

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 15/02/2021

### RELATÓRIO Nº. 002 / 2021 – COMIV

Senhores Diretores,

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

- 1) Cenário econômico externo e interno, resumindo os principais acontecimentos que influenciaram nos resultados verificados nesse mês (páginas 03 a 06);
- 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 14)
- 3) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 15 a 17)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 18 e 19)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 20 e 21)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 22 e 23)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 24 e 25)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 26)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 27 a 28)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 29)
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 30 a 35)
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 36)
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 37)
- 14) Relatório de Riscos da Carteira (página 38 a 43)
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 44).
- 16) Parecer do Comitê de Investimentos (página 45).
- 17) Parecer do Comitê de Investimentos (página 46).

*89 C b*

*[Handwritten signatures]*

### 1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

Com apoio dos Relatórios: Carta do Gestor e Síntese Mensal, emitidos pela BRAM Asset Management:

**Brasil:** Ata do Copom sinaliza remoção gradual do estímulo monetário extraordinário

**Mundo:** China cresce acima do esperado. Fed e ECB mantém estímulos.

Comitê de Política Monetária (Copom) indica em ata que alguns membros questionam a manutenção do grau de estímulo extraordinariamente elevado. Na ata da última reunião, na qual a Selic foi mantida em 2,00%, o Comitê afirmou que, neste momento, considera adequado tal nível de estímulo monetário, mas que as condições de manutenção do forward guidance deixaram de ser satisfeitas. Sobre essas condições, o Copom destaca as projeções e expectativas de inflação, que já se encontram suficientemente próximas da meta para o horizonte relevante de política monetária. Com isso, o Copom deixa de se comprometer a não reduzir o grau de estímulo monetário, conduzindo a política monetária de acordo com a análise da inflação prospectiva e de seu balanço de riscos. De toda forma, o Banco Central defende que a retirada do forward guidance não implica mecanicamente em uma elevação da taxa de juros, mas a ata revelou que alguns membros do comitê julgam que o Copom deveria considerar o início de um processo de normalização parcial. Diante de um cenário mais pressionado de inflação, antecipamos o início do ciclo de retirada do estímulo extraordinário para a próxima reunião, em março. Para o encerramento do ano, mantivemos a Selic em 4%.

IPCA de dezembro e prévia de janeiro (IPCA-15) mostram cenário de inflação pressionada no curto prazo. A inflação de dezembro variou 1,35% na margem, acima do esperado, com o IPCA fechando o ano de 2020 em 4,52%. Já a prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) de janeiro variou 0,87%, abaixo do consenso de mercado, mas com uma abertura desfavorável. A surpresa baixista ficou concentrada em alimentos e combustíveis, componentes que costumam ter grande flutuação e, por isso, não compõem as principais medidas de núcleo de inflação. A média desses núcleos, que são métricas que justamente excluem ou suavizam itens voláteis, registrou variação um pouco acima do projetado, sinalizando alguma pressão à frente. A nossa perspectiva é de novas escaladas da inflação interanual nos próximos meses, subindo para próximo de 6% em meados do ano. Para o fim do ano, projetamos variação de 3,6% para o IPCA, valor próximo à meta do BCB, de 3,75%.

Atividade tem avanço adicional em novembro. O Índice do Banco Central de atividade (IBC-Br), o indicador prévio do PIB, avançou 0,6% na margem em novembro. O resultado refletiu as altas da indústria (1,2%), do comércio (0,6%) e do setor de serviços (2,6%) no mês. Na comparação interanual, o índice teve queda de 0,8%. O indicador se situa 1,5% abaixo do patamar pré-pandemia. Com os últimos dados de

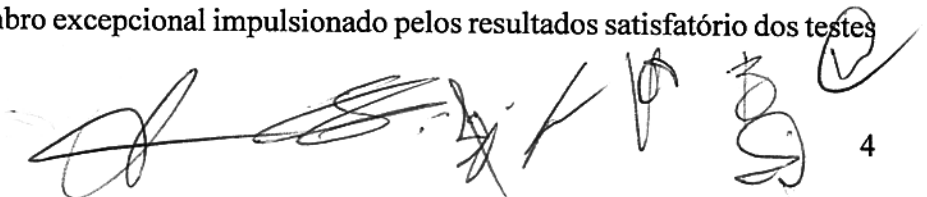
## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

atividade divulgados, nosso tracking do PIB do 4º trimestre passou para 2,2% na margem. Para 2020, esperamos queda do PIB de 4,5%.

Nos EUA, o Fed manteve a taxa de juros entre 0% e 0,25% e indicou que o ritmo de recuperação econômica moderou recentemente, com perda de força concentradas nos setores mais atingidos pela pandemia. O banco central americano reafirmou que manterá o patamar da taxa de juros e o programa de US\$120 bilhões mensais em compra de ativos, até avanço substancial em direção ao alcance das metas de pleno emprego e da estabilidade de preços. O presidente do Fed, Jerome Powell, declarou em entrevista que segue com a avaliação de que a pandemia ainda apresenta riscos consideráveis para a economia no médio prazo e que, portanto, qualquer discussão sobre retirada de estímulos é prematura. Nesse sentido, o presidente do Fed reforçou a importância do estímulo fiscal. Sobre a dinâmica de inflação, Powell defende que o Fed deve ser paciente, não reagindo a prováveis movimentos transitórios de alta nos preços. Diante de toda a incerteza oriunda da trajetória da epidemia e do impacto sobre o mercado de trabalho, avaliamos que os estímulos permanecerão presentes por um período prolongado.

Já na Zona do Euro, após o anúncio de estímulos na reunião de dezembro, o Banco Central Europeu (BCE) manteve a política de juros e de compra de ativos. O BCE não alterou o Programa Pandêmico de Compras Emergenciais (PEPP na sigla em inglês), mantido em € 1,85 trilhão em compra de ativos, com horizonte de compras até março de 2022 ou até o BCE julgar que a crise tenha se encerrado. Em entrevista, a presidente do BCE, Christine Lagarde, reconheceu que os riscos negativos prevalecem, mas se tornaram menos pronunciados. De um lado, os riscos positivos contemplam o início da vacinação, a resolução do Brexit e das eleições do EUA, bem como a resiliência da indústria. Do lado negativo, Lagarde pontou a extensão das medidas restritivas de mobilidade, a variante mais contagiosa do coronavírus e a inflação persistentemente baixa. Avaliamos que as medidas de restrição terão impacto menor sobre a atividade em relação ao que foi observado na primeira onda.

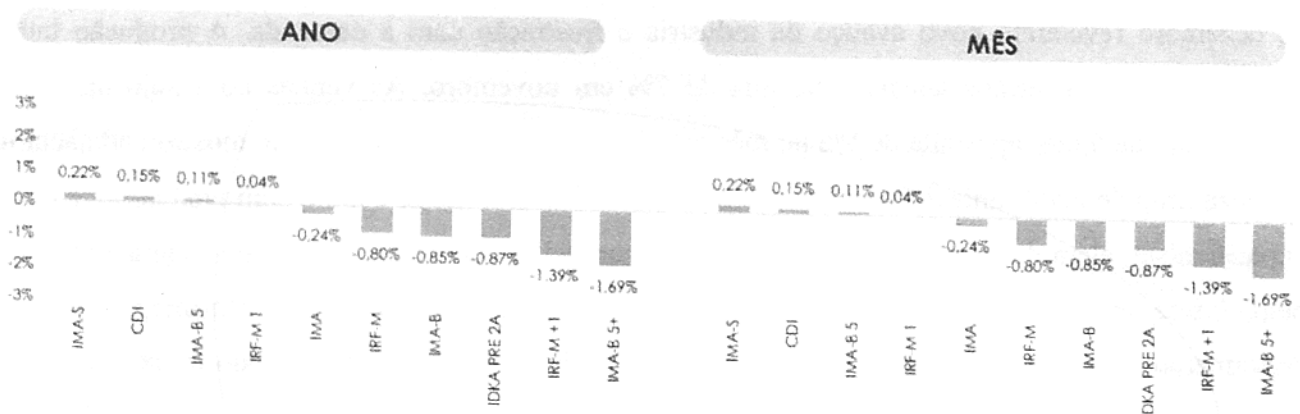
O PIB da China surpreendeu positivamente no 4º trimestre. Houve alta de 6,5% na variação anual, ante alta de 4,9% no 3º trimestre. Com essa variação, o PIB avançou 2,3% no ano. Segundo os nossos cálculos, o nível do PIB já se encontra em patamar acima do pré-crise. Reforçando a composição do ano, os indicadores de dezembro revelaram novo avanço da indústria e frustração com a demanda. A produção industrial avançou 7,3% em termos anuais, ante alta de 7% em novembro. As vendas no varejo apresentaram crescimento de 4,6%, após alta de 5% no mês anterior. Já o dado de investimento mostrou alta acumulada até dezembro de 2,9%, ante 2,6% até novembro. Em 2020, a atividade contou com uma política creditícia expansionista, além do impulso externo bastante favorável em decorrência da maior demanda global por bens. Nesse ano, a expectativa é que a normalização do consumo interno seja o principal vetor para o crescimento esperado de 8% do PIB. **Perspectivas Renda Fixa** - O começo do ano trouxe aos mercados um pouco de realidade, após um dezembro excepcional impulsionado pelos resultados satisfatório dos testes



## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

das vacinas e início do processo de vacinação pelo mundo. Fatos como a segunda onda de contaminação de COVID-19 e a possibilidade de atrasos na cobertura vacinal trazem incerteza aos mercados. Nessa linha o destaque vai para os EUA que está na frente na comparação do volume de doses aplicadas. Mesmo assim, novos lockdowns têm sido implementados pelo mundo, trazendo o receio com relação a tendência de retomada das economias. Do mesmo modo, a Europa poderá permanecer em ciclos de lockdowns durante todo o primeiro trimestre. Adicionalmente, os EUA se mobilizam para injetar mais recursos para tentar atenuar os impactos negativos da segunda onda. No entanto, todo esse dinheiro, disponibilizado nas economias através dos auxílios, promove um excesso de liquidez, que em um mercado com menor risco, pode beneficiar os ativos de países emergentes. Aqui no Brasil não é diferente, mas as intensidades de alguns pontos mencionados são maiores, como por exemplo, o de piora do endividamento e os choques inflacionários advindos de alimentos e commodities. O feriado de final de ano trouxe um aumento expressivo no número de novos casos de COVID-19 e a restrição a mobilidade já é realidade em muitas localidades brasileiras. Por este motivo, acredita-se que o governo irá agir para atenuar os efeitos na economia. Nessa perspectiva, percebemos uma alta na curva de juros neste mês, tal impacto é referente ao aumento da incerteza fiscal. Do lado inflacionário, os choques das commodities e a expectativa de uma inflação acima da banda da meta para o primeiro semestre adicionam uma maior incerteza com relação ao cumprimento da meta para o final do ano. Entretanto, a gestão não acredita em uma normalização mais intensa, mantendo uma alta na Selic de 200 pontos para esse ano levando a taxa para 4%. Destaque positivo vai para o IMA-S, índice de ativos pós fixados atrelados à Selic da ANBIMA, terminando o mês com resultado de 150% do CDI. Este mês foi caracterizado pelos retornos negativos dos índices de renda fixa. O aumento paralelo das taxas, tanto em ativos prefixados quanto atrelados à inflação, no curto e no longo prazo, foram reflexo de toda incerteza descrita acima. Contudo, existe um prêmio na curva e uma preferência pela alocação nos vértices intermediários que podem se beneficiar de um ambiente mais ameno. Nesse sentido, o dólar retomou aos patamares mais altos de 2020, com aumento de 5,37%, fechando janeiro a R\$ 5,48.

### RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



*[Handwritten signatures and initials]*

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

**Perspectivas Renda Variável** - O ano de 2021 começou na esteira favorável a ativos de risco que aconteceu no final do ano passado, mas o crescimento das preocupações com a segunda onda de infecções diminuíram este clima de otimismo, ao menos no curto prazo. O S&P 500 teve retorno de -1,11% e o Nasdaq teve retorno de 1,41% (em moeda original). O Ibovespa encerrou o mês com rentabilidade de -3,32%. Apesar do retorno negativo em janeiro, o fluxo do estrangeiro continua positivo e o mercado de capitais permanece aquecido. A gestão continua com visão positiva para renda variável no médio e longo prazos, onde pode-se destacar fatores como a expectativa de retomada da agenda de reformas do governo, retomada do crescimento do PIB e juros em patamares historicamente baixos, trazendo fluxo do investidor local para a bolsa. O risco de novos aumentos de casos de COVID-19, assim como eventuais dificuldades na recuperação da economia brasileira, permanecem como pontos de atenção no curto prazo. Os gestores acreditam que o balanço de forças entre a expectativa de novos pacotes de estímulo fiscal nos EUA e o ambiente local justificam a adoção de portfólios balanceados em empresas ligadas a commodities e as expostas ao consumo doméstico, com expectativa de crescimento acima do mercado, potencial de consolidação e bem posicionadas para os desafios que temos pela frente. Sobre a performance dos diferentes setores, permanece a dinâmica de grandes disparidades de comportamento entre eles. Apesar disso, vale destacar aqueles que podem continuar com bons resultados neste ambiente de transição de pandemia para normalidade, como Saúde, Bens de Capital, Papel & Celulose e Telecom & Tecnologia. Na ponta contrária ficam setores que se valorizaram bastante recentemente mas podem apresentar dificuldades neste ambiente, como Bancos, Serviços Públicos, Consumo e Shoppings & Properties.

### RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	JANEIRO	2021	12 MESES	24 MESES	36 MESES
S&P 500 USD	-1,11%	-1,11%	15,15%	37,36%	31,53%
MSCI WORLD USD	-1,05%	-1,05%	13,63%	31,22%	20,26%
IDIV11	-5,08%	-5,08%	-4,52%	21,27%	43,95%
PTAXV	5,37%	5,37%	28,26%	49,95%	73,16%
CDI	0,15%	0,15%	2,54%	8,47%	15,40%
IBOVESPA	-3,32%	-3,32%	1,15%	18,15%	35,51%
SMLL	-3,43%	-3,43%	-4,50%	38,71%	57,28%
IBRX100	-3,03%	-3,03%	1,64%	20,92%	39,53%



## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

#### 2.1 SALDOS E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS – FPREV – EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 379.987.948,55	R\$ 377.889.065,09	0,8479	2,3790	(0,5523)	2,6768%	-0,5523%	4,0039%
BB PREVID TP VII	R\$ 7.057.946,27	R\$ 7.078.188,15	1,1687	1,2064	0,2867	2,6827%	0,2867%	5,7063%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 176.978.311,48	R\$ 177.279.358,66	1,3400	1,5256	0,1769	3,0680%	0,1769%	NC
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.002.164,94	R\$ 2.005.092,35	0,1200	0,1800	0,1500	0,4507%	0,1500%	1,9429%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 54.731.103,21	R\$ 54.641.479,49	1,5500	2,5300	(0,1600)	3,9526%	-0,1600%	5,2836%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 524.472.731,59	R\$ 507.308.881,01	1,2878	1,8198	0,0832	3,2168%	0,0832%	7,2530%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 528.628.824,97	R\$ 528.762.520,96	0,8200	1,3207	0,0253	2,1774%	0,0253%	5,8244%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 27.808.969,52	R\$ 27.905.092,33	1,3700	2,3700	0,3500	4,1357%	0,3500%	6,9571%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.849.311,66	R\$ 78.896.794,63	1,3000	1,8100	0,0600	3,1954%	0,0600%	7,1002%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 94.808.812,56	R\$ 93.172.991,55	2,5500	7,5000	(1,7300)	8,3341%	-1,7300%	3,2726%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 64.313.182,31	R\$ 21.103,41	0,1000	0,2000	0,1339	0,4345%	0,1339%	2,6453%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 60.799.000,01	R\$ 59.784.428,75	2,1649	5,5614	(1,6700)	6,0456%	-1,6700%	5,4302%
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 2.000.438.307,07</b>	<b>R\$ 1.914.744.996,38</b>						
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 44.046.955,17	R\$ 46.203.995,78	8,6135	1,0937	4,8971	15,1785%	4,8971%	NC
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 105.039.692,39	R\$ 126.523.666,69	16,9752	10,7189	(5,5863)	22,2786%	-5,5863%	1,5208%
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 70.397.488,98	R\$ 73.979.497,64	2,1010	0,6824	5,0882	8,0283%	5,0882%	NC
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 128.292.874,16	R\$ 165.158.915,00	8,4500	8,6100	(2,6700)	14,6426%	-2,6700%	NC
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 34.706.335,56	R\$ 59.277.904,60	13,6600	9,4300	(3,3100)	20,2612%	-3,3100%	1,4258%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 314.079.521,52	R\$ 331.973.171,94	8,6796	5,2345	0,6156	15,0725%	0,6156%	11,8832%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ -	R\$ 9.455.562,33	-	-	(3,5900)	NC	-3,5900%	NC
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.569.463,88	R\$ 5.560.220,69	(0,6644)	(0,7242)	(0,1700)	-1,5514%	-0,1700%	NC
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 95.218.278,37	R\$ 93.909.405,04	8,6332	4,8862	(1,3746)	12,3750%	-1,3746%	-5,1446%
ICATU VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ 27.767.520,90	R\$ -	14,8600	9,2800	-	25,5190%	0,0000%	5,6634%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 244.961.155,29	R\$ 206.061.428,93	13,5800	7,9600	(3,9200)	17,8142%	-3,9200%	-13,5313%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 172.274.057,48	R\$ 169.751.964,95	12,2800	6,3000	(1,4600)	17,6111%	-1,4600%	-3,6873%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 10.665.485,89	R\$ 10.416.300,97	13,7500	8,3700	(2,3400)	20,3863%	-2,3400%	-0,9135%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 127.693.596,92	R\$ 123.982.617,43	13,9200	7,9700	(2,9100)	19,4201%	-2,9100%	-24,6153%
ITAÚ SMALL CAPS VALUATION	R\$ 55.061.046,42	R\$ 53.778.389,48	14,9700	7,5200	(2,3300)	20,7355%	-2,3300%	-6,0294%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 72.548.595,13	R\$ 15.049,63	12,6315	7,6133	(3,0560)	17,5023%	-3,0560%	-8,3471%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 104.192.666,47	R\$ 72.471.225,08	13,4405	7,4312	(3,4551)	17,6597%	-3,4551%	-8,0505%
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 48.825.960,46	R\$ 47.345.349,71	12,6529	7,6224	(3,0324)	17,5632%	-3,0324%	-8,3252%
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 61.275.973,24	R\$ 64.730.268,06	4,3578	0,4756	5,6373	10,7651%	5,6373%	NC
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 21.663.161,65	R\$ 21.625.095,96	10,5849	3,0680	(0,1800)	13,7726%	-0,1800%	11,9519%
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 95.089.603,00	R\$ 98.655.799,60	2,4433	0,3469	3,7500	6,6536%	3,7500%	NC
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 84.713.090,08	R\$ 83.092.044,72	11,6500	6,9300	(1,9100)	17,1070%	-1,9100%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$ 104.020.515,68	R\$ 127.942.152,42	11,8900	10,1100	(3,1300)	19,3459%	-3,1300%	NC
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 33.658.143,72	R\$ 32.562.417,00	12,9328	7,6962	(3,2555)	17,6650%	-3,2555%	NC
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 2.061.761.182,36</b>	<b>R\$ 2.024.472.443,65</b>						
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 4.062.199.489,43</b>	<b>R\$ 3.939.217.440,03</b>						

Quadro 1.

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


  
 7

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

**Nota 2:** Com base na Ata COMIV 170/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV, direcionando os novos recursos para o fundo CAIXA FI BRASIL IMA B5, BTG Economia Real FIP, Icatu Vanguarda Ações IBX FI e Santander FI Seleção TOP Ações;

**Nota 3:** De acordo com o Parecer nº. 1133/2020-COMIV, registra-se que para o desinvestimento das aplicações, visando cumprir os termos da LC 206/2020 – FTEMP, em janeiro/20, foram utilizados os recursos aplicados no fundo Itaú alocação Dinâmica e Caixa FI BRASIL IMA-B 5.

**Nota 4:** Os recursos dos fundos Itaú alocação Dinâmica e Caixa FI BRASIL IMA-B 5 foram utilizados para o pagamento da folha mensal de aposentados do FPREV Executivo.

### 2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	nov/20	dez/20	jan/21
BRADERCO	R\$ 173.284.628,57	R\$ 165.001.374,66	R\$ 226.441.911,95
BANCO DO BRASIL	R\$ 760.811.954,99	R\$ 783.508.342,84	R\$ 808.953.772,01
CAIXA	R\$ 1.054.306.287,67	R\$ 1.203.050.938,14	R\$ 1.184.622.286,50
ITAÚ	R\$ 581.627.672,62	R\$ 430.007.369,02	R\$ 357.950.376,24
SANTANDER	R\$ 270.755.240,84	R\$ 286.843.195,30	R\$ 184.561.892,48
ICATU	R\$ 445.102.257,17	R\$ 474.195.769,93	R\$ 406.036.307,44
SAFRA	R\$ 173.375.055,84	R\$ 177.551.764,66	R\$ 180.065.324,31
BTG PACTUAL	R\$ 304.067.001,40	R\$ 319.648.985,40	R\$ 346.988.954,96
AZ QUEST	R\$ 79.225.665,18	R\$ 84.713.090,08	R\$ 83.092.044,72
OCCAM BRASIL	R\$ 94.470.410,26	R\$ 104.020.515,68	R\$ 127.942.152,42
SULAMÉRICA	R\$ 31.252.849,09	R\$ 33.658.143,72	R\$ 32.562.417,00
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 3.968.279.023,63</b>	<b>R\$ 4.062.199.489,43</b>	<b>R\$ 3.939.217.440,03</b>

Quadro 2.

# Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

## DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC JANEIRO- 2021

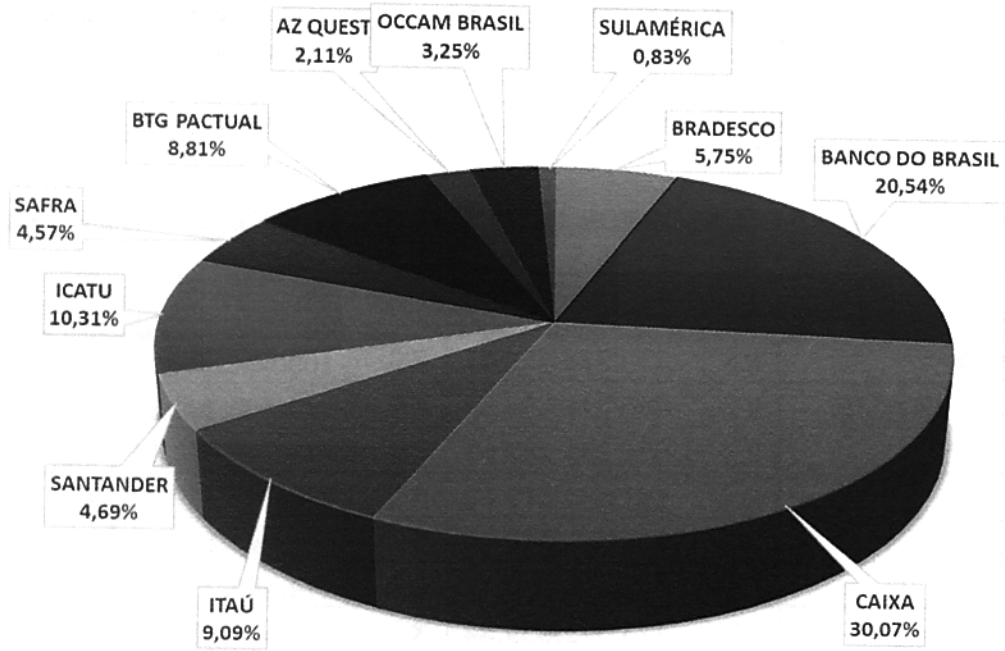


Gráfico 1

*[Handwritten signatures and initials]*



## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA – FPREV EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO POR FUNDO	SALDO APLICADO	% APLICADO
BRADESCO FI MAXI PODER PUBLICO	CDI	R\$ 2.005.092,35	R\$ 2.005.092,35	0,05%
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	CDI ATIVO	R\$ 528.762.520,96	R\$ 928.297.785,42	23,57%
BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA		R\$ 377.889.065,09		
SAFRA S&P REAIS		R\$ 21.625.095,96		
BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA		R\$ -		
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI		R\$ 21.103,41		
BB PREVID IDKA 2	IDKA 2	R\$ 177.279.358,66	R\$ 177.279.358,66	4,50%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CP	IMA B 5	R\$ 27.905.092,33	R\$ 614.110.767,97	15,59%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF		R\$ 78.896.794,63		
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	IMA B5+	R\$ 93.172.991,55	R\$ 93.172.991,55	2,37%
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	IPCA + 6%	R\$ -	R\$ 67.279.888,33	1,71%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF		R\$ 54.641.479,49		
BTG ECONOMIA REAL FIP		R\$ 5.560.220,69		
BB PREVID TP VII		R\$ 7.078.188,15		
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	IBR X	R\$ 59.277.904,60	R\$ 59.277.904,60	1,50%
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI		R\$ -		
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	IBOVESPA	R\$ 126.523.666,69	R\$ 1.654.439.661,32	42,00%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS		R\$ 165.158.915,00		
ITAÚ SMALL CAPS VALUATION		R\$ 53.778.389,48		
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES		R\$ 93.909.405,04		
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		R\$ 206.061.428,93		
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC		R\$ 169.751.964,95		
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA		R\$ 10.416.300,97		
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI		R\$ 123.982.617,43		
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES		R\$ 15.049,63		
BTG ABSOLUTO FIQ FIA		R\$ 331.973.171,94		
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES		R\$ 72.471.225,08		
SANTANDER SELEÇÃO 30		R\$ 47.345.349,71		
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA		R\$ 83.092.044,72		
OCCAM FIC FIA		R\$ 127.942.152,42		
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES		R\$ 9.455.562,33		
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES		R\$ 32.562.417,00		
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	BDR	R\$ 98.655.799,60	R\$ 172.635.297,24	4,38%
BB FIA BDR NIVEL I		R\$ 73.979.497,64		
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	MSCI	R\$ 64.730.268,06	R\$ 110.934.263,84	2,82%
BB MM GLOBAL SELECT		R\$ 46.203.995,78		
<b>TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO</b>		<b>R\$ 3.939.217.440,03</b>	<b>R\$ 3.939.217.440,03</b>	<b>100%</b>

Quadro 3.

DISTRIBUIÇÃO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA - FPREV EXECUTIVO

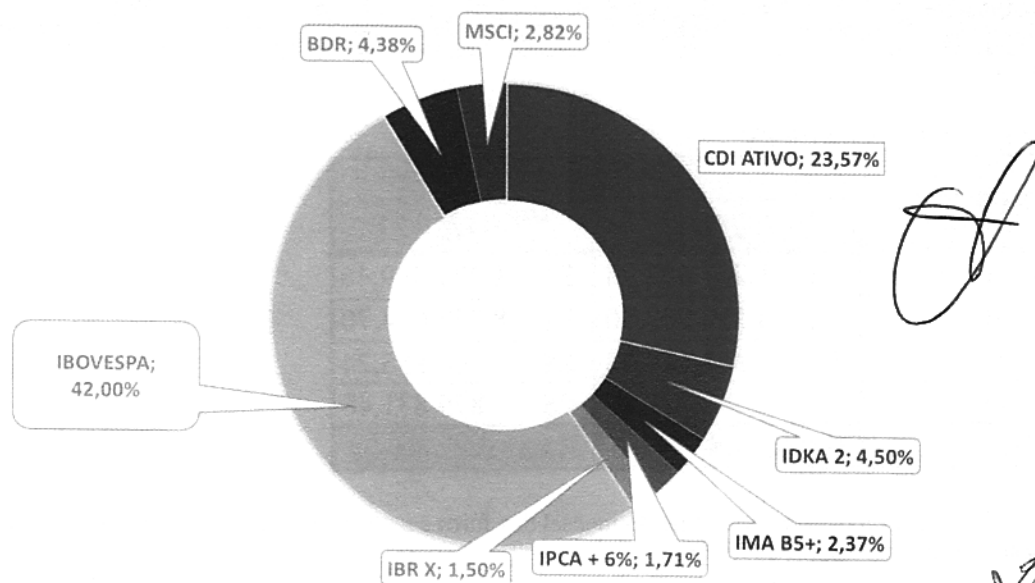


Gráfico 2.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 160.775.707,36	R\$ 162.023.178,29	1,4193	1,8817	0,7759	4,129%	0,7759%	11,3345%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 167.508.536,39	R\$ 168.824.066,80	1,4288	1,8912	0,7854	4,159%	0,7854%	11,4597%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 171.550.222,13	R\$ 172.938.016,99	1,4525	1,9151	0,8090	4,232%	0,8090%	11,7736%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 173.675.502,75	R\$ 175.039.492,87	1,4288	1,8912	0,7854	4,159%	0,7854%	11,4599%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 673.509.968,62</b>	<b>R\$ 678.824.754,95</b>						

Quadro 4.

Nota 1: Títulos Públicos atualizados pelo valor de aquisição acrescido da taxa de juros. (Ver quadro 5).

### 2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
TIPO DE ATIVO	NTN B	NTN B	NTN B	NTN B
INTERMEDIÁRIO	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\$ 162.023.178,29	R\$ 168.824.066,80	R\$ 172.938.016,99	R\$ 175.039.492,87
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 5.

### 2.7 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	31/12/2020	29/01/2021
CVS - A	R\$ 1.257.452,78	R\$ 1.239.999,46
CVS - B	R\$ 8.136.002,50	R\$ 8.023.024,70
CVS - C	R\$ 163.119,32	R\$ 160.855,24
CVS - D	R\$ 892.221,00	R\$ 879.831,48
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 10.448.795,60</b>	<b>R\$ 10.303.710,88</b>

Quadro 6.

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.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 2.8 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/21	R\$ 30.247,09	R\$ 145.084,72	R\$ 175.331,81
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 30.247,09</b>	<b>R\$ 145.084,72</b>	<b>R\$ 175.331,81</b>

FONTE COFIN / COMV - Relatório CETIP.

Quadro 7.

### 2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

#### RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2021 (Contrato Regular)

MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>	<b>R\$ -</b>

FONTE COMAP/GERAF

Quadro 8.

### 2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	31/12/2020	29/01/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.062.199.489,43	R\$ 3.939.217.440,03	83,9625%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 673.509.968,62	R\$ 678.824.754,95	14,4688%
TÍTULOS CVS	R\$ 10.448.795,60	R\$ 10.303.710,88	0,2196%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 61.835.325,18	1,3180%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 6.430,28	R\$ 1.457.381,31	0,0311%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.808.000.009,11</b>	<b>R\$ 4.691.638.612,35</b>	<b>100,00%</b>

Quadro 9.

Nota: Atualizados os valores dos Imóveis, com base em avaliação realizada pela SEINFRA.

### 2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
fev/20	R\$ 5.147.828.344,11	-1,30%	-0,51%	22,61%
mar/20	R\$ 4.677.866.125,22	-9,13%	-9,59%	9,54%
abr/20	R\$ 4.755.324.126,81	1,66%	-8,09%	9,55%
mai/20	R\$ 4.808.084.982,84	1,11%	-7,07%	8,26%
jun/20	R\$ 4.837.475.067,57	0,61%	-6,50%	6,07%
jul/20	R\$ 4.902.116.484,95	1,34%	-5,25%	5,41%
ago/20	R\$ 4.797.635.488,57	-2,13%	-7,27%	2,10%
set/20	R\$ 4.651.365.387,53	-3,05%	-10,10%	-3,39%
out/20	R\$ 4.549.328.612,79	-2,19%	-12,07%	-7,68%
nov/20	R\$ 4.700.643.285,36	3,33%	-9,15%	-5,39%
dez/20	R\$ 4.808.000.009,11	2,28%	-7,07%	-7,07%
<b>jan/21</b>	<b>R\$ 4.691.638.612,35</b>	<b>-2,42%</b>	<b>-2,42%</b>	<b>-8,75%</b>

Quadro 10.

# Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

## 2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Curitiba, 23 de fevereiro de 2021.

Cliente: GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do(a) **Executivo** para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 31/01/2021.

### 1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 01/2020		RS 5.215.753.953,85	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2020	RS 49.583.021,72	RS 4.910.443,54	RS 44.672.578,18
03/2020	RS 44.294.358,68	RS 12.998.534,20	RS 31.295.824,48
04/2020	RS 41.873.777,81	RS 100.097.233,40	RS -58.223.455,59
05/2020	RS 40.614.112,23	RS 116.393.805,63	RS -75.779.693,40
06/2020	RS 32.820.094,52	RS 156.602.317,41	RS -123.782.222,89
07/2020	RS 33.058.400,54	RS 124.266.927,34	RS -91.208.526,80
08/2020	RS 39.455.936,02	RS 99.107.615,94	RS -59.651.679,92
09/2020	RS 39.934.090,22	RS 109.739.936,23	RS -69.805.846,01
10/2020	RS 38.961.921,68	RS 112.188.198,10	RS -73.226.276,42
11/2020	RS 39.697.646,11	RS 116.368.518,74	RS -76.670.872,63
12/2020	RS 117.527.713,10	RS 175.934.562,52	RS -58.406.849,42
01/2021	RS 584.012,31	RS 82.104.528,71	RS -81.520.516,40
Saldo dos Investimentos em 01/2021		RS 4.691.638.612,35	

### 1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5591 %	0,2500 %	0,2500 %
Juros	5,4500 %	0,4432 %	0,4432 %
Meta	10,2575 %	0,6943 %	0,6943 %
Rentabilidade em %	3,3713 %	-0,7246 %	-0,7246 %
Rentabilidade em R\$	RS 168.192.195,32	RS -34.840.880,36	RS -34.840.880,36
Resultado em %	-6,2456 %	-1,4092 %	-1,4092 %
Resultado em R\$	RS -343.979.485,64	RS -68.223.301,70	RS -68.223.301,70

Quadro 11.

**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.

**Nota 2:** As **Despesas** foram revisadas, os valores referentes aos pagamentos mensais da folha para o FTEMP, a partir de abril/2020, foram atualizados com base nos Controles da GERA/COFIN.

