88
FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 1.510.446,93	R\$ 1.639.135,15
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.439.066,29	R\$ 2.483.324,33
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 16.619.234,28	R\$ 16.555.960,29

Quadro 15.

3.4 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação



Gráfico 3.

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1. Investimentos - Assembléia

Saldo dos Investimentos em 10/2020				RS 13.874.434,26
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)	
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	
10/2021	RS 165.653,56	RS 0,00	RS 165.653,56	
Saldo dos Investimentos em 10/2021				RS 16.555.960,29

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	10,6727 %	8,2352 %	1,2500 %
Juros	5,4500 %	4,5215 %	0,4432 %
Meta	16,7043 %	13,1290 %	1,6987 %
Rentabilidade em %	5,1043 %	-1,6401 %	-1,3775 %
Rentabilidade em RS	RS 753.674,76	RS -261.702,02	RS -228.927,55
Resultado em %	-9,9397 %	-13,0551 %	-3,0248 %
Resultado em RS	RS -1.710.034,58	RS -2.354.256,14	RS -511.245,45

Quadro 16.

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

SALDOS E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - MPE FPREV

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.598.264,65	R\$ 7.548.022,66	(1,4496)	0,3550	(0,6612)	-1,7537%	-1,8164%	0,2961%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.004.642,72	R\$ 39.718.389,98	(0,5000)	(0,1500)	(0,7200)	-1,3646%	-2,3545%	0,8476%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 77.922.059,24	R\$ 76.654.787,58	(0,4488)	(0,0053)	(1,6263)	-2,0730%	-2,9828%	0,1675%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 3.229.086,35	R\$ 3.188.633,67	0,1784	1,0334	(1,2527)	-0,0543%	1,8309%	NC
BRANCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 812.143,42	R\$ 1.640.829,89	-	0,4900	0,5800	1,0728%	3,4400%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FIA RF	R\$ 809.947,63	R\$ 1.576.797,28	-	(0,6000)	(3,2300)	-3,8106%	-3,8106%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 130.376.144,01	R\$ 130.327.461,06						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 25.458.498,57	R\$ 23.482.194,05	(3,6600)	(6,6300)	(7,7600)	-17,0277%	-14,5775%	NC
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.515.209,28	R\$ 1.314.479,74	(2,0700)	(6,5300)	(13,2500)	-20,5932%	-20,1846%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 3.624.022,93	R\$ 3.897.488,78	3,3200	(4,5700)	7,5500	6,0424%	8,7783%	NC
BB AÇÕES VALOR	R\$ 21.550.566,69	R\$ 20.356.347,39	(1,8102)	(2,5216)	(5,5414)	-9,5900%	2,9466%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 52.148.297,47	R\$ 49.050.509,96						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 3.297,75
TOTAL RECURSOS	R\$ 182.524.441,48	R\$ 179.381.268,77

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.

Relatório de Investimentos – Outubro/2021

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1. Investimentos - Ministério Público

Saldo dos Investimentos em 10/2020		RS 159.828.952,10	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
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
10/2021	RS 1.646.387,89	RS 23.802,84	RS 1.622.585,05
Saldo dos Investimentos em 10/2021		RS 179.381.268,77	

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	10,6727 %	8,2352 %	1,2500 %
Juros	5,4500 %	4,5215 %	0,4432 %
Meta	16,7043 %	13,1290 %	1,6987 %
Rentabilidade em %	-0,9143 %	-4,4419 %	-2,6110 %
Rentabilidade em RS	RS -1.551.630,85	RS -7.903.511,45	RS -4.765.757,76
Resultado em %	-15,0968 %	-15,5317 %	-4,2378 %
Resultado em RS	RS -29.851.592,66	RS -31.231.993,48	RS -7.866.377,01

Quadro 18.

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 7.754.857,13	R\$ 7.703.579,70	(1,4496)	0,3550	(0,6612)	-1,7537%	1,8165%	0,2959%
BRADERCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.512.488,48	R\$ 8.451.577,46	(0,5000)	(0,1500)	(0,7200)	-1,3646%	-2,3500%	0,8500%
BRADERCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.462.291,22	R\$ 9.340.843,70	0,0800	0,9500	(1,2800)	-0,2624%	0,3900%	3,5000%
BRADERCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 566.941,02	R\$ 1.158.028,54	-	0,4900	0,5800	1,0728%	3,4400%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 565.408,19	R\$ 1.112.854,89	-	(0,6000)	(3,2300)	-3,8106%	-7,7500%	NC
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 2.055.632,53	R\$ 2.029.880,40	0,1784	1,0334	(1,2527)	-0,0543%	1,4475%	NC
TOTAL	R\$ 28.917.618,57	R\$ 29.796.764,69						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 1.018.839,07	R\$ 883.866,89	(2,0700)	(6,5300)	(13,2500)	-20,5932%	-20,1846%	NC
BRADERCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	R\$ 925.560,40	R\$ 853.710,56	(3,6600)	(6,6300)	(7,7600)	-17,0277%	-14,5800%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 2.221.417,55	R\$ 2.389.043,92	3,3200	(4,5700)	7,5500	6,0424%	1,1421%	NC
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 14.906,07	R\$ 14.007,99	-	(3,7457)	(6,0249)	-9,5449%	0,3647%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.180.723,09	R\$ 4.140.629,36						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 6.283,41
TOTAL RECURSOS	R\$ 33.098.341,66	R\$ 33.943.677,46

Quadro 19.

Nota 1: Com base na Ata COMIV nº. 178/2021, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Ratar 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 10/2020			RS 20.832.227,41
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
11/2020	RS 969.890,42	RS 19.728,47	RS 950.161,95
12/2020	RS 2.981.491,21	RS 92.070,31	RS 2.889.420,90
01/2021	RS 6.283,41	RS 77.294,71	RS -71.011,30
02/2021	RS 1.003.038,47	RS 51.465,27	RS 951.573,20
03/2021	RS 992.747,96	RS 51.465,27	RS 941.282,69
04/2021	RS 999.548,81	RS 39.463,54	RS 960.085,27
05/2021	RS 1.057.911,85	RS 96.855,31	RS 961.056,54
06/2021	RS 1.062.228,59	RS 51.465,27	RS 1.010.763,32
07/2021	RS 1.085.187,70	RS 51.462,27	RS 1.033.725,43
08/2021	RS 1.172.401,85	RS 51.465,27	RS 1.120.936,58
09/2021	RS 1.179.063,91	RS 12.001,73	RS 1.167.062,18
10/2021	RS 1.172.130,12	RS 51.465,27	RS 1.120.664,85
Saldo dos Investimentos em 10/2021			RS 33.943.677,46

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	10,6727 %	8,2352 %	1,2500 %
Juros	5,4500 %	4,5215 %	0,4432 %
Meta	16,7043 %	13,1290 %	1,6987 %
Rentabilidade em %	0,2805 %	-2,0147 %	-0,8319 %
Rentabilidade em RS	RS 75.728,44	RS -580.474,99	RS -275.329,05
Resultado em %	-14,0730 %	-13,3862 %	-2,4883 %
Resultado em RS	RS -4.408.343,92	RS -4.348.530,11	RS -837.584,46

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 (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 162.225.484,25	R\$ 161.152.800,65	(1,4496)	0,3550	(0,6612)	-1,7537%	-1,8165%	0,2959%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.089.083,65	R\$ 50.258.205,36	(0,4488)	(0,0053)	(1,6263)	-2,0730%	-2,9828%	0,1673%
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 168.177.128,96	R\$ 166.070.274,61	0,1784	1,0334	(1,2527)	-0,0543%	1,4472%	NC
BRADESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 1.856.699,67	R\$ 1.549.479,99	-	0,4900	0,5800	1,0728%	3,4400%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 1.851.679,71	R\$ 1.791.918,03	-	(0,6000)	(3,2300)	-3,8106%	-7,7500%	NC
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 41.278.857,60	R\$ 40.749.047,70	0,0800	0,9500	(1,2800)	-0,2624%	0,3900%	3,5000%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 426.478.933,84	R\$ 421.571.726,34						
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ -	R\$ -	(4,0389)	-	-	-4,0389%	-6,7010%	-1,0371%
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 3.307.246,03	R\$ 2.869.113,84	(2,0700)	(6,5300)	(13,2500)	-20,5932%	-21,4000%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 10.719.018,59	R\$ 11.527.867,07	3,3200	(4,5700)	7,5500	6,0424%	1,1421%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 4.542.204,47	R\$ 4.189.600,03	(3,6600)	(6,6300)	(7,7600)	-17,0277%	-14,5800%	NC
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUA	R\$ 9.390.649,23	R\$ 8.824.868,05	-	(3,7457)	(6,0249)	-9,5449%	0,3647%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 27.959.118,32	R\$ 27.411.448,99						
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 28.738.122,18	R\$ 30.681.126,89	0,9099	2,1897	6,7610	10,0914%	28,2851%	NC
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 28.738.122,18	R\$ 30.681.126,89						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 3.786.360,97						
TOTAL	R\$ 483.176.174,34	R\$ 483.450.663,19						

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 AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO (30.068.169/0001-44).

6.2 Distribuição dos Recursos por Segmento de Aplicação

DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO

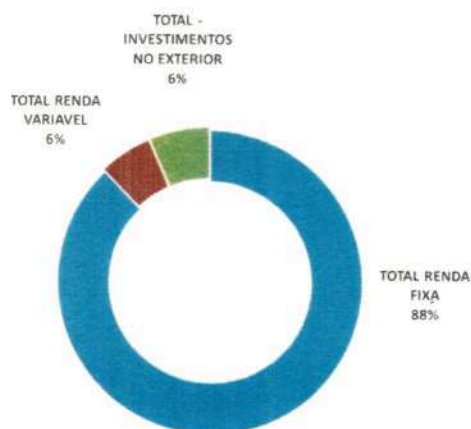


Gráfico 4.

