

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 17/03/2021

RELATÓRIO Nº. 003 / 2021 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **fevereiro/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 12)
- 3) ACOMPANHAMENTO DE SALDO DO FTEMP (página 13)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 13 a 15)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 16 e 17)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 18)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 19 e 20)
- 8) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (páginas 21 e 22)
- 9) Recursos do Fundo Previdenciário Consolidado – FPREV (página 23)
- 10) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 24 a 25)
- 11) Disponibilidades da Taxa de Administração - (página 26)
- 12) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 27 a 32)
- 13) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 33)
- 14) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 34)
- 15) Relatório de Riscos da Carteira (página 35 a 40)
- 16) Parecer do Comitê de Investimentos (página 41).
- 17) Parecer do Comitê de Investimentos (página 42).
- 18) Parecer do Comitê de Investimentos (página 43).

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

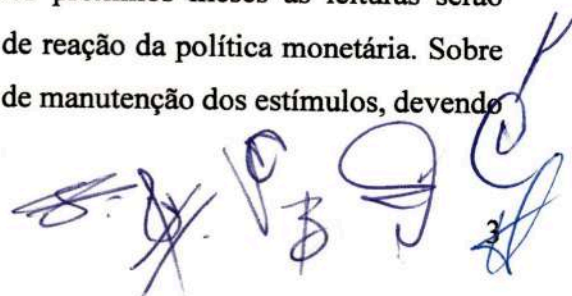
Com apoio dos Relatórios: Carta do Gestor e Síntese Mensal, emitidos pela BRAM Asset Management:

Brasil: Prévia da inflação cede em fevereiro, mas riscos à frente seguem elevados

Mundo: Ata do FOMC reforça perspectiva de manutenção de estímulos.

No Brasil, o Índice do Banco Central de atividade (IBC-Br) avançou 0,6% na margem em dezembro. O indicador prévio do PIB apresentou crescimento um pouco abaixo da nossa projeção (0,7%) e acima da mediana do mercado (0,4%). O resultado refletiu a alta da indústria (0,9%) e as quedas do comércio (-3,7%) e do setor de serviços (-0,2%) no mês. Na comparação interanual, o índice teve alta de 1,3%. No último trimestre, o índice avançou