**Nota 3:** O valor da receita em janeiro/2021 está abaixo da média mensal, pois foi antecipada e arrecadada em dezembro/2020.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 2.13 ACOMPANHAMENTO DE SALDO DO FTEMP

ACOMPANHAMENTO DO SALDO DO FUNDO TEMPORÁRIO - FTEMP						
REFERÊNCIA	APOSENTADO	1º PARC.13º SALÁRIO APOSENTADO	PENSIONISTA	1º PARC.13º SALÁRIO PENSIONISTA	TOTAL	SALDO DISPONÍVEL DO FUNDO TEMPORÁRIO (FTEMP)
<b>SALDO INICIAL FTEMP (*)</b>						<b>R\$ 1.088.777.939,69</b>
ABRIL	R\$ 66.682.153,93	-	R\$ 20.836.497,85	-	R\$ 87.518.651,78	R\$ 1.001.259.287,91
MAIO	R\$ 69.474.585,75	-	R\$ 23.937.393,92	-	R\$ 93.411.979,67	R\$ 907.847.308,24
JUNHO	R\$ 79.927.863,30	R\$ 32.729.732,84	R\$ 23.706.524,79	R\$ 13.105.929,44	R\$ 149.470.050,37	R\$ 758.377.257,87
JULHO	R\$ 78.896.538,13		R\$ 23.547.513,10		R\$ 102.444.051,23	R\$ 655.933.206,64
AGOSTO	R\$ 74.224.569,83		R\$ 24.139.168,43		R\$ 98.363.738,26	R\$ 557.569.468,38
SETEMBRO	R\$ 74.267.885,85		R\$ 24.257.910,92		R\$ 98.525.796,77	R\$ 459.043.671,61
OUTUBRO	R\$ 76.164.446,64		R\$ 24.936.928,36		R\$ 101.101.375,00	R\$ 357.942.296,61
NOVEMBRO	R\$ 75.776.269,96		R\$ 25.170.897,70		R\$ 100.947.167,66	R\$ 256.995.128,95
DEZEMBRO	R\$ 73.203.615,51	R\$ 45.076.534,62	R\$ 25.329.272,04	R\$ 10.486.907,93	R\$ 154.096.330,10	R\$ 102.898.798,85
JANEIRO21	R\$ 45.588.078,51		R\$ 26.148.678,64		R\$ 71.736.757,15	R\$ 31.162.041,70
<b>TOTAL ACUMULADO</b>					<b>R\$ 1.057.615.897,99</b>	

Quadro 12

Nota: Tabela atualizada com base nos Controles da GERAF/COFIN.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.187.064,37	R\$ 5.188.376,23	0,8200	1,3207	0,0253	2,1774%	0,0253%	5,8244%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 87.142,63	R\$ 87.259,34	0,1000	0,2000	0,1339	0,4345%	0,1339%	2,6496%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 1.942.019,49	R\$ 1.948.732,15	1,3700	2,3700	0,3457	4,1312%	0,3457%	6,9524%
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 7.216.226,49</b>	<b>R\$ 7.224.367,72</b>						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 540.518,31	R\$ 519.347,06	13,5800	7,9600	(3,9168)	17,8181%	3,9168%	-13,5284%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.609.171,51	R\$ 1.599.265,80	8,6796	5,2345	(0,6156)	13,6644%	-0,6156%	NC
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 234.097,57	R\$ 507.202,10	8,6332	4,8862	(1,3746)	12,3750%	-1,3746%	-5,1446%
OCCAM FIC FIA	R\$ 2.143.051,03	R\$ 2.076.040,01	11,8900	10,1100	(3,1300)	19,3459%	-3,1300%	NC
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.136.353,54	R\$ 1.178.970,83	2,4400	0,3500	3,7500	6,6535%	3,7500%	NC
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 5.663.191,96</b>	<b>R\$ 5.880.825,80</b>						

TOTAL GERAL	R\$ 12.879.418,45	R\$ 13.105.193,52
-------------	-------------------	-------------------

Quadro 13.

Nota: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo Caixa Consumo.

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

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.287.483,14	R\$ 2.305.447,91	1,428769	1,891225	0,785400	4,1587%	0,7854%	11,4598%
<b>TOTAL GERAL</b>	<b>R\$ 2.287.483,14</b>	<b>R\$ 2.305.447,91</b>						

Quadro 14.

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

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	31/12/2020	29/01/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 12.879.418,45	R\$ 13.105.193,52
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.287.483,14	R\$ 2.305.447,91
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 15.166.901,59</b>	<b>R\$ 15.410.641,43</b>

Quadro 15.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 3.4 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
fev/20	R\$ 12.745.197,26	0,41%	2,86%	24,93%
mar/20	R\$ 12.694.389,88	-0,40%	2,45%	22,39%
abr/20	R\$ 12.933.067,87	1,88%	4,37%	15,66%
mai/20	R\$ 13.078.781,12	1,13%	5,55%	19,91%
jun/20	R\$ 13.459.597,92	2,91%	8,62%	20,10%
jul/20	R\$ 13.732.461,93	2,03%	10,83%	20,74%
ago/20	R\$ 13.805.725,52	0,53%	11,42%	20,51%
set/20	R\$ 13.772.193,11	-0,24%	11,15%	16,97%
out/20	R\$ 13.874.434,26	0,74%	11,97%	15,45%
nov/20	R\$ 14.548.050,57	4,86%	17,41%	19,73%
dez/20	R\$ 15.166.901,59	4,25%	22,40%	22,40%
<b>jan/21</b>	<b>R\$ 15.410.641,43</b>	<b>1,61%</b>	<b>1,61%</b>	<b>21,00%</b>

Quadro 16.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Curitiba, 10 de fevereiro de 2021.

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do **Assembléia** para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 31/01/2021.

#### 1.1 Investimentos

	Saldo dos Investimentos em 01/2020	RS 12.693.470,60	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
02/2020	R\$ 116.166,02	R\$ 0,00	R\$ 116.166,02
03/2020	R\$ 116.289,97	R\$ 0,00	R\$ 116.289,97
04/2020	R\$ 119.283,88	R\$ 0,00	R\$ 119.283,88
05/2020	R\$ 119.498,47	R\$ 0,00	R\$ 119.498,47
06/2020	R\$ 118.639,37	R\$ 0,00	R\$ 118.639,37
07/2020	R\$ 118.639,37	R\$ 0,00	R\$ 118.639,37
08/2020	R\$ 154.104,87	R\$ 0,00	R\$ 154.104,87
09/2020	R\$ 170.237,76	R\$ 0,00	R\$ 170.237,76
10/2020	R\$ 143.453,76	R\$ 0,00	R\$ 143.453,76
11/2020	R\$ 143.747,84	R\$ 0,00	R\$ 143.747,84
12/2020	R\$ 133.342,71	R\$ 0,00	R\$ 133.342,71
01/2021	R\$ 286.790,86	R\$ 0,00	R\$ 286.790,86
	<b>Saldo dos Investimentos em 01/2021</b>		<b>RS 15.410.641,43</b>

#### 1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5591 %	0,2500 %	0,2500 %
Juros	5,4500 %	0,4432 %	0,4432 %
Meta	10,2575 %	0,6943 %	0,6943 %
Rentabilidade em %	7,3034 %	-0,2838 %	-0,2838 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 976.975,95	R\$ -43.051,02	R\$ -43.051,02
Resultado em %	-2,6793 %	-0,9714 %	-0,9714 %
Resultado em R\$	R\$ -394.813,94	R\$ -148.356,32	R\$ -148.356,32

Quadro 17.



## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.687.666,70	R\$ 7.689.610,99	0,8200	1,3207	0,0253	2,1774%	0,0253%	NC
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 50.875.562,47	R\$ 40.570.408,48	0,7800	2,4800	(0,5800)	2,6803%	-0,5800%	4,0486%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 99.257.819,70	R\$ 98.709.563,90	0,8479	2,3790	(0,5523)	2,6768%	-0,5523%	4,4043%
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 157.821.048,87</b>	<b>R\$ 146.969.583,37</b>						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRDESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 11.421.162,23	R\$ 23.301.328,09	13,6600	9,4300	(3,3100)	20,2612%	-3,3100%	NC
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 11.421.162,23</b>	<b>R\$ 23.301.328,09</b>						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 3.002,10	R\$ 6.426,30
<b>TOTAL RECURSOS</b>	<b>R\$ 169.245.213,20</b>	<b>R\$ 170.277.337,76</b>

Quadro 18.

**Nota 1:** Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo IBRX Alpha.

**Nota 2:** Foi resgatado o montante de R\$ 10.000.000,00 do Fundo Bradesco Alocação Dinâmica RF e aplicado no Fundo Bradesco FIC FIA Institucional IBRX ALPHA.

# Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

## 4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



Curitiba, 10 de fevereiro de 2021.

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do **Ministério Público** para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 31/01/2021.

### 1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 01/2020		RS 145.692.642,00	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
02/2020	RS 1.490.511,62	RS 15.618,19	RS 1.474.893,43
03/2020	RS 1.275.904,25	RS 16.735,98	RS 1.259.168,27
04/2020	RS 1.268.670,97	RS 10.639,28	RS 1.258.031,69
05/2020	RS 1.482.380,96	RS 0,00	RS 1.482.380,96
06/2020	RS 1.273.507,14	RS 10.584,16	RS 1.262.922,98
07/2020	RS 1.272.066,06	RS 11.829,88	RS 1.260.236,18
08/2020	RS 1.482.857,02	RS 9.164,74	RS 1.473.692,28
09/2020	RS 1.514.681,38	RS 7.663,69	RS 1.507.017,69
10/2020	RS 1.490.094,20	RS 9.164,74	RS 1.480.929,46
11/2020	RS 1.503.550,04	RS 9.164,74	RS 1.494.385,30
12/2020	RS 1.579.792,66	RS 12.799,56	RS 1.566.993,10
01/2021	RS 3.008.450,20	RS 642,69	RS 3.007.807,51
Saldo dos Investimentos em 01/2021		RS 170.277.337,76	

### 1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5591 %	0,2500 %	0,2500 %
Juros	5,4500 %	0,4432 %	0,4432 %
Meta	10,2575 %	0,6943 %	0,6943 %
Rentabilidade em %	3,9530 %	-1,1656 %	-1,1656 %
Rentabilidade em RS	RS 6.056.236,91	RS -1.972.680,85	RS -1.972.680,85
Resultado em %	-5,7180 %	-1,8471 %	-1,8471 %
Resultado em RS	RS -9.650.449,12	RS -3.147.746,32	RS -3.147.746,32

Quadro 19

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 6.861.925,55	R\$ 6.863.660,99	0,8200	1,3207	0,0253	2,1774%	0,0253%	NC
BRADESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.655.092,79	R\$ 8.604.956,06	0,7800	2,4800	(0,5800)	2,6803%	-0,5800%	5,4512%
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.810.995,35	R\$ 9.721.053,40	1,3000	1,7800	(0,0200)	3,0825%	-0,0200%	5,3546%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 16.819,87						
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 25.328.013,69</b>	<b>R\$ 25.206.490,32</b>						

Quadro 20.

# Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

## 5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Curitiba, 10 de fevereiro de 2021.

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do **Defensoria** para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 31/01/2021.

### 1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 01/2020		R\$ 12.521.705,54	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2020	R\$ 814.914,53	R\$ 0,00	R\$ 814.914,53
03/2020	R\$ 810.969,30	R\$ 0,00	R\$ 810.969,30
04/2020	R\$ 818.197,74	R\$ 0,00	R\$ 818.197,74
05/2020	R\$ 954.963,10	R\$ 0,00	R\$ 954.963,10
06/2020	R\$ 808.818,93	R\$ 0,00	R\$ 808.818,93
07/2020	R\$ 809.559,37	R\$ 0,00	R\$ 809.559,37
08/2020	R\$ 951.659,78	R\$ 0,00	R\$ 951.659,78
09/2020	R\$ 950.378,64	R\$ 0,00	R\$ 950.378,64
10/2020	R\$ 952.657,42	R\$ 0,00	R\$ 952.657,42
11/2020	R\$ 969.890,42	R\$ 19.728,47	R\$ 950.161,95
12/2020	R\$ 2.981.491,21	R\$ 92.070,31	R\$ 2.889.420,90
01/2021	R\$ 6.283,41	R\$ 77.294,71	R\$ -71.011,30
Saldo dos Investimentos em 01/2021		R\$ 25.189.670,45	

### 1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5591 %	0,2500 %	0,2500 %
Juros	5,4500 %	0,4432 %	0,4432 %
Meta	10,2575 %	0,6943 %	0,6943 %
Rentabilidade em %	5,9151 %	-0,2658 %	-0,2658 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.027.274,55	R\$ -67.331,94	R\$ -67.331,94
Resultado em %	-3,9385 %	-0,9535 %	-0,9535 %
Resultado em R\$	R\$ -750.227,64	R\$ -243.186,85	R\$ -243.186,85

Quadro 21.