6.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Justiça

Saldo dos Investimentos em 10/2020		RS 430.684.099,50	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
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
10/2021	RS 3.756.511,37	RS 317.532,32	RS 3.438.979,05
Saldo dos Investimentos em 10/2021		RS 483.450.663,19	

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	10,6727 %	8,2352 %	1,2500 %
Juros	5,4500 %	4,5215 %	0,4432 %
Meta	16,7043 %	13,1290 %	1,6987 %
Rentabilidade em %	2,2880 %	-0,1945 %	-0,6549 %
Rentabilidade em RS	RS 10.317.991,62	RS -906.505,74	RS -3.164.490,20
Resultado em %	-12,3529 %	-11,7773 %	-2,3144 %
Resultado em RS	RS -64.936.589,04	RS -62.045.708,47	RS -11.372.406,55

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 (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 41.575.474,67	R\$ 41.300.565,14	(1,4496)	0,3550	(0,6612)	-1,7537%	-1,8165%	0,2959%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 31.454.693,89	R\$ 31.060.642,34	0,1784	1,0334	(1,2527)	-0,0543%	1,4475%	4,3754%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.212.764,83	R\$ 20.867.774,78	(0,4488)	(0,0053)	(1,6263)	-2,0730%	-2,9828%	0,1673%
BRAPRESCO FI RF DI PREMIUM	R\$ 298.342,90	R\$ 300.072,56	-	0,4900	0,5800	1,0728%	3,4400%	NC
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 298.342,89	R\$ 288.714,08	-	(0,6000)	(3,2300)	-3,8106%	-7,7500%	NC
BRAPRESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.575.830,72	R\$ 7.478.595,71	0,0800	0,9500	(1,2800)	-0,2624%	0,3900%	3,5000%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 102.415.449,90	R\$ 101.296.364,61						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 893.492,88	R\$ 775.126,13	(2,0700)	(6,5300)	(13,2500)	-20,5932%	-21,4000%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 1.588.615,54	R\$ 1.708.491,18	3,3238	(4,5700)	7,5500	6,0464%	5,9896%	NC
BRAPRESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 483.071,04	R\$ 445.570,97	(3,6600)	(6,6300)	(7,7600)	-17,0277%	-14,5800%	NC
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT.	R\$ 9.390.649,23	R\$ 8.824.868,05	-	(3,7457)	(6,0249)	-9,5449%	0,3647%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 12.355.828,69	R\$ 11.754.056,33						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	30/09/2021	29/10/2021	ago/21	set/21	out/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 549.634,13	R\$ 586.795,29	0,9099	2,1897	6,7610	10,0914%	5,5985%	NC
TOTAL - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 549.634,13	R\$ 586.795,29						

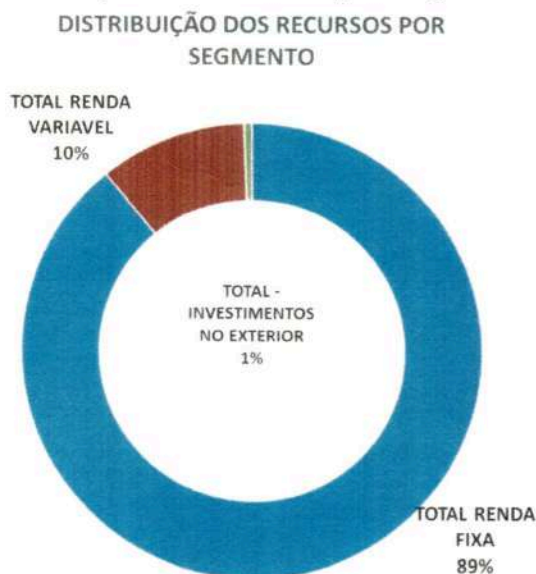
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 621.603,17						
TOTAL	R\$ 115.320.912,72	R\$ 114.258.819,40						

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



Handwritten signatures and initials in blue ink.

Gráfico 5.

Relatório de Investimentos – Outubro/2021

7.3 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1. Investimentos - Tribunal de Contas

Saldo dos Investimentos em 10/2020		RS 107.239.261,70	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
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
10/2021	RS 621.603,17	RS 7.463,96	RS 614.139,21
Saldo dos Investimentos em 10/2021		RS 114.258.819,42	

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	10,6727 %	8,2352 %	1,2500 %
Juros	5,4500 %	4,5215 %	0,4432 %
Meta	16,7043 %	13,1290 %	1,6987 %
Rentabilidade em %	0,1933 %	-2,5203 %	-1,4535 %
Rentabilidade em RS	RS 213.485,48	RS -2.875.526,92	RS -1.676.232,51
Resultado em %	-14,1478 %	-13,8332 %	-3,0996 %
Resultado em RS	RS -18.223.416,33	RS -17.846.416,85	RS -3.635.237,23

Quadro 24.

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1. Investimentos - CONSOLIDADO

Saldo dos Investimentos em 10/2020				RS 5.282.841.171,04
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)	
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	
10/2021	RS 51.242.844,99	RS 11.027.983,24	RS 40.214.861,75	
Saldo dos Investimentos em 10/2021				RS 5.756.379.611,28

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	10,6727 %	8,2352 %	1,2500 %	
Juros	5,4500 %	4,5215 %	0,4432 %	
Meta	16,7043 %	13,1290 %	1,6987 %	
Rentabilidade em %	6,9829 %	-0,9087 %	-1,7369 %	
Rentabilidade em RS	RS 363.951.670,03	RS -51.080.835,63	RS -101.041.931,73	
Resultado em %	-8,3300 %	-12,4086 %	-3,3783 %	
Resultado em RS	RS -506.504.566,09	RS -788.679.758,90	RS -199.861.261,71	

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.

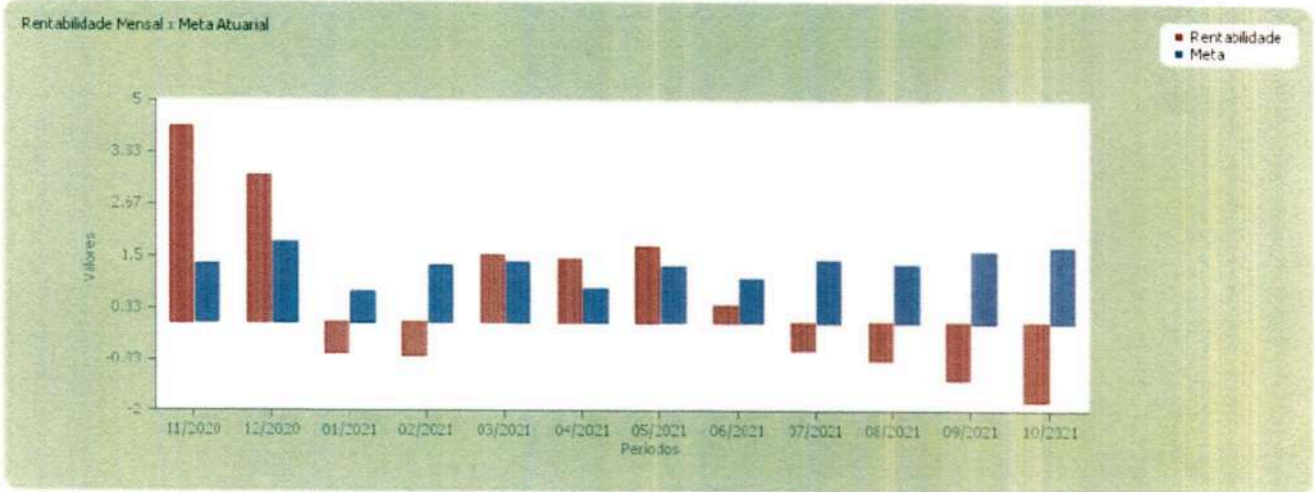


Gráfico 6.

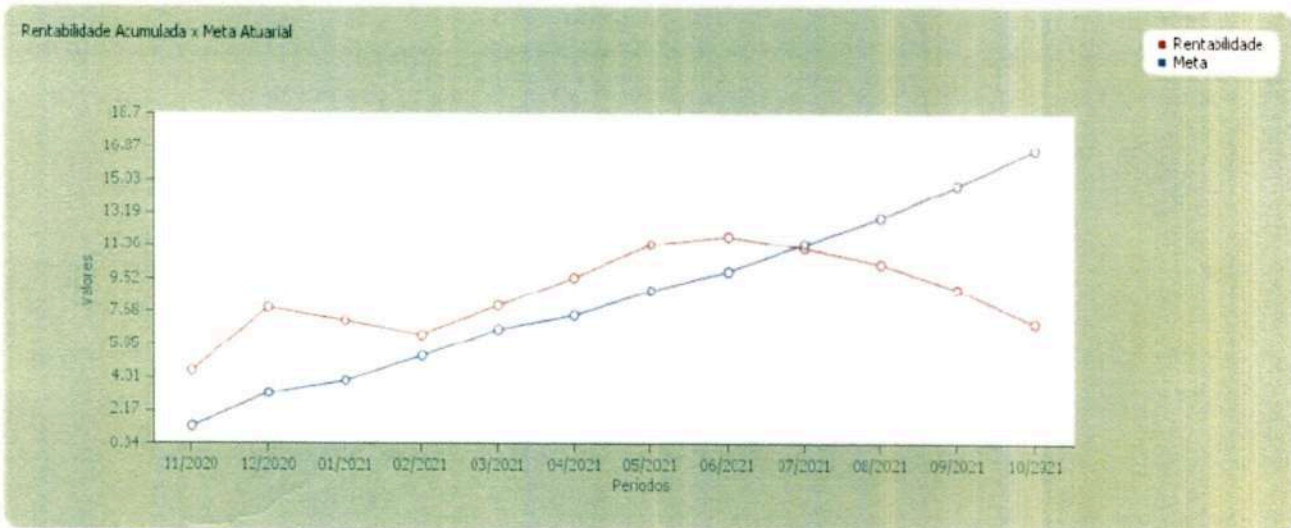


Gráfico 7.

Diego
AB
AD

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	30/09/2021	29/10/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.007.393,61	R\$ 8.298.123,58
FUNDO BRADESCO RF - COMPREV	R\$ 5.932.827,20	R\$ 5.938.971,86
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 13.614.810,52	R\$ 13.749.929,99
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 264.295,10	R\$ 264.295,10
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 335.908,41	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 21.155.234,86	R\$ 28.251.321,55

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	
	30/09/2021	29/10/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ -	R\$ 6.730,65
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 4.721,67	R\$ 1,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 10.073,15	R\$ 10.073,15
TOTAL	R\$ 14.794,82	R\$ 16.804,80

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	
	30/09/2021	29/10/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 75,89
TOTAL	R\$ -	R\$ 75,89

Quadro 28.

Relatório de Investimentos – Outubro/2021

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2021	29/10/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 491.616,21	R\$ 441.688,52
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 642.106,29	R\$ 64.628,00
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 2.522,80
TOTAL	R\$ 1.133.722,50	R\$ 508.839,32

Quadro 29.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2021	29/10/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 979.934,84	R\$ 455.843,67
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ 211.751,43	R\$ 211.751,43
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 1.191.686,27	R\$ 667.595,10

Quadro 30.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2021	29/10/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 6.461.339,79	R\$ 6.230.662,84
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 668.333,79	R\$ 598.544,47
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 7.129.673,58	R\$ 6.829.207,31

Quadro 31.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2021	29/10/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.382.039,13	R\$ 1.421.360,33
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ 1.000.433,67	R\$ 1.009.593,93
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 18.992,83	R\$ -
TOTAL	R\$ 2.401.465,63	R\$ 2.430.954,26

Quadro 32.

[Assinatura]

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2021	29/10/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 2.108.526,79	R\$ 3.523.305,25
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 48.503.901,67	R\$ 44.701.122,86
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 50.612.429,46	R\$ 48.224.428,11

Quadro 33.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2021	29/10/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ -

Quadro 34.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2021	29/10/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ -

Quadro 35.

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2021	29/10/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 308.853,71	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 156.029,03	R\$ 157.351,31
TOTAL	R\$ 464.882,74	R\$ 157.351,31

Quadro 36.

10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	30/09/2021	29/10/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 216.538,07	R\$ 72.408,34
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 216.538,07	R\$ 72.408,34

TOTAL GERAL	R\$ 51.293.850,27	R\$ 48.454.187,76
--------------------	--------------------------	--------------------------

Quadro 37.

[Assinaturas manuscritas]

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 TESOURO NACIONAL	R\$ 737.078.904,53	12,83%	10,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 737.078.904,53				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 6.958.332,45				
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 494.150.835,48				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 476.850.170,86				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 51.689.742,67				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 634.437.485,14	34,57%	22,00%	100,00%	art. 7º, inciso I, "b"
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 90.429.620,94				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 108.088.852,68				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 124.292.893,77				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.986.897.933,99				
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 21.719.692,49				
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 41.568.277,21				
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 57.568.487,11				
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.169.967,44	10,96%	13,00%	40,00%	art. 7º, inciso IV, "a"
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 460.651.666,86				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 110.339,09				
TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 629.788.430,20				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.903.899,01				
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 90.794.427,45				
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 45.342.289,80	3,20%	3,00%	5,00%	art. 7º, inciso VII, "b"
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 18.135.389,47				
TOTAL art. 7º, inciso VII, "b"	R\$ 184.176.005,73				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.537.941.274,45	61,57%			

Quadro 38.

Relatório de Investimentos – Outubro/2021

AMAZONPREV
Folha nº 031
Diego

11.2 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRDESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 28.971.075,61	0,50%	3,00%	30,00%	art 8º, inciso I, "a"
TOTAL art 8º, inciso I, "a"	R\$ 28.971.075,61				
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 37.510.403,40	23,59%	30,00%	30,00%	art. 8º, inciso II, "a"
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 77.749.002,16				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 119.011.249,27				
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.056.412,45				
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.083.088,08				
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 47.649.687,75				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 247.101.119,09				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 8.242.696,55				
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$ 29.520.346,43				
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.128.365,89				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 78.193.518,71				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 158.388.978,17				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 34.170.667,43				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 103.040.621,54				
OCCAM FIC FIA	R\$ 82.132.590,54				
SANTANDER CRESCE SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 12.585,69				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 27.079.702,67				
VINCI MOSAICO INSTUCIONAL FIA	R\$ 94.240.457,25				
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 34.475.505,29				
TOTAL art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.355.786.998,36				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 47.392.322,63	2,64%	3,00%	3,00%	art. 8º, inciso III
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 104.591.357,79				
TOTAL art. 8º, inciso III	R\$ 151.983.680,42				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.919.665,54	0,41%	2,00%	5,00%	art. 8º, inciso IV, "a"
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.357.215,73				
TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 23.276.881,27				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.560.018.635,66	27,15%			

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\$ 56.450.792,53	5,64%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 39.805.451,96				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 39.480.371,99				
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 156.015.767,96				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 32.469.444,97				
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 324.221.829,41				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 165.334.100,53	5,65%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 159.144.191,18				
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 324.478.291,71				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 648.700.121,12	11,29%			
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.746.660.031,23	100%			

Quadro 40.

ALOCAÇÃO TOTAL DA CARTEIRA

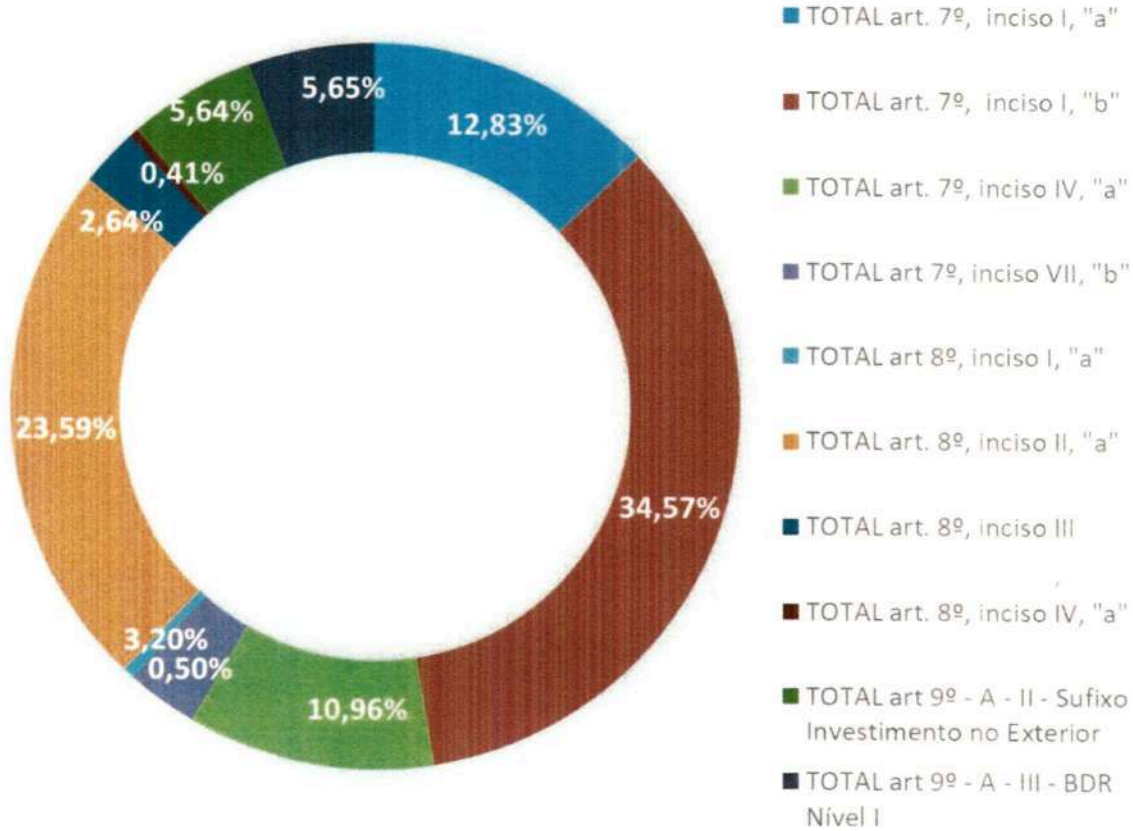


Gráfico 8.