Nota 3: O valor da receita em janeiro/2021 está abaixo da média mensal, pois foi antecipada e arrecadada em dezembro/2020.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 204.221.045,98	R\$ 204.272.695,73	0,8200	1,3207	0,0253	2,1774%	0,0253%	NC
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.803.450,40	R\$ 51.517.311,31	0,8479	2,3790	(0,5523)	2,6768%	-0,5523%	NC
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 140.197.967,29	R\$ 140.446.104,72	1,3400	1,5256	0,1769	3,0680%	0,1769%	NC
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 43.418.042,67	R\$ 43.108.294,32	1,3000	2,4800	(0,0200)	3,7915%	-0,0200%	7,9686%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINAMICA RF	R\$ 1.454.629,62	R\$ -	0,7800	1,7800	-	2,5739%	0,0000%	NC
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 441.095.135,96</b>	<b>R\$ 439.344.406,08</b>						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 10.436.196,24	R\$ 10.292.739,97	8,6332	4,8860	(1,3746)	12,3748%	-1,3746%	NC
BRDESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ -	R\$ 3.019.524,85	-	-	(3,3100)	-3,3100%	-3,3100%	NC
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 10.436.196,24</b>	<b>R\$ 13.312.264,82</b>						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1.764.244,09
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 451.531.332,20</b>	<b>R\$ 454.420.914,99</b>

Quadro 22.

**Nota 1:** Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo Bradesco IBRX Alpha.

**Nota 2:** Foi resgatado o montante de R\$ 1.440.329,27 do Fundo Bradesco Alocação Dinâmica RF e aplicado no Fundo Bradesco FIC FIA Institucional IBRX ALPHA.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



Curitiba, 10 de fevereiro de 2021.

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do **Tribunal de Justiça** para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 31/01/2021.

#### 1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 01/2020		R\$ 24.502.808,11	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2020	R\$ 2.546.041,07	R\$ 248.112,69	R\$ 2.297.928,38
03/2020	R\$ 2.647.202,34	R\$ 269.053,00	R\$ 2.378.149,34
04/2020	R\$ 3.365.431,19	R\$ 341.730,86	R\$ 3.023.700,33
05/2020	R\$ 5.222.844,03	R\$ 280.083,57	R\$ 4.942.760,46
06/2020	R\$ 2.652.044,89	R\$ 345.842,60	R\$ 2.306.202,29
07/2020	R\$ 3.093.956,95	R\$ 155.165,84	R\$ 2.938.791,11
08/2020	R\$ 3.115.630,27	R\$ 491.741,78	R\$ 2.623.888,49
09/2020	R\$ 381.166.785,90	R\$ 305.986,37	R\$ 380.860.799,53
10/2020	R\$ 3.325.215,77	R\$ 305.986,37	R\$ 3.019.229,40
11/2020	R\$ 3.555.836,55	R\$ 303.719,14	R\$ 3.252.117,41
12/2020	R\$ 6.779.546,58	R\$ 408.928,65	R\$ 6.370.617,93
01/2021	R\$ 3.459.800,94	R\$ 280.567,30	R\$ 3.179.233,64
Saldo dos Investimentos em 01/2021		R\$ 449.401.390,14	

#### 1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5591 %	0,2500 %	0,2500 %
Juros	5,4500 %	0,4432 %	0,4432 %
Meta	10,2575 %	0,6943 %	0,6943 %
Rentabilidade em %	4,6759 %	-1,1758 %	-1,1758 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 7.705.163,72	R\$ -5.309.175,70	R\$ -5.309.175,70
Resultado em %	-5,0624 %	-1,8572 %	-1,8572 %
Resultado em R\$	R\$ -8.959.251,44	R\$ -8.444.202,56	R\$ -8.444.202,56

Quadro 23.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 42.064.656,38	R\$ 42.075.295,01	0,8200	1,3207	0,0253	2,1774%	0,0253%	NC	
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ -	R\$ 30.140.100,99	0,2156	-	0,1769	0,3588%	0,8320%	NC	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.803.450,40	R\$ 21.390.569,80	0,8479	2,3790	(0,5523)	2,6768%	-0,5523%	NC	
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.577.359,82	R\$ 7.575.834,35	1,3000	1,7800	(0,0200)	3,0825%	-0,0200%	7,2311%	
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 101.445.466,60</b>	<b>R\$ 101.181.800,15</b>							

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 10.436.196,24	R\$ 10.292.739,97	8,6332	4,8862	(1,3746)	12,3750%	-1,3746%	NC	
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 10.436.196,24</b>	<b>R\$ 10.292.739,97</b>							
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 7.943,52							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 111.881.662,84</b>	<b>R\$ 111.482.483,64</b>							

Quadro 24.

Nota: Foi resgatado o montante de R\$ 30.000.000,00 BB Previdenciário RF Alocação Ativa e aplicado no fundo BB Previdenciário RF IDKA 2.

# Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

## 7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



Curitiba, 10 de fevereiro de 2021.

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do **Tribunal de Contas** para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 31/01/2021.

### 1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 01/2020		R\$ 4.223.440,38	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
02/2020	R\$ 445.775,50	R\$ 0,00	R\$ 445.775,50
03/2020	R\$ 245.127,45	R\$ 0,00	R\$ 245.127,45
04/2020	R\$ 770.472,25	R\$ 0,00	R\$ 770.472,25
05/2020	R\$ 446.927,24	R\$ 0,00	R\$ 446.927,24
06/2020	R\$ 447.429,30	R\$ 0,00	R\$ 447.429,30
07/2020	R\$ 522.267,78	R\$ 0,00	R\$ 522.267,78
08/2020	R\$ 522.585,60	R\$ 0,00	R\$ 522.585,60
09/2020	R\$ 99.120.333,45	R\$ 0,00	R\$ 99.120.333,45
10/2020	R\$ 521.775,18	R\$ 0,00	R\$ 521.775,18
11/2020	R\$ 1.032.124,86	R\$ 0,00	R\$ 1.032.124,86
12/2020	R\$ 521.263,88	R\$ 0,00	R\$ 521.263,88
01/2021	R\$ 7.943,52	R\$ 0,00	R\$ 7.943,52
Saldo dos Investimentos em 01/2021		R\$ 111.342.382,65	

### 1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %		Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês	
IPCA	4,5591 %	0,2500 %	0,2500 %	
Juros	5,4500 %	0,4432 %	0,4432 %	
Meta	10,2575 %	0,6943 %	0,6943 %	
Rentabilidade em %	6,4280 %	-0,4891 %	-0,4891 %	
Rentabilidade em R\$	R\$ 2.514.916,26	R\$ -547.223,71	R\$ -547.223,71	
Resultado em %	-3,4733 %	-1,1753 %	-1,1753 %	
Resultado em R\$	R\$ -1.456.985,37	R\$ -1.324.029,20	R\$ -1.324.029,20	

Quadro 25.

Nota: O valor da receita em janeiro/2021 está abaixo da média mensal, pois foi antecipada e arrecadada em dezembro/2020



# Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

## 8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV



Curitiba, 23 de fevereiro de 2021.

Cliente: GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do(a) CONSOLIDADO para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 31/01/2021.

### 1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 01/2020		RS 5.415.388.020,48	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
02/2020	RS 54.996.430,46	RS 5.174.174,42	RS 49.822.256,04
03/2020	RS 49.389.851,99	RS 13.284.323,18	RS 36.105.528,81
04/2020	RS 48.215.833,84	RS 100.449.603,54	RS -52.233.769,70
05/2020	RS 48.840.726,03	RS 116.673.889,20	RS -67.833.163,17
06/2020	RS 38.120.534,15	RS 156.958.744,17	RS -118.838.210,02
07/2020	RS 38.874.890,07	RS 124.433.923,06	RS -85.559.032,99
08/2020	RS 45.682.773,56	RS 99.608.522,46	RS -53.925.748,90
09/2020	RS 522.856.507,35	RS 110.053.586,29	RS 412.802.921,06
10/2020	RS 45.395.118,01	RS 112.503.349,21	RS -67.108.231,20
11/2020	RS 46.902.795,82	RS 116.701.131,09	RS -69.798.335,27
12/2020	RS 129.523.150,14	RS 176.448.361,04	RS -46.925.210,90
01/2021	RS 7.353.281,24	RS 82.463.033,41	RS -75.109.752,17
Saldo dos Investimentos em 01/2021		RS 5.463.260.034,78	

### 1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
Item	Em 12 meses	No ano	No mês
IPCA	4,5591 %	0,2500 %	0,2500 %
Juros	5,4500 %	0,4432 %	0,4432 %
Meta	10,2575 %	0,6943 %	0,6943 %
Rentabilidade em %	3,4675 %	-0,7665 %	-0,7665 %
Rentabilidade em R\$	RS 186.472.762,71	RS -42.780.343,58	RS -42.780.343,58
Resultado em %	-6,1583 %	-1,4508 %	-1,4508 %
Resultado em R\$	RS -365.191.213,15	RS -81.530.822,96	RS -81.530.822,96

Quadro 26.

**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:** As **Despesas** foram revisadas, os valores referentes aos pagamentos mensais da folha para o FTEMP, a partir de abril/2020, foram atualizados com base nos Controles da GERA/COFIN.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

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

#### 9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2020	29/01/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 56.320.916,20	R\$ 1.536.392,01
FUNDO BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 5.325.299,78	R\$ 5.294.451,70
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 34.817,75	R\$ 34.793,80
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 213.938,35	R\$ 218.117,79
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 9.966,16	R\$ 1,00
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 61.904.938,26</b>	<b>R\$ 7.083.756,32</b>

Quadro 27.

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

#### 9.2 Fundo Previdenciário Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2020	29/01/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 5.120.613,59	R\$ 4.327,77
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ 8.914.604,45	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ -	R\$ 1,00
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FTEMP	R\$ -	R\$ -
BRADESCO DI PREMIUM - FTEMP	R\$ 410.063,48	R\$ 13.347.623,72
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 504.124,99	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 14.949.406,51</b>	<b>R\$ 13.351.952,49</b>

Quadro 28.

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

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

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	31/12/2020	29/01/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 313.673,83	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 313.673,83</b>	<b>R\$ -</b>

Quadro 29.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2020	29/01/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 234.524,35	R\$ 402.320,23
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 2.075,42	R\$ 58.703,59
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 236.600,77</b>	<b>R\$ 461.024,82</b>

Quadro 30.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2020	29/01/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.141.738,91	R\$ 1.596.078,93
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 565.981,40	R\$ 1,00
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 1.707.720,31</b>	<b>R\$ 1.596.079,93</b>

Quadro 31.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2020	29/01/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 10.450.301,46	R\$ 8.433.786,43
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 10.450.301,46</b>	<b>R\$ 8.433.786,43</b>

Quadro 32.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	31/12/2020	29/01/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 7.545.184,36	R\$ 3.799.598,79
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 36.346,03
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 7.545.185,36</b>	<b>R\$ 3.835.944,82</b>

Quadro 33.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

#### 10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.930.353,60	R\$ 47.439,27	0,1200	0,1800	0,1500	0,4507%	0,1500%	1,9405%	
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 37.008.399,35	R\$ 37.017.759,17	0,8200	1,3207	0,0253	2,1774%	0,0253%	5,8244%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 38.938.753,95</b>	<b>R\$ 37.065.199,44</b>							

Quadro 34.

#### 10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.302.358,29	R\$ 1.359.549,05	0,1200	0,1800	0,1500	0,4507%	0,1500%	1,9405%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 1.302.358,29</b>	<b>R\$ 1.359.549,05</b>							

Quadro 35.