[Handwritten signatures and initials in blue and black ink]

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\$ 37.510.403,40	0,64%	20%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 77.749.002,16	1,34%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 165.334.100,53	2,84%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 56.450.792,53	0,97%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 119.011.249,27	2,05%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 460.651.666,86	7,92%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 494.150.835,48	8,49%	
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 6.958.332,45	0,12%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.056.412,45	0,14%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.169.967,44	0,83%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 41.568.277,21	0,71%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.083.088,08	2,61%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 28.971.075,61	0,50%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 57.568.487,11	0,99%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 21.719.692,49	0,37%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 47.649.687,75	0,82%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 247.101.119,09	4,25%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.919.665,54	0,24%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 8.242.696,55	0,14%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.357.215,73	0,16%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 51.689.742,67	0,89%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 476.850.170,86	8,20%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 634.437.485,14	10,91%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE	R\$ 29.520.346,43	0,51%	
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 90.794.427,45	1,56%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.128.365,89	0,29%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 39.805.451,96	0,68%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 78.193.518,71	1,34%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 39.480.371,99	0,68%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.903.899,01	0,51%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 90.429.620,94	1,55%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 108.088.852,68	1,86%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 158.388.978,17	2,72%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 110.339,09	0,00%	
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 104.591.357,79	1,80%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 103.040.621,54	1,77%	
ITAU HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 45.342.289,80	0,78%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 34.170.667,43	0,59%	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 18.135.389,47	0,31%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 82.132.590,54	1,41%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 159.144.191,18	2,74%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 124.292.893,77	2,14%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 47.392.322,63	0,81%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 156.015.767,96	2,68%	
SANTANDER CRESCE SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 12.585,69	0,00%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 32.469.444,97	0,56%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 27.079.702,67	0,47%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 94.240.457,25	1,62%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 34.475.505,29	0,59%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 5.009.581.126,70		

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.

Relatório de Investimentos – Outubro/2021

AMAZONPREV
Folha nº 034
[Handwritten Signature]

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

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL DO FUNDO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII - 15/08/2022	R\$ 6.958.332,45	19.523.305/0001-06	R\$ 242.394.068,14	2,87%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 494.150.835,48	13.322.205/0001-35	R\$ 9.253.803.912,06	5,34%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 460.651.666,86	25.078.994/0001-90	R\$ 7.937.028.591,03	5,80%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 119.011.249,27	29.258.294/0001-38	R\$ 1.091.836.208,84	10,90%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 165.334.100,53	21.470.644/0001-13	R\$ 2.226.162.911,63	7,43%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 56.450.792,53	17.413.636/0001-68	R\$ 2.503.352.041,67	2,26%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 21.719.692,49	08.246.263/0001-97	R\$ 1.172.630.538,30	1,85%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 41.568.277,21	03.399.411/0001-90	R\$ 3.647.662.584,07	1,14%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 57.568.487,11	20.216.216.0001/04	R\$ 1.191.680.411,60	4,83%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 48.169.967,44	28.515.874/0001-09	R\$ 1.258.083.247,62	3,83%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 28.971.075,61	14.099.976/0001-78	R\$ 512.196.966,98	5,66%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 152.083.088,08	06.988.623/0001-09	R\$ 1.715.756.643,77	8,86%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 476.850.170,86	11.060.913/0001-10	R\$ 10.998.044.937,34	4,34%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 51.689.742,67	22.791.074/0001-26	R\$ 210.944.768,90	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 634.437.485,14	23.215.097/0001-55	R\$ 13.374.488.418,39	4,74%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 110.339,09	21.838.150/0001-49	R\$ 2.956.661.982,44	0,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 34.170.667,43	08.817.414/0001-10	R\$ 778.358.877,30	4,39%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 158.388.978,17	24.571.992/0001-75	R\$ 2.833.533.744,77	5,59%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 103.040.621,54	01.063.897/0001-65	R\$ 1.154.669.204,84	8,92%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 12.585,69	02.436.763/0001-05	R\$ 919.949.413,75	0,00%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 156.015.767,96	17.804.792/0001-50	R\$ 2.132.488.277,70	7,32%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 78.193.518,71	08.279.304/0001-41	R\$ 1.037.994.854,41	7,53%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 90.429.620,94	10.922.432/0001-03	R\$ 936.585.984,45	9,66%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 108.088.852,68	10.756.541/0001-06	R\$ 680.632.682,85	15,88%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 124.292.893,77	30.659.168/0001-74	R\$ 1.210.045.217,81	10,27%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 247.101.119,09	11.977.794/0001-64	R\$ 2.105.455.980,28	11,74%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 159.144.191,18	19.436.818/0001-80	R\$ 3.790.339.456,50	4,20%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 77.749.002,16	34.791.108/0001-61	R\$ 2.167.107.237,79	3,59%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 82.132.590,54	11.628.883/0001-03	R\$ 1.013.856.434,24	8,10%	
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FIA	R\$ 94.240.457,25	28.470.587/0001-11	R\$ 1.298.370.914,84	7,26%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 27.079.702,67	11.458.144/0001-02	R\$ 479.100.359,69	7,20%	
VINCI SELECTION EQUITIES FIA	R\$ 34.475.505,29	15.603.945/0001-75	R\$ 544.097.312,19	5,43%	
CAIXA FIC FIA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTIT	R\$ 29.520.346,43	30.068.169/0001-44	R\$ 697.571.200,73	4,23%	
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 37.510.403,40	38.027.169/0001-08	R\$ 840.619.093,17	4,46%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 39.805.451,96	37.331.285/0001-53	R\$ 128.428.347.506,87	0,03%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 39.480.371,99	37.331.299/0001-77	R\$ 41.770.305.266,58	0,09%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 8.242.696,55	09.290.813/0001-38	R\$ 91.634.148,06	9,00%	
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	R\$ 8.056.412,45	12.239.939/0001-92	R\$ 230.759.980,78	3,49%	
BRASIL CAPITAL RP INSTITUCIONAL FIC FIA	R\$ 47.649.687,75	40.129.641/0001-65	R\$ 537.008.567,40	8,87%	
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	R\$ 17.128.365,89	13.155.995/0001-01	R\$ 156.216.712,75	10,96%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 32.469.444,97	37.308.394/0001-50	R\$ 17.725.471.459,43	0,18%	
TOTAL	R\$ 4.650.144.559,28				

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO PL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 47.392.322,63	21.595.829/0001-54	R\$ 2.076.640.371,16	2,28%	5%
ITAÚ PRIVATE MM S&P500 BRL FIC	R\$ 104.591.357,79	26.269.692/0001-61	R\$ 2.337.314.930,66	4,47%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 13.919.665,54	35.640.811/0001-31	R\$ 1.000.466.114,74	1,39%	
BTG PACTUAL IMPACTO FIP	R\$ 9.357.215,73	36.642.497/0001-99	R\$ 188.039.026,01	4,98%	
MONGERAL AEGON CRED PRIV FI RF LP	R\$ 18.135.389,47	19.488.768/0001-84	R\$ 672.736.234,21	2,70%	
SANTANDER CRED PRIV CRESCIMENT INST	R\$ 90.794.427,45	17.138.474/0001-05	R\$ 2.101.642.107,12	4,32%	
ITAÚ HIGH GRADE RF CP FIC FI	R\$ 45.342.289,80	09.093.883/0001-04	R\$ 2.291.014.833,88	1,98%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.903.899,01	19.719.727/0001-51	R\$ 1.048.113.515,88	2,85%	
TOTAL	R\$ 359.436.567,42				

Quadro 42.

[Handwritten Signature]

Relatório de Investimentos – Outubro/2021

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

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

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

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

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA SETEMBRO/2021) EM R\$ MI	TOTAL DE RECURSOS - ANBIMA	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (OUTUBRO/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
CAIXA	RS 446.261,08	RS 446.261.079.320,39	RS 1.192.497.745,10	0,2672%	5%
BB DTVM S.A	RS 1.373.721,88	RS 1.373.721.879.794,93	RS 1.302.556.977,12	0,0948%	
BRASESCO	RS 547.187,77	RS 547.187.771.441,51	RS 350.080.587,94	0,0640%	
ICATU VANGUARDA DTVM S/A	RS 34.304,05	RS 34.304.051.453,51	RS 306.615.891,34	0,8938%	
ITAU UNIBANCO SA	RS 746.346,36	RS 746.346.355.448,48	RS 445.644.253,82	0,0597%	
BANCO BTG	RS 222.649,19	RS 222.649.194.802,70	RS 278.620.696,91	0,1251%	
BANCO SAFRA	RS 107.709,12	RS 107.709.119.765,97	RS 330.829.407,58	0,3072%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	RS 303.852,79	RS 303.852.785.830,14	RS 246.822.781,10	0,0812%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	RS 15.578,99	RS 15.578.985.756,90	RS 82.132.590,54	0,5272%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	RS 15.826,28	RS 15.826.283.305,27	RS 77.749.002,16	0,4913%	
PLURAL INVEST GESTÃO DE RECURSOS LTDA	RS 34.005,25	RS 34.005.250.086,31	RS 79.285.823,95	0,2332%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	RS 25.807,72	RS 25.807.722.746,61	RS 27.079.702,67	0,1049%	
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL LTDA	RS 25.959,25	RS 25.959.253.415,64	RS 32.469.444,97	0,1251%	
VINCI PARTNERS	RS 42.256,03	RS 42.256.033.580,02	RS 128.715.962,54	0,3046%	
ARX INVESTIMENTOS LTDA	RS 34.100,67	RS 34.100.674.851,97	RS 37.510.403,40	0,1100%	
MONGERAL AEGON	RS 8.548,24	RS 8.548.240.708,65	RS 18.135.389,47	0,2122%	
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	RS 55.506,61	RS 55.506.606.282,61	RS 8.056.412,45	0,0145%	
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADM REC LTDA	RS 7.188,35	RS 7.188.353.171,41	RS 17.128.365,89	0,2383%	
BC GESTAO RECURSOS LTDA	RS 8.417,20	RS 8.417.203.977,73	RS 47.649.687,75	0,5661%	

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.

[Assinaturas manuscritas]

DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

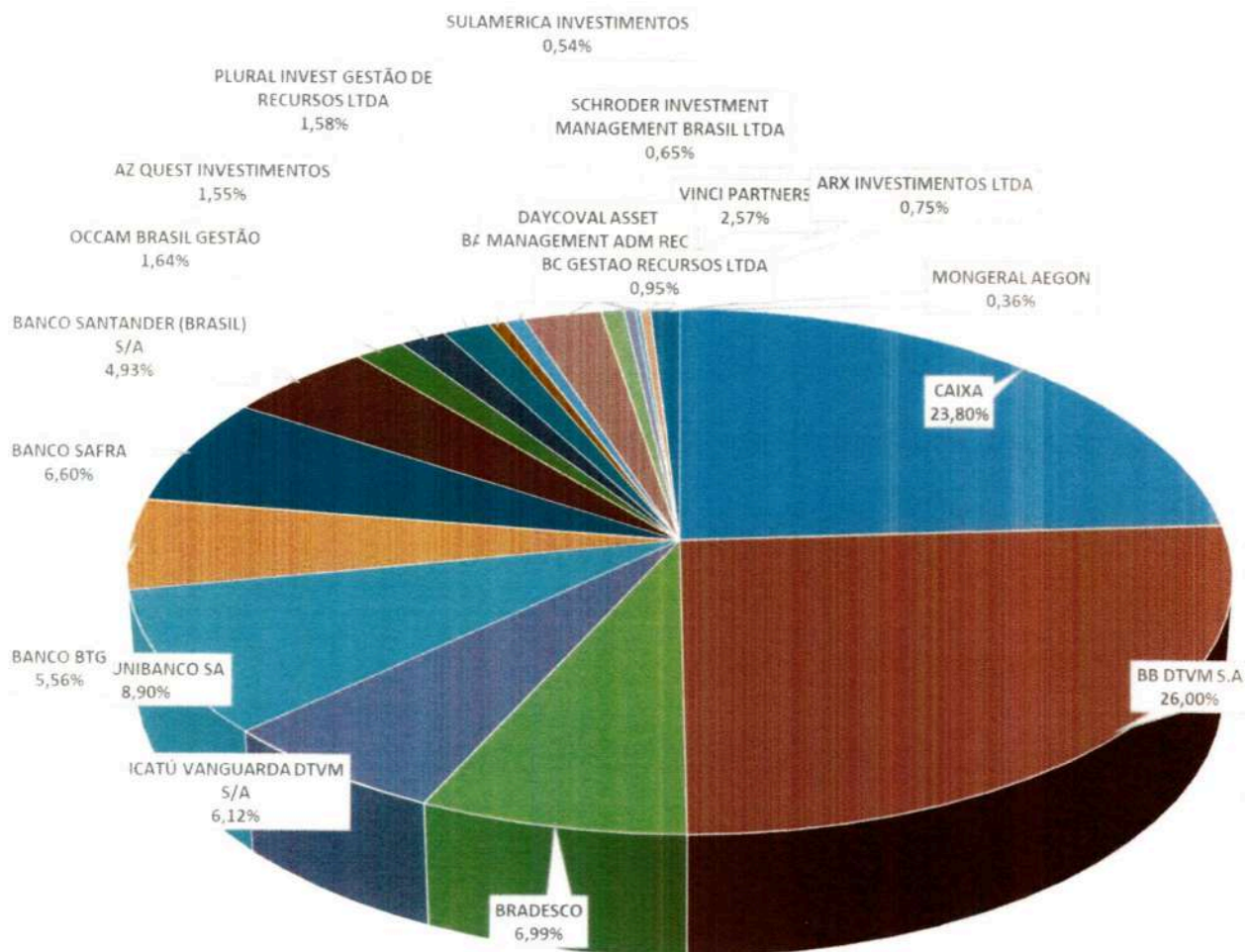


Gráfico 9.

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 5.009.581.126,70
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 737.078.904,53
TÍTULOS - CVS	R\$ 9.143.033,12
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18
VALORES EM TRÂNSITO	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 25.900.207,61
TOTAL	R\$ 5.843.538.597,14

Quadro 44.

EVOLUÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

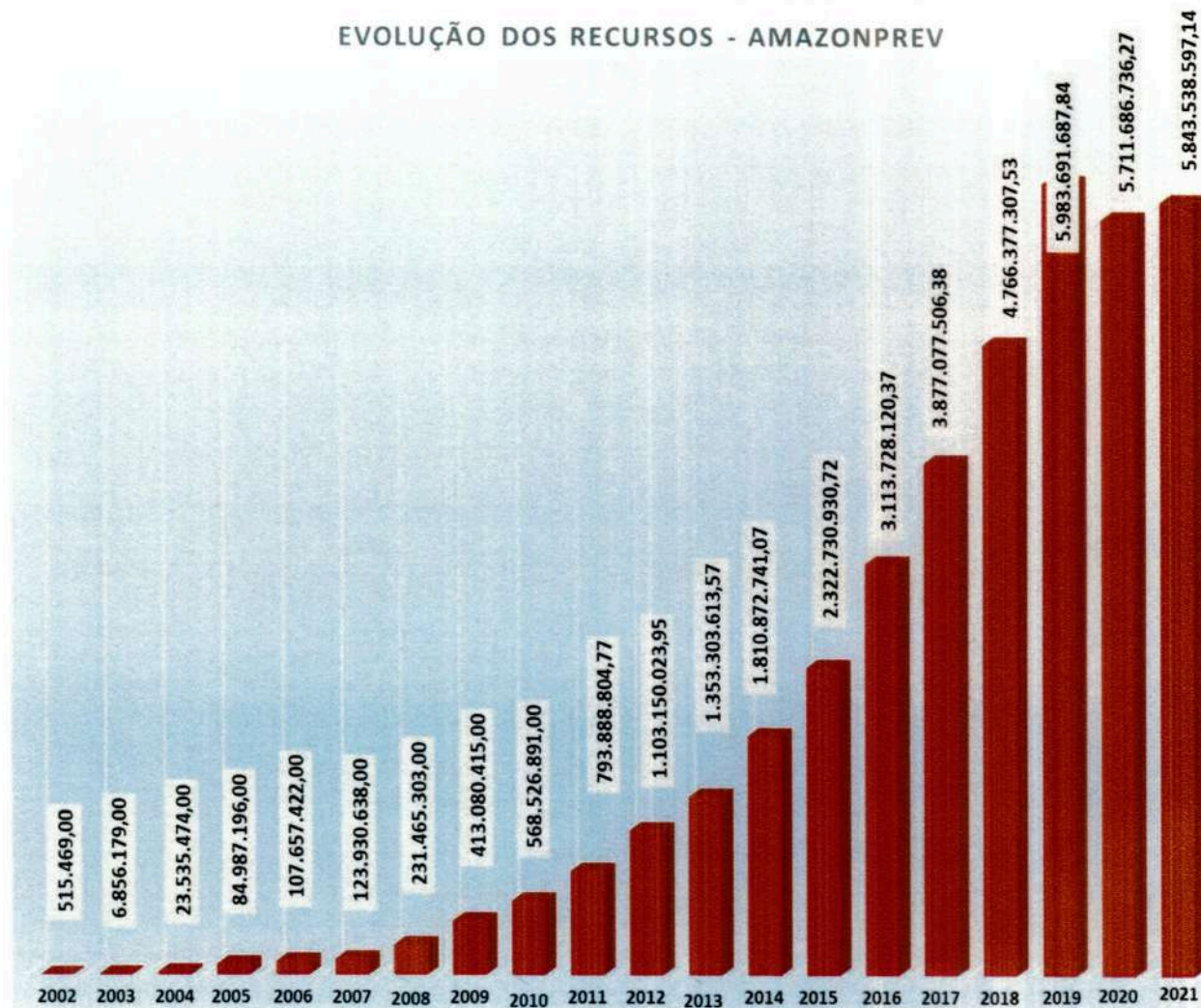


Gráfico 10.

[Handwritten signatures and initials]

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	a) Novos Recursos: Ratear entre os fundos 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 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74), , respeitando os limites da legislação. b) Recursos Atuais: Migrar R\$ 50 milhões do fundo BB Alocação Ativa (25.078.994/0001-90) para o fundo BB AÇÕES QUANTITATIVO FIC FI (07.882.792/0001-14)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2021
FPREV ALE:	Novos Recursos: Ratear entre os fundos 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 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74), respeitando os limites da legislação.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2021
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Ratear entre os fundos 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 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74), respeitando os limites da legislação.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2021
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Ratear entre os fundos 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 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74), respeitando os limites da legislação.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2021
FPREV - TJA/AM	Novos Recursos: Ratear entre os fundos 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 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74), respeitando os limites da legislação.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2021
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: Ratear entre os fundos 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 BTG PACTUAL S&P 500 BRL FUNDO DE INVESTIMENTO MULTIMERCADO (36.499.594/0001-74), respeitando os limites da legislação.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2021
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	15/12/2021
RECURSOS COMPREV	Aplicar os recursos no fundo Bradesco Maxi Poder Público.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2021
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 GERA/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/12/2021

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 – Outubro/2021

AMAZONPREV
Folha nº 040
Desejo

TOTAL RENDA FIXA	R\$	3.466.851.056,56
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$	1.532.542.803,45
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$	648.700.121,12
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$	5.648.093.981,13