#### 10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 855.317,71	R\$ 856.568,30	0,1200	0,1800	0,1500	0,4507%	0,1500%	1,9405%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 40.154,37							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 855.317,71</b>	<b>R\$ 896.722,67</b>							

Quadro 36.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.875.237,11	R\$ 1.877.978,95	0,1200	0,1800	0,1500	0,4507%	0,1500%	1,9405%	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 1.875.237,11</b>	<b>R\$ 1.877.978,95</b>							

Quadro 37.

**Nota:** Transferido o valor de R\$ 1.000.000,00 (um milhão de reais) para a conta operacional dos recursos da Taxa de Administração (20.400-5 Bradesco) em 25/01/2021, para pagamento das despesas administrativas dessa Amazonprev.

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	31/12/2020	29/01/2021	nov/20	dez/20	jan/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 756.139,54	R\$ 757.245,11	0,1200	0,1800	0,1500	0,4507%	0,1500%	NC	
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -							
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 756.139,54</b>	<b>R\$ 757.245,11</b>							

Quadro 38.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 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 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TN	R\$ 681.130.202,87	12,45%	10,00%	100,00%	art 7º, inciso I, "a"
<b>TOTAL art. 7º, inciso I, "a"</b>	<b>R\$ 681.130.202,87</b>				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.078.188,15	36,21%	22,00%	100,00%	art 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 347.865.564,37				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 507.308.881,01				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 54.641.479,49				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 831.869.919,08				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.896.794,63				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 93.172.991,55				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 59.784.428,75	12,81%	13,00%	40,00%	art. 7º, inciso IV, "a"
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 22.676.377,19				
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.405.182,07				
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 54.469.816,24				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 549.506.510,10				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.362,75				
BRADERCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 13.347.623,72				
<b>TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"</b>	<b>R\$ 700.513.872,07</b>				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.853.824,48	0,55%	3,00%	5,00%	art 7º, inciso VII, "b"
<b>TOTAL art 7º, inciso VII, "b"</b>	<b>R\$ 29.853.824,48</b>				
<b>TOTAL RENDA FIXA</b>	<b>R\$ 3.392.116.146,45</b>	<b>62,02%</b>			

Quadro 39.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Variável

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA VARIÁVEL	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN n° 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BRDESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 85.598.757,54	1,57%	3,00%	30,00%	art 8º, inciso I, "a"
<b>TOTAL art 8º, inciso I, "a"</b>	<b>R\$ 85.598.757,54</b>				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 10.416.300,97	30,71%	30,00%	30,00%	art 8º, inciso II, "a"
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 165.158.915,00				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 126.523.666,69				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 115.002.087,08				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 123.982.617,43				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 169.751.964,95				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 53.778.389,48				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 206.580.775,99				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 333.572.437,74				
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 72.471.225,08				
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 47.345.349,71				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.049,63				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.092.044,72				
OCCAM FIC FIA	R\$ 130.018.192,43				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 32.562.417,00				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.455.562,33				
<b>TOTAL art. 8º, inciso II, "a"</b>	<b>R\$ 1.679.726.996,23</b>				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 21.625.095,96	0,40%	3,00%	3,00%	art 8º, inciso III
<b>TOTAL art. 8º, inciso III</b>	<b>R\$ 21.625.095,96</b>				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.560.220,69	0,10%	2,00%	5,00%	art 8º, inciso IV, "a"
<b>TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"</b>	<b>R\$ 5.560.220,69</b>				
<b>TOTAL RENDA VARIÁVEL</b>	<b>R\$ 1.792.511.070,42</b>	<b>32,77%</b>			

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN n° 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 46.203.995,78	2,03%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 64.730.268,06				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 73.979.497,64	3,18%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 99.834.770,43				
<b>TOTAL art 9º - A</b>	<b>R\$ 284.748.531,91</b>	5,21%			
<b>TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>R\$ 284.748.531,91</b>				

<b>TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES</b>	<b>R\$ 5.469.375.748,78</b>	<b>100,00%</b>
-----------------------------------	-----------------------------	----------------

Quadro 40.

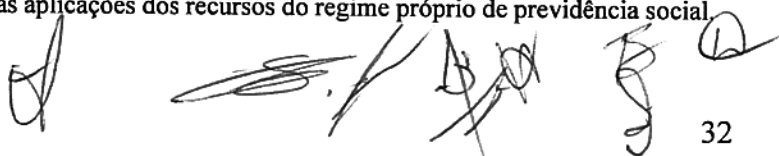
## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

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

SEGMENTO DE APLICAÇÃO	TOTAL	% CARTEIRA	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 7.078.188,15	0,13%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 347.865.564,37	6,28%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 549.506.510,10	9,93%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 126.523.666,69	2,29%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 73.979.497,64	1,34%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 46.203.995,78	0,83%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 507.308.881,01	9,17%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 54.641.479,49	0,99%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 22.676.377,19	0,41%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 13.347.623,72	0,24%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.405.182,07	1,09%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 54.469.816,24	0,98%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 85.598.757,54	1,55%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 165.158.915,00	2,98%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.362,75	0,00%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 831.869.919,08	15,03%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 10.416.300,97	0,19%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 169.751.964,95	3,07%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 53.778.389,48	0,97%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 115.002.087,08	2,08%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 123.982.617,43	2,24%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 206.580.775,99	3,73%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.853.824,48	0,54%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.896.794,63	1,43%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 93.172.991,55	1,68%	
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI	R\$ -	0,00%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 333.572.437,74	6,03%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.560.220,69	0,10%	
SANTANDER CRESCE SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.049,63	0,00%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 72.471.225,08	1,31%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 47.345.349,71	0,86%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 64.730.268,06	1,17%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 21.625.095,96	0,39%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 59.784.428,75	1,08%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 99.834.770,43	1,80%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.092.044,72	1,50%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 130.018.192,43	2,35%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 32.562.417,00	0,59%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.455.562,33	0,17%	
<b>TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO</b>	<b>R\$ 4.788.245.545,91</b>		

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 – Janeiro/2021

### 11.3 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\$ 7.078.188,15	19.523.305/0001-06	R\$ 246.568.875,27	2,87%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 347.865.564,37	13.322.205/0001-35	R\$ 9.200.599.633,08	3,78%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 549.506.510,10	25.078.994/0001-90	R\$ 9.495.985.226,13	5,79%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 126.523.666,69	29.258.294/0001-38	R\$ 1.137.598.937,97	11,12%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 73.979.497,64	21.470.644/0001-13	R\$ 735.026.847,45	10,06%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 46.203.995,78	17.413.636/0001-68	R\$ 1.480.125.341,04	3,12%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 22.676.377,19	08.246.263/0001-97	R\$ 311.866.158,81	7,27%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 60.405.182,07	20.216.216.0001/04	R\$ 1.002.679.832,30	6,02%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 54.469.816,24	28.515.874/0001-09	R\$ 1.406.368.486,30	3,87%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 85.598.757,54	14.099.976/0001-78	R\$ 595.178.322,17	14,38%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 165.158.915,00	06.988.623/0001-09	R\$ 2.134.082.790,72	7,74%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 507.308.881,01	11.060.913/0001-10	R\$ 13.518.203.391,91	3,75%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 54.641.479,49	22.791.074/0001-26	R\$ 222.990.846,21	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 831.869.919,08	23.215.097/0001-55	R\$ 14.822.912.413,17	5,61%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 115.002.087,08	10.577.512/0001-79	R\$ 707.827.403,93	16,25%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.362,75	21.838.150/0001-49	R\$ 3.621.561.522,63	0,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 10.416.300,97	08.817.414/0001-10	R\$ 945.642.826,43	1,10%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 123.982.617,43	23.731.629/0001-07	R\$ 1.335.473.423,07	9,28%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 169.751.964,95	24.571.992/0001-75	R\$ 3.479.599.111,95	4,88%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 53.778.389,48	01.063.897/0001-65	R\$ 1.383.466.341,99	3,89%	
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 47.345.349,71	29.549.642/0001-26	R\$ 1.639.908.805,79	2,89%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.049,63	02.436.763/0001-05	R\$ 502.570.935,25	0,00%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 72.471.225,08	01.699.688/0001-02	R\$ 945.642.826,43	7,66%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 64.730.268,06	17.804.792/0001-50	R\$ 1.639.908.805,79	3,95%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.896.794,63	10.922.432/0001-03	R\$ 903.786.509,33	8,73%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 93.172.991,55	10.756.541/0001-06	R\$ 911.752.182,62	10,22%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 59.784.428,75	30.659.168/0001-74	R\$ 1.731.335.032,19	3,45%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 333.572.437,74	11.977.794/0001-64	R\$ 2.721.146.302,78	12,26%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 99.834.770,43	19.436.818/0001-80	R\$ 2.019.764.027,29	4,94%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.092.044,72	34.791.108/0001-61	R\$ 546.614.791,16	15,20%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 130.018.192,43	11.628.883/0001-03	R\$ 1.073.001.033,93	12,12%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 32.562.417,00	11.458.144/0001-02	R\$ 934.871.998,48	3,48%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.455.562,33	09.290.813/0001-38	R\$ 113.077.253,07	8,36%	
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.731.206.404,78</b>				

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\$ 21.625.095,96	21.595.829/0001-54	R\$ 760.076.567,11	2,85%	5%
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.560.220,69	35.640.811/0001-31	R\$ 360.523.605,39	1,54%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.853.824,48	19.719.727/0001-51	R\$ 833.854.391,71	3,58%	
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 57.039.141,13</b>				

<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 4.788.245.545,91</b>
--------------	-----------------------------

Quadro 42.

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

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

**Nota 3:** Art. 14 § 3º. Em caso de os limites de que tratam o caput e o § 1º deste artigo serem ultrapassados em decorrência de resgate de cotas do fundo por outros cotistas, o regime próprio de previdência social deverá adequar-se em até 120 dias.



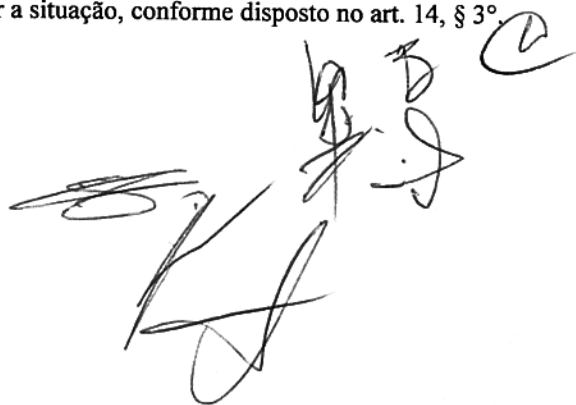
## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

---

**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.

**Nota 5:** O fundo AZ Quest Small Mid Caps possui recursos aplicados da Amazonprev que superam 15% do total do Patrimônio Líquido do próprio fundo. No entanto, o fundo compra cotas de outros fundos (FIC de FI) e dessa forma não registra desenquadramento nesse artigo, pois as informações repassadas para a SPPS através do sistema DAIR referem-se aos PL do fundo Master.

**Nota 6:** Os recursos aplicados no fundo Caixa Consumo superaram o limite de 15% do total do Patrimônio Líquido do próprio fundo. No entanto, como foi um desenquadramento passivo, ou seja, foi provocado pelo resgate de outros cotistas, a Fundação AMAZONPREV tem um prazo de 120 (cento e vinte) dias para regularizar a situação, conforme disposto no art. 14, § 3º.



## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA DEZEMBRO/2020) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (JANEIRO/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.173.250,59	R\$ 1.151.157.422,73	0,0981%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 752.185,20	R\$ 358.037.635,58	0,0476%	
BRADESCO	R\$ 529.081,09	R\$ 401.656.671,76	0,0759%	
CAIXA	R\$ 412.100,49	R\$ 1.508.822.366,66	0,3661%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 295.455,62	R\$ 184.561.892,48	0,0625%	
BANCO BTG	R\$ 144.039,87	R\$ 339.132.658,43	0,2354%	
BANCO SAFRA	R\$ 105.947,77	R\$ 181.244.295,14	0,1711%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 29.677,20	R\$ 32.562.417,00	0,1097%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 30.888,08	R\$ 408.504.386,65	1,3225%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 16.514,80	R\$ 83.092.044,72	0,5031%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 14.946,99	R\$ 130.018.192,43	0,8699%	

Quadro 43.