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	out/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
TÍTULOS PÚBLICOS DO TESOUREIRO	R\$ 737.078.904,53						
TOTAL - art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 737.078.904,53						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso I, "b"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	out/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 6.958.332,45	1,59%	0,16%	-0,61	6,63%	-0,50%	4,14%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 51.689.742,67	5,16%	0,53%	-1,01	-1,66%	-1,49%	-5,56%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 476.850.170,86	2,68%	0,28%	-1,44	4,19%	-1,24%	1,03%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 589.736.362,28	2,40%	0,25%	-1,00	0,30%	-0,66%	-1,82%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 90.429.620,94	2,73%	0,28%	-1,56	3,99%	-1,24%	0,83%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 108.088.852,68	8,69%	0,90%	-2,25	-1,41%	-3,87%	-10,58%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 124.292.893,77	6,38%	0,66%	-1,49	-0,51%	-3,23%	-7,75%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 494.150.835,48	2,49%	0,26%	-1,12	4,38%	-1,25%	1,45%
TOTAL - art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.942.196.811,13						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso IV, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	out/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocao Ativa Fcfi	R\$ 460.651.666,86	2,83%	0,29%	-0,71	0,17%	-1,63%	-2,98%
Bradesco Fc FI RF Alocao Dinamica	R\$ 48.169.967,44	2,82%	0,29%	-0,84	0,85%	-0,72%	-2,35%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ 57.568.487,11	2,83%	0,29%	-1,52	3,50%	-1,28%	0,39%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 1.042.533,44	0,10%	0,01%	0,00	3,23%	0,48%	2,92%
Itau Instit Alocao Dinamica RF FICFI	R\$ 110.339,09	0,95%	0,10%	-0,58	2,27%	-0,36%	1,96%
Bradesco FI RF RefDI Premium	R\$ 35.856.341,23	0,19%	0,02%	-0,12	3,70%	0,58%	3,44%
TOTAL - art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 603.399.335,17						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA art. 7º, inciso VII, "b"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	out/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 29.903.899,01	3,71%	0,38%	-2,08	4,30%	-2,43%	0,51%
Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	R\$ 18.135.389,47	0,33%	0,03%	-0,06	5,72%	0,61%	4,68%
Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	R\$ 90.794.427,45	0,37%	0,04%	-0,06	5,18%	0,68%	4,55%
Itau High Grade RF Cred Priv FICFI	R\$ 45.342.289,80	0,25%	0,03%	-0,03	4,14%	0,63%	3,64%
TOTAL - art. 7º, inciso VII, "b"	R\$ 184.176.005,73						

Relatório de Investimentos – Outubro/2021

AMAZONPREV
Folha nº 041
Dupe

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso I, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	RETORNO	RETORNO	RETORNO
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	R\$ 28.971.075,61	20,35%	2,10%	-10,90	6,24%	-7,76%	-14,58%
TOTAL - art. 8º, inciso I, "a"	R\$ 28.971.075,61						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso II, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	out/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Ações Valor FICFIA	R\$ 119.011.249,27	20,51%	2,11%	-15,12	19,55%	-5,54%	-7,69%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 152.083.088,08	21,24%	2,19%	-10,17	5,56%	-12,54%	-10,38%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 247.101.119,09	22,31%	2,30%	-9,04	-15,80%	-13,06%	-26,38%
Caixa FIA Consumo	R\$ -	22,41%	2,31%	-10,57	-9,94%	-9,82%	-20,96%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	R\$ 78.193.518,71	18,66%	1,92%	-9,60	1,54%	-6,96%	-17,20%
Itau Acoes Dunamis Fc	R\$ 158.388.978,17	18,09%	1,86%	-6,97	9,73%	-7,54%	-8,06%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 34.170.667,43	20,03%	2,06%	-10,50	2,98%	-8,78%	-16,45%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	R\$ -	22,43%	2,31%	-11,17	4,46%	-11,78%	-15,07%
Itau Small Cap Master FIA	R\$ 103.040.621,54	22,28%	2,30%	-9,56	13,11%	-10,63%	-8,88%
Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	R\$ 12.585,69	20,77%	2,13%	-12,22	-1,71%	-8,53%	-18,93%
Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	R\$ -	20,69%	2,13%	-11,97	4,29%	-6,95%	-14,42%
Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	R\$ -	20,76%	2,13%	-12,23	-1,67%	-8,52%	-18,90%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 77.749.002,16	19,55%	2,01%	-10,73	9,57%	-6,79%	-8,22%
Occam Fc de FIA	R\$ 82.132.590,54	20,19%	2,08%	-12,30	6,72%	-4,90%	-13,38%
Sul America Equities FIA	R\$ 27.079.702,67	20,23%	2,08%	-11,50	-2,15%	-11,57%	-19,54%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 8.242.696,55	19,28%	1,99%	-9,78	0,74%	-8,49%	-15,95%
Vinci Mosaico Institucional FIA	R\$ 94.240.457,25	20,18%	2,08%	-10,27	3,81%	-8,38%	-15,88%
Vinci Selection Equities FIA	R\$ 34.475.505,29	18,46%	1,90%	-10,60	3,87%	-8,12%	-13,22%
Brasil Capital Rp Inst Fc de FIA	R\$ 47.649.687,75			-5,83		-13,25%	
Brpp Action Fc FIA	R\$ 8.056.412,45	20,06%	2,06%	-11,80	3,37%	-8,24%	-16,79%
Daycoval Ibovespa Ativo FIA	R\$ 17.128.365,89	21,13%	2,17%	-11,29	0,08%	-9,35%	-18,91%
Cx FIC FIA BR Acoes Livre Quantitativo	R\$ 11.401.729,95	20,95%	2,16%	-7,51	19,54%	-6,02%	0,36%
ARX Income Inst Fc FIA	R\$ 37.510.403,40	19,13%	1,97%	-10,58		-6,83%	-9,62%
TOTAL - art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.337.668.381,88						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso III	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	out/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
Safrá S P Reais Pb FI Mult	R\$ 47.392.322,63	13,04%	1,35%	-5,08	43,56%	7,55%	25,96%
Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	R\$ 104.591.357,79	13,18%	1,36%	-5,12	44,35%	7,63%	26,41%
TOTAL - art. 8º, inciso III	R\$ 151.983.680,42						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL art. 8º, inciso IV, "a"	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	out/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BTG Pactual Economia Real FIP	R\$ 13.919.665,54						
TOTAL - art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 13.919.665,54						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	out/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 56.450.792,53	19,43%	2,01%	-10,91	40,86%	6,76%	28,29%
Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	R\$ 156.015.767,96	16,94%	1,75%	-11,57	31,15%	7,86%	25,08%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	R\$ 32.469.444,97	19,16%	1,98%	-9,75	36,11%	7,56%	29,42%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 39.480.371,99	32,41%	3,33%	-24,25	43,51%	10,90%	20,78%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 39.805.451,96	19,25%	1,98%	-10,58	16,02%	7,31%	18,52%
TOTAL - art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 324.221.829,41						

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR TOTAL art 9º - A - III - BDR Nivel I	SALDO ATUAL	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	out/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nivel I	R\$ 165.334.100,53	17,46%	1,80%	-11,63	34,98%	10,65%	31,31%
Safrá Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	R\$ 159.144.191,18	17,67%	1,83%	-10,16	32,79%	8,52%	29,18%
TOTAL - TOTAL art 9º - A - III - BDR Nivel I	R\$ 324.478.291,71						

Quadro 1.

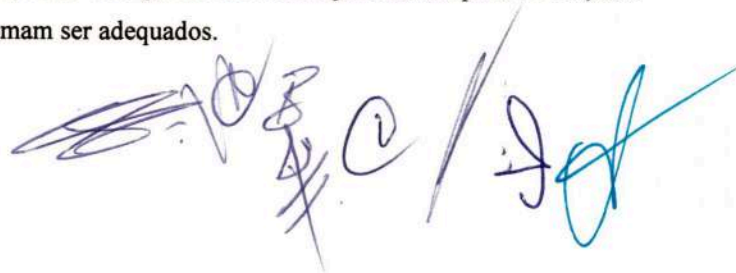
Fonte: Econômica, base Extratos de Posição Mensal dos Investimentos – FPREV Amazonprev.

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.



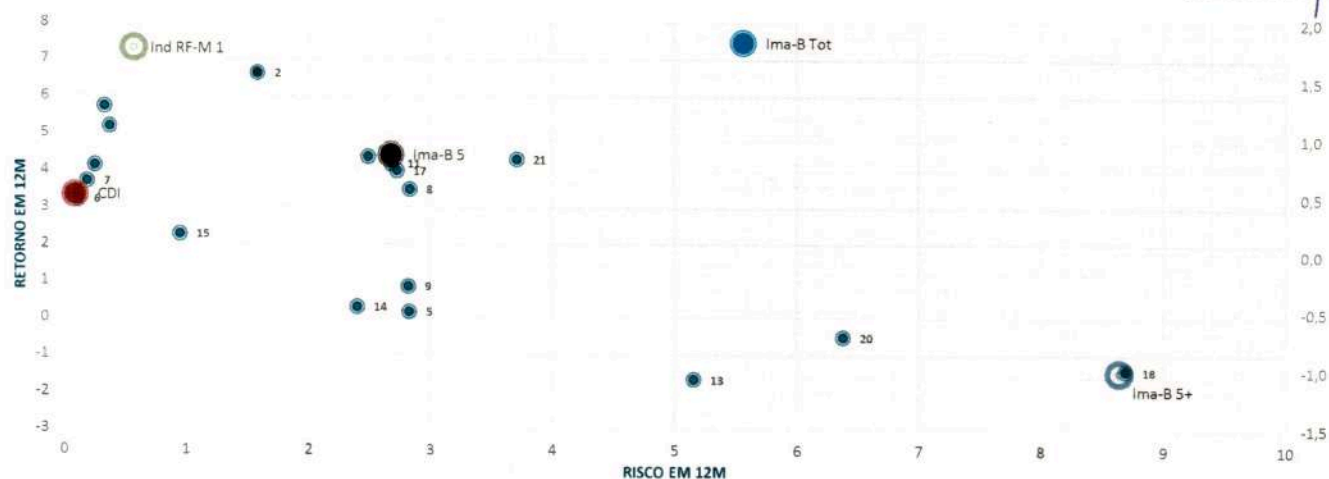


Gráfico 1: Art. 7º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Tit Publ VII FI	6,63	1,59	D+000	D+000
art. 7º, inciso I, "b"	BB Prev RF Idka 2 FI	4,38	2,49	D+001	D+001
art. 7º, inciso IV, "a"	BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfi	0,17	2,83	D+003	D+003
art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	3,23	0,10	D+000	D+000
art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	3,50	2,83	D+001	D+001
art. 7º, inciso IV, "a"	Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	0,85	2,82	D+003	D+004
art. 7º, inciso I, "b"	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	4,19	2,68	D+000	D+000
art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	-1,66	5,16	D+000	D+000
art. 7º, inciso I, "b"	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	0,30	2,40	D+000	D+000
art. 7º, inciso IV, "a"	Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	2,27	0,95	D+000	D+001
art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	3,99	2,73	D+000	D+001
art. 7º, inciso I, "b"	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	-1,41	8,69	D+000	D+001
art. 7º, inciso I, "b"	Safra Ima Institucional Fc FI RF	-0,51	6,38	D+003	D+004
art. 7º, inciso VII, "b"	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	4,30	3,71	D+005	D+006
art. 7º, inciso VII, "b"	Mongeral Aegon Cred Priv FI RF LP	5,72	0,33	D+000	D+001
art. 7º, inciso VII, "b"	Sant RF Cred Priv Crescimento Inst FI LP	5,18	0,37	D+000	D+001
art. 7º, inciso VII, "b"	Itau High Grade RF Cred Priv FICFI	4,14	0,25	D+000	D+000

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

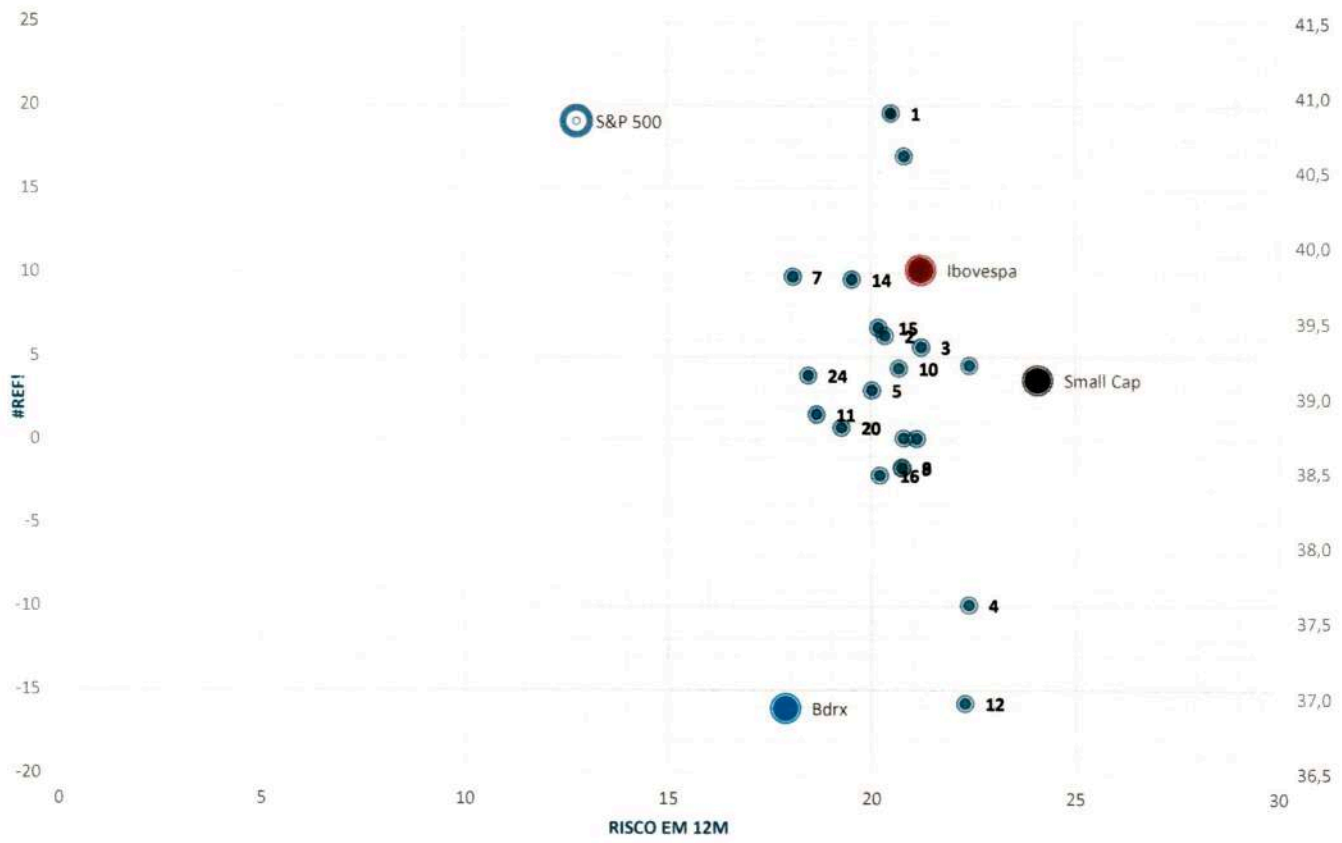


Gráfico 2: Art. 8º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso II, "a"	BB Ações Valor FICFIA	19,55	20,51	D+030	D+032
2	art. 8º, inciso I, "a"	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	6,24	20,35	D+000	D+002
3	art. 8º, inciso II, "a"	Bradesco FIA Mid Small Caps	5,56	21,24	D+001	D+003
4	art. 8º, inciso II, "a"	Caixa FIA Consumo	-9,94	22,41	D+001	D+003
5	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	2,98	20,03	D+002	D+002
6	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc	4,46	22,43	D+021	D+023
7	art. 8º, inciso II, "a"	Itau Acoes Dunamis Fc	9,73	18,09	D+021	D+023
8	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	-1,67	20,76	D+027	D+029
9	art. 8º, inciso II, "a"	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	-1,71	20,77	D+001	D+003
10	art. 8º, inciso II, "a"	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	4,29	20,69	D+001	D+003
11	art. 8º, inciso II, "a"	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	1,54	18,66	D+001	D+003
12	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	-15,80	22,31	D+001	D+032
14	art. 8º, inciso II, "a"	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	9,57	19,55	D+027	D+029
15	art. 8º, inciso II, "a"	Occam Fc de FIA	6,72	20,19	D+001	D+003
16	art. 8º, inciso II, "a"	Sul America Equities FIA	-2,15	20,23	D+001	D+003
20	art. 8º, inciso II, "a"	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	0,74	19,28	D+001	D+003
24	art. 8º, inciso II, "a"	Vinci Selection Equities FIA	3,87	18,46	D+060	D+062
25	-	Brasil Capital Master 30 II FIA	0,09	20,81	D+000	D+002
26	-	BNP Paribas Master Acoes FI			D+000	D+003
29	art. 8º, inciso II, "a"	Daycoval Ibovespa Ativo FIA	0,08	21,13	D+012	D+014
30	art. 8º, inciso II, "a"	Caixa FIC FIA Acoes Livre Quantitativo	16,96	20,83	D+013	D+015
31	art. 8º, inciso II, "a"	ARX Income Inst Fc FIA		19,13	D+001	D+003

Quadro 3. Legenda Gráfico 2.

Relatório de Investimentos – Outubro/2021

AMAZONPREV
Folha nº 015
12/10/21

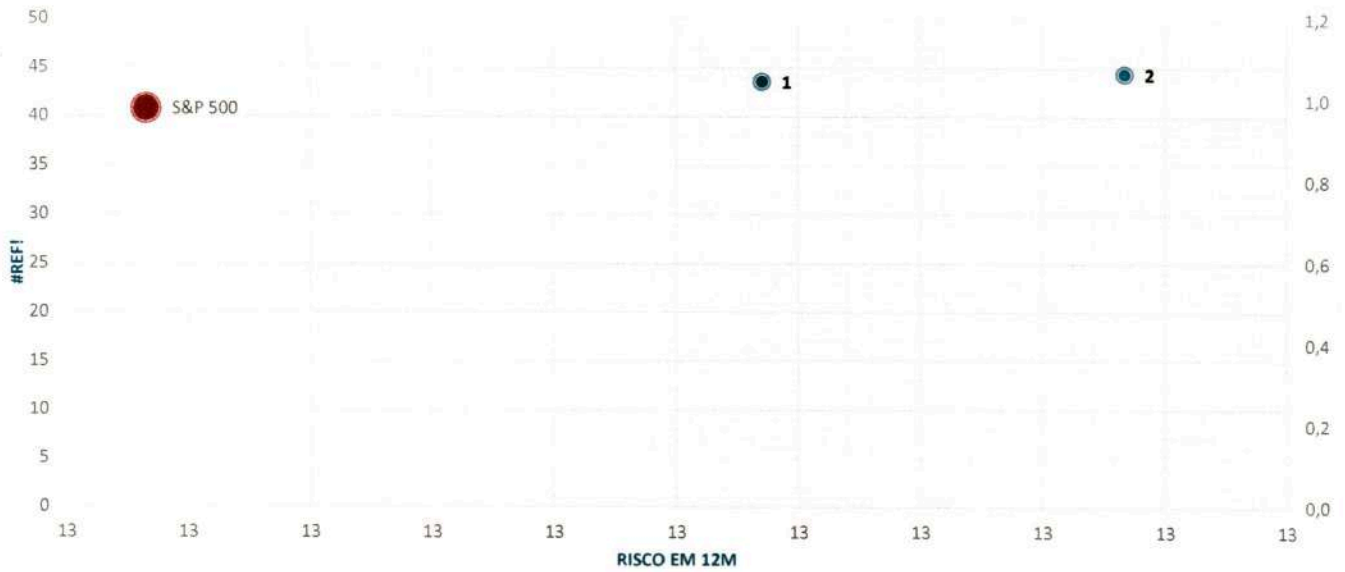


Gráfico 3: Art. 8-III,º Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

Nº	art.	Fundos	Retorno	Volatilidade	Prazo conversão resgate	Prazo pgto resgate
1	art. 8º, inciso III	Safra S P Reais Pb FI Mult	43,56	13,04	D+001	D+002
2	art. 8º, inciso III	Itau Private Mult S&P500 Brl Fc	44,35	13,18	D+000	D+001