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

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

### DISTRIBUIÇÃO DAS APLICAÇÕES POR GESTOR DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS

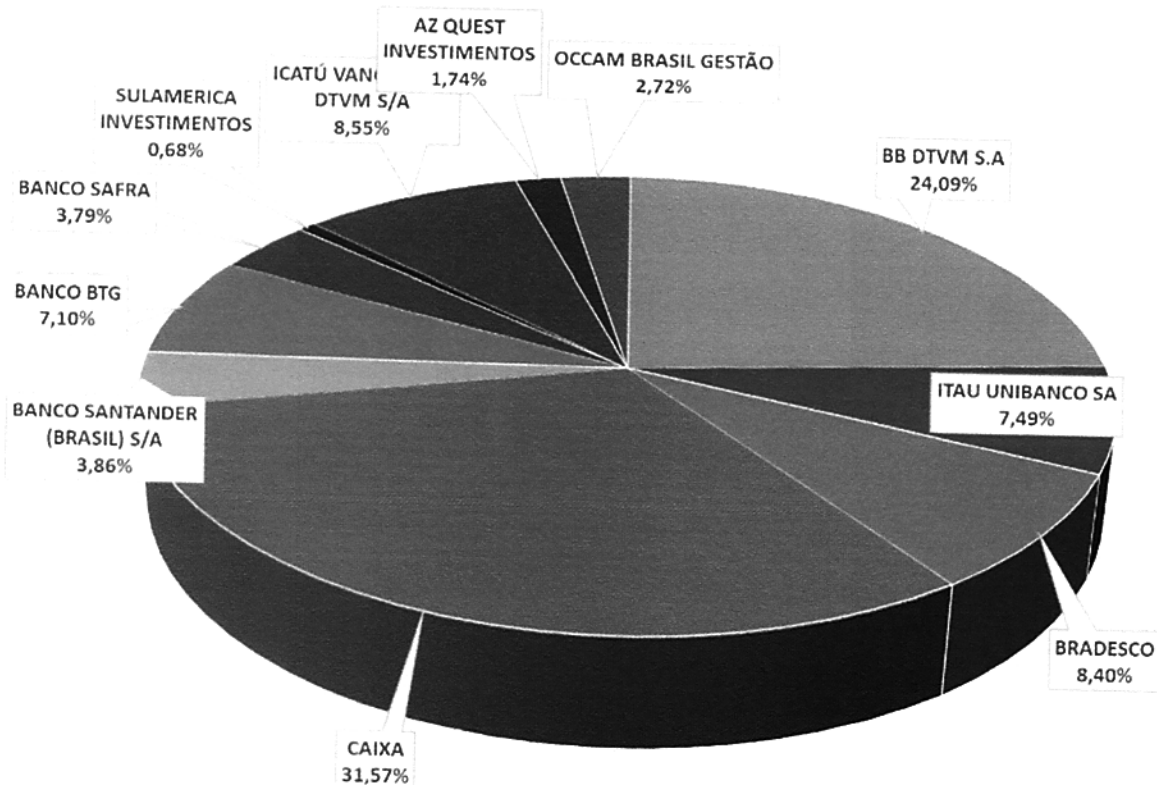


Gráfico 4.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.788.245.545,91
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 681.130.202,87
TÍTULOS - CVS	R\$ 10.303.710,88
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 3.640.935,69
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 5.545.155.720,53</b>

Quadro 44.

### EVOLUÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

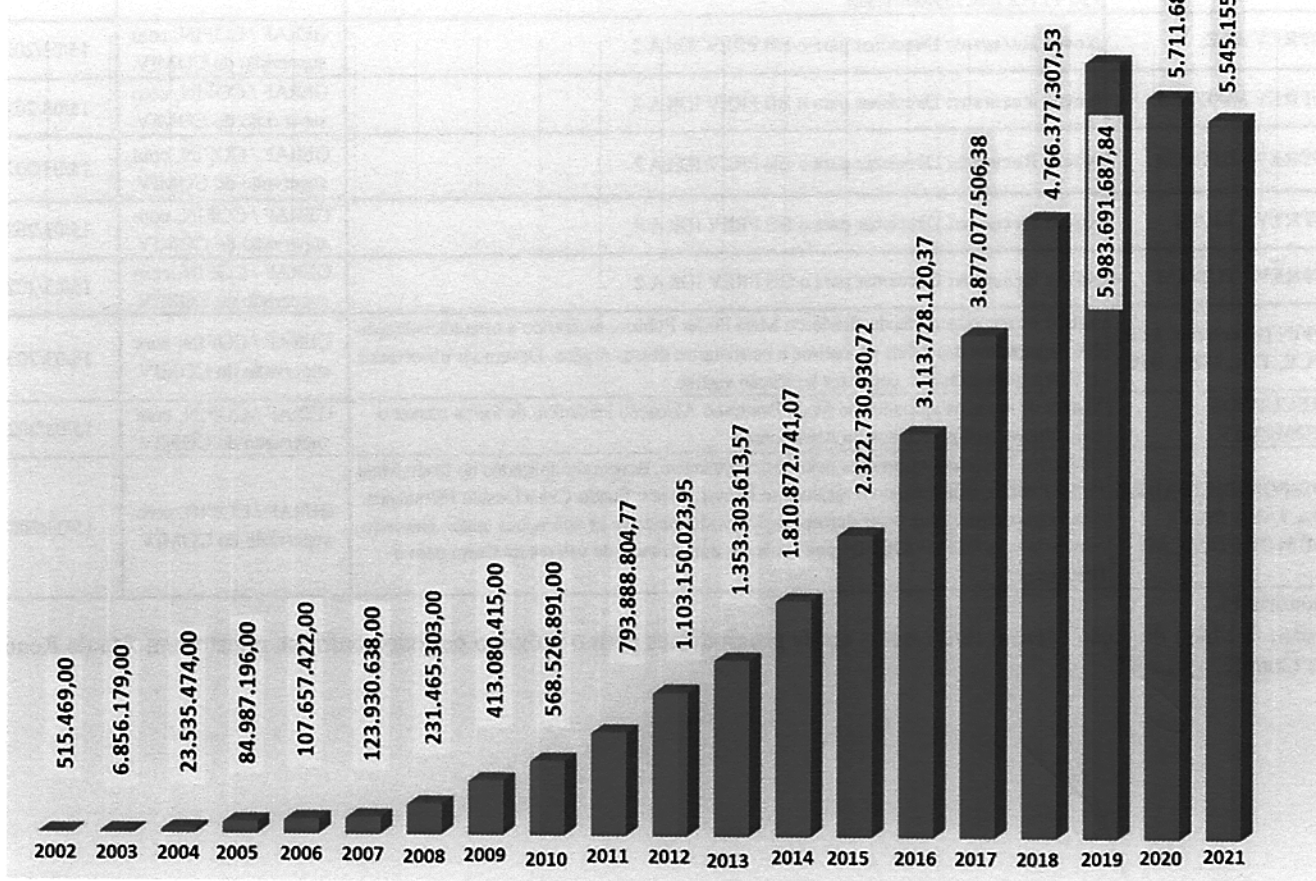


Gráfico 5.

**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. O valor total a ser utilizado no FTEMP é de R\$ 1,088 bilhão, que dessa forma reduzirá os resultados da carteira de investimentos da Amazonprev.

  
 [Assinatura manuscrita]

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

### 13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	Novos Recursos: Ratear entre os fundos GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE (37.331.299/0001-77) e GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA IE (37.331.285/0001-53)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
	Demais Recursos: Resgatar R\$ 30 milhões do fundo SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF (30.659.168/0001-74), direcionando para o fundo SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR (19.436.818/0001-80)		
	Resgatar R\$ 50 milhões do fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA (25.078.994/0001-90), direcionando para o fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 (13.322.205/0001-35)		
	Resgatar R\$ 30 milhões do fundo ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF (10.756.541/0001-06), direcionando para o fundo ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF (10.922.432/0001-03)		
	Zerar o fundo SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES (01.699.688/0001-02 41), direcionando para o fundo SANTANDER GLOBAL EQUITY (17.804.792/0001-50)		
	Resgatar R\$ 30 milhões do fundo CAIXA FI AÇÕES CONSUMO (10.577.512/0001-79), rateando entre os fundos VINCI SELECTION EQUITIES FI (15.603.945/0001-75), BRASIL CAPITAL MASTER 30 II (38.596.967/0001-50) e BNP PARIBAS ACTION FIC FI (12.239.939/0001-92)		
FPREV ALE:	Novos Recursos: Direcionar para o BB PREV IDKA 2	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Direcionar para o BB PREV IDKA 2	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o BB PREV IDKA 2	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Direcionar para o BB PREV IDKA 2	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o BB PREV IDKA 2	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
FFIN (Executivo, ALE, TCE, TJA, MPE, DPE)	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	15/03/2021
RECURSOS COMPREV	Manter os recursos aplicados no fundo Bradesco Alocação Dinâmica, de forma manter o enquadramento dos recursos da Amazonprev	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos repassados pelo Poder Executivo, devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica. Aos valores repassados pelos demais órgãos serão mantidas as aplicações atuais. Havendo necessidade, a GERAF/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/03/2021