Quadro 4. Legenda Gráfico 3.

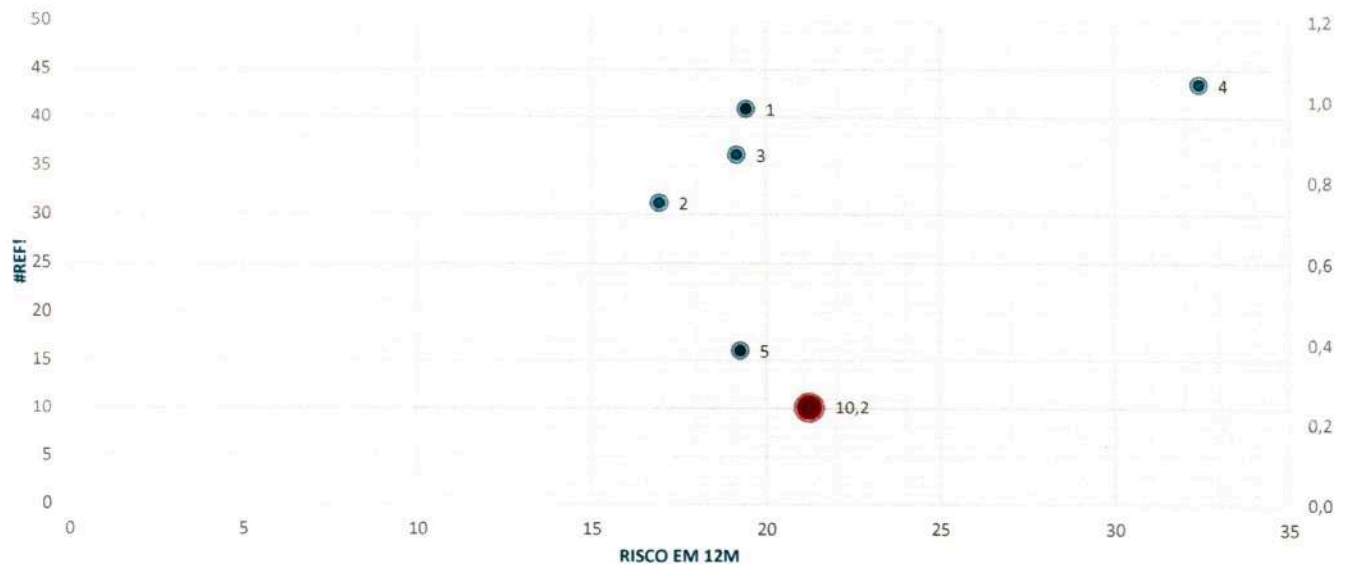


Gráfico 4: Art. 9º-A-II Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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	40,86	19,43	D+001	D+005
2	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Sant Global Equi Dolar Mas Mult Ie Fc FI	31,15	16,94	D+001	D+008
3	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	36,11	19,16	D+001	D+004
4	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	43,51	32,41	D+001	D+006
5	art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	16,02	19,25	D+001	D+006

[Handwritten signatures and initials]

Quadro 5. Legenda Gráfico 4.

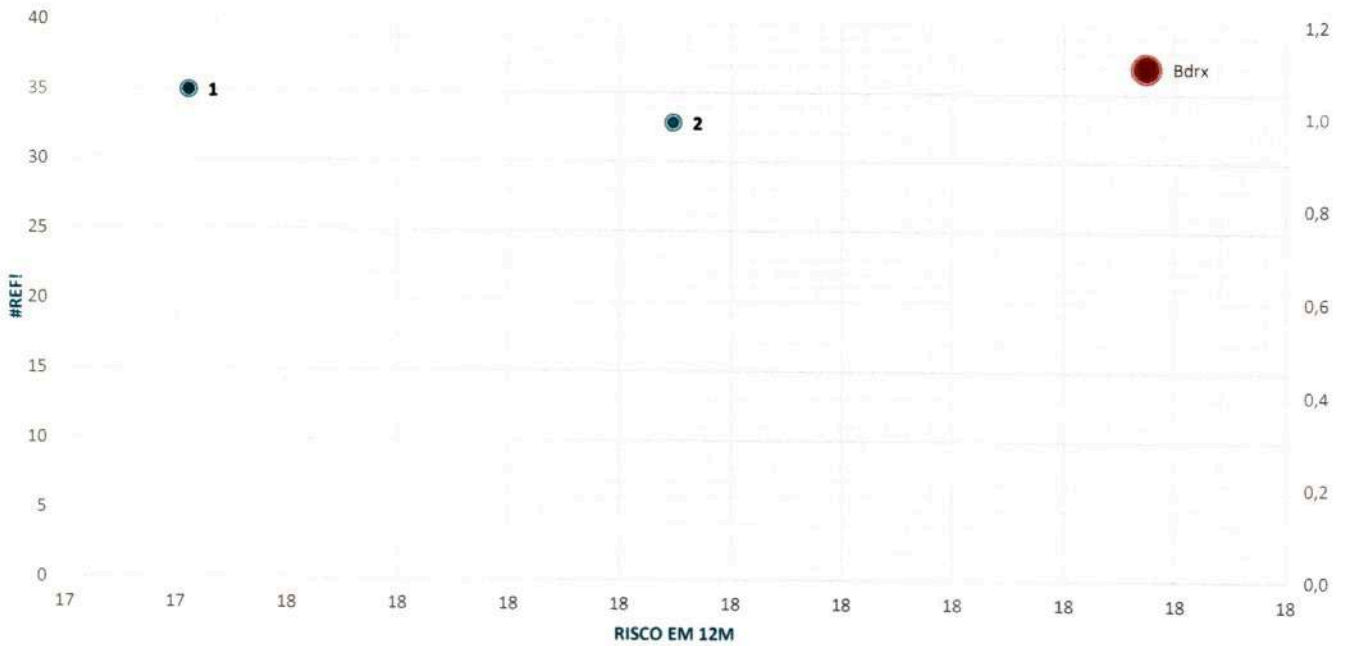


Gráfico 5: Art. 9-A-IIIº Resolução CMN nº. 3.922/210 - Análise Risco x Retorno (12 M)

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	34,98	17,46	D+001	D+004
2	art 9º - A - III - BDR Nível I	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nível I	32,79	17,67	D+001	D+004

Quadro 6. Legenda Gráfico 5.

[Handwritten signatures and scribbles in blue ink]

2. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

DATA BASE EM 29.10.21

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,59	1,61%	59,1%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,61	1,49%	14,8%
CDB	1,95	1,13%	0,7%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	0,66	3,14%	1,0%
BOND	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,24	-	19,6%
Over	0,00	-	4,8%
Carteira Crédito	3,34	1,60%	75,5%
Crédito - Contribuição Fundo	1,24	1,21%	75,5%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	3,27	1,21%	100,0%

Quadro 03

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financeiro	% PL
AAA	302.952.669	28,9%
AA+	86.599.156	8,3%
AA	134.216.895	12,8%
AA-	101.023.161	9,6%
A+	68.632.721	6,5%
DPGE	0	0,0%
A	7.912.743	0,8%
A-	16.829.744	1,6%
BBB+	0	0,0%
BBB	0	0,0%
BBB-	8.251.172	0,8%
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	65.199.103	6,2%
Tesouro / Over	256.565.609	24,5%
Total	1.048.182.972	100,0%

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

Quadro 04.

TABELA - SETOR		
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	196.934.842	18,8%
Bancos	161.610.899	15,4%
Serviço	124.698.198	11,9%
Conc. Rodoviárias	79.927.561	7,6%
Saneamento	74.750.816	7,1%
Varejo	45.940.505	4,4%
Infraestrutura	24.358.450	2,3%
Logística	22.085.113	2,1%
Shopping Center	21.898.386	2,1%
Industria e Comércio	14.959.641	1,4%
Holding	10.258.363	1,0%
Óleo e Gás	8.310.779	0,8%
Papel e Celulose	4.015.836	0,4%
Mineração e Siderurgia	1.867.974	0,2%
Tesouro / Over	256.565.609	24,5%
Total	1.048.182.972	100,0%

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLACÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 29/10/2021)

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 18 de novembro de 2021, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de outubro/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, 18 de novembro 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