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 – Janeiro/2021

SALDOS E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - FPREV AMAZONPREV	TOTAL APLICADO	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	jan/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfl	R\$ 549.506.510,10	6,30%	0,65%	-5,49	4,00%	-0,55%	-0,55%
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 7.078.188,15	2,44%	0,25%	-2,66	5,71%	0,29%	0,29%
BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	R\$ -	19,74%	2,03%	-18,57	3,23%	-1,70%	-1,70%
Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	R\$ 49.175.364,54	6,94%	0,71%	-5,88	3,61%	-0,58%	-0,58%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ 60.405.182,07	5,41%	0,56%	-5,66	7,24%	-0,02%	-0,02%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 2.005.092,35	0,32%	0,03%	-0,55	1,94%	0,15%	0,15%
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 54.641.479,49	9,27%	0,95%	-10,12	2,82%	-0,16%	-0,16%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 507.308.881,01	5,03%	0,52%	-5,40	7,25%	0,08%	0,08%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 794.852.159,91	5,94%	0,61%	-4,27	5,82%	0,03%	0,03%
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 29.853.824,48	6,10%	0,63%	-6,53	6,96%	0,35%	0,35%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 78.896.794,63	5,24%	0,54%	-5,56	7,11%	0,06%	0,06%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 93.172.991,55	19,90%	2,05%	-18,81	3,26%	-1,73%	-1,73%
Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 108.362,75	1,66%	0,17%	-1,57	2,65%	0,13%	0,13%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 59.784.428,75	14,73%	1,51%	-13,28	5,43%	-1,67%	-1,67%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 347.865.564,37	4,21%	0,43%	-4,46	7,69%	0,18%	0,18%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.634.654.824,15</b>						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	TOTAL APLICADO	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrowdown 12M	12M	jan/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Valor Fc FIA	R\$ 126.523.666,69	42,32%	4,31%	-42,94	1,52%	-5,59%	-5,59%
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 46.203.995,78	28,28%	2,93%	-22,73	48,52%	4,90%	4,90%
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nivel I	R\$ 73.979.497,64	29,72%	3,08%	-17,19	52,23%	5,09%	5,09%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 165.158.915,00	44,23%	4,46%	-5,78	-6,04%	-2,67%	-2,67%
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	R\$ 85.598.757,54	44,37%	4,50%	-45,29	1,42%	-3,31%	-3,31%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 333.572.437,74	46,32%	4,69%	-45,37	5,08%	-0,62%	-0,62%
BTG Pactual Economia Real FIP	R\$ 5.560.220,69	0,00%	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
Caixa FIA Consumo	R\$ 115.002.087,08	46,56%	4,70%	-1,19	-5,14%	-1,37%	-1,37%
Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	R\$ -	45,62%	4,63%	-46,54	2,81%	-2,69%	-2,69%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	R\$ 206.580.775,99	40,28%	4,09%	-1,46	-13,53%	-3,92%	-3,92%
Itau Acoes Dinamis Fc	R\$ 169.751.964,95	44,24%	4,49%	0,00	-6,09%	-1,46%	-1,46%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 10.416.300,97	44,67%	4,53%	-46,16	-0,91%	-2,34%	-2,34%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI	R\$ 123.982.617,43	52,78%	5,32%	-1,64	-24,63%	-2,91%	-2,91%
Itau Small Cap Master FIA	R\$ 53.778.389,48	47,34%	4,76%	-1,64	-4,65%	-2,18%	-2,18%
Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	R\$ 15.049,63	43,73%	4,42%	-1,19	-8,34%	-3,06%	-3,06%
Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	R\$ 72.471.225,08	45,60%	4,62%	-1,53	-8,05%	-3,46%	-3,46%
Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	R\$ 47.345.349,71	43,69%	4,42%	-1,23	-8,33%	-3,03%	-3,03%
Santander Global Equities Dólar Master Mult Ie FI	R\$ 64.730.268,06	24,34%	2,52%	-19,06	60,10%	5,64%	5,64%
Safra S P Reais Pb FI Mult	R\$ 21.625.095,96	32,89%	3,38%	-34,78	11,97%	-0,18%	-0,18%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	R\$ 99.834.770,43	33,63%	3,47%	-22,47	40,11%	3,75%	3,75%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 83.092.044,72	46,75%	4,70%	-5,73	-11,40%	-1,91%	-1,91%
Occam Fc de FIA	R\$ 130.018.192,43	42,20%	4,30%	-43,47	3,51%	-3,13%	-3,13%
Sul America Equities FIA	R\$ 32.562.417,00	48,15%	4,85%	-1,44	-17,01%	-3,26%	-3,26%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 9.455.562,33	41,48%	4,21%	-3,15	-6,04%	-3,59%	-3,59%
<b>TOTAL</b>	<b>R\$ 2.077.259.602,33</b>						

### Quadro 1.

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

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

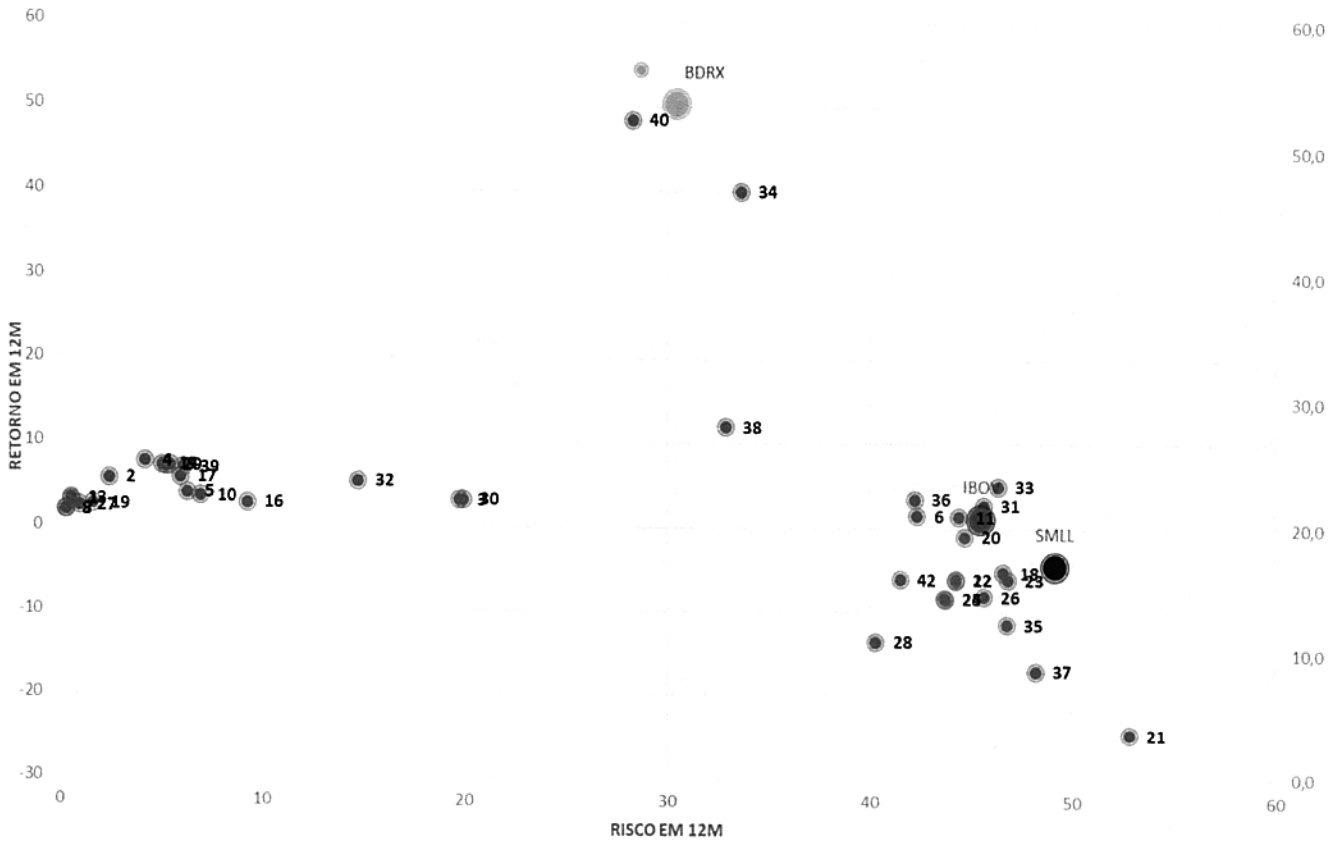
**Nota 2: VALUE at RISK (95%):** Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição normal. Dado o Desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se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

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

# Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

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: Análise Risco x Retorno (12 M)**

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

Nº	Fundos	Retorno	Volatilidade
1	BB Prev RF Irf M1 Tit Publ Fc	3,07	0,57
2	BB Prev RF Tit Publ VII FI	5,71	2,44
3	BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	3,23	19,74
4	BB Prev RF Idka 2 FI	7,69	4,21
5	BB Prev RF Alocacao Ativa Fc fi	4,00	6,30
6	BB Acoes Valor Fc FIA	1,52	42,32
7	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	1,94	0,32
8	Bradesco FI RF Ref DI Premium	1,91	0,26
9	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	7,24	5,41
10	Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	3,61	6,94
11	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	1,42	44,37
12	Bradesco FIA Mid Small Caps	-6,04	44,23
13	FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF	3,22	0,56
14	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	7,25	5,03
15	Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF		
16	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	2,82	9,27
17	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	5,82	5,94
18	Caixa FIA Consumo	-5,14	46,56
19	Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	2,65	1,66
20	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	-0,91	44,67
21	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI	-24,63	52,78
22	Itau Acoes Dunamis Fc	-6,09	44,24
23	Small Cap Valuation Fc Acoes	-6,03	46,79
24	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	-8,33	43,69
25	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	-8,34	43,73
26	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	-8,05	45,60
27	Santander RF Ativo Fc FI	2,38	1,00
28	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	-13,53	40,28
29	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	7,11	5,24
30	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	3,26	19,90
31	Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	2,81	45,62
32	Safra Ima Institucional Fc FI RF	5,43	14,73
33	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	5,08	46,32
34	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	40,11	33,63
35	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	-11,40	46,75
36	Occam Fc de FIA	3,51	42,20
37	Sul America Equities FIA	-17,01	48,15
38	Safra S P Reais Pb FI Mult	11,97	32,89
39	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	6,96	6,10
40	BB Mult Global Select Equity Ie FI	48,52	28,28
41	BTG Pactual Economia Real FIP		
42	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	-6,04	41,48

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.



## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

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

DATA BASE EM 29.01.21

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,40	2,00%	54,9%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,30	2,06%	9,4%
CDB	0,00	0,00%	0,0%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	1,40	2,14%	1,2%
BOND	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,88	-	27,9%
Over	0,00	-	6,6%
<b>Carteira Crédito</b>	<b>3,21</b>	<b>2,01%</b>	<b>65,5%</b>
<b>Crédito - Contribuição Fundo</b>	<b>0,95</b>	<b>1,32%</b>	<b>65,5%</b>
<b>Fundo (Inclui DAP e NTN-B)</b>	<b>2,64</b>	<b>1,32%</b>	<b>100,0%</b>

Quadro 03

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financeiro	% PL
AAA	182.373.658	21,9%
AA+	75.145.937	9,0%
AA	137.135.084	16,5%
AA-	41.605.257	5,0%
A+	61.052.725	7,3%
DPGE	0	0,0%
A	0	0,0%
A-	12.911.605	1,5%
BBB+	0	0,0%
BBB	0	0,0%
BBB-	0	0,0%
BB+	0	0,0%
BB	0	0,0%
BB-	0	0,0%
B+	0	0,0%
B	0	0,0%
B-	9.663.211	1,2%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Rating	26.230.767	3,1%
Tesouro / Over	287.445.249	34,5%
<b>Total</b>	<b>833.563.492</b>	<b>100,0%</b>

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

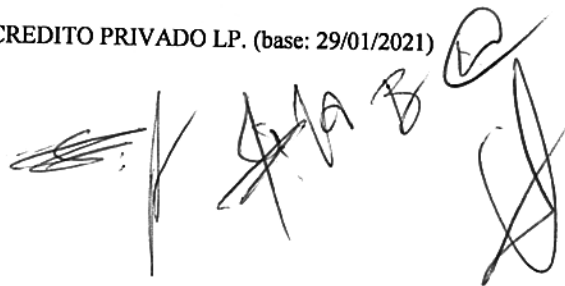
Quadro 04.

## Relatório de Investimentos – Janeiro/2021

TABELA - SETOR		
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	149.312.422	17,9%
Conc. Rodoviárias	79.568.234	9,5%
Bancos	78.673.303	9,4%
Saneamento	61.949.676	7,4%
Serviço	54.904.099	6,6%
Varejo	41.374.554	5,0%
Shopping Center	34.312.656	4,1%
Mineração e Siderurgia	11.581.201	1,4%
Logística	9.915.821	1,2%
Óleo e Gás	7.550.459	0,9%
Indústria e Comércio	5.290.277	0,6%
Infraestrutura	4.508.090	0,5%
Papel e Celulose	4.075.368	0,5%
Holding	3.102.084	0,4%
Tesouro / Over	287.445.249	34,5%
<b>Total</b>	<b>833.563.492</b>	<b>100,0%</b>

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 29/01/2021)




**PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS**

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 15 de fevereiro de 2021, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de janeiro/2021, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.


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

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


Manaus – AM, 15 de fevereiro de 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

**APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - COFIS**

Com base nos termos do Parecer do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev, acima emitido, bem com análise das informações constantes do Relatório de Investimentos e Riscos das aplicações dos Recursos do RPPS do Estado do Amazonas, o Conselho Fiscal delibera pela sua:

( ) APROVAÇÃO

( ) REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho Fiscal:

**APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL - CONAD**

Com base nos termos do Parecer do Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev, acima emitido, bem com análise das informações constantes do Relatório de Investimentos e Riscos das aplicações dos Recursos do RPPS do Estado do Amazonas, o Conselho Fiscal delibera pela sua:

APROVAÇÃO

REJEIÇÃO

Data:

Membros do Conselho de Administração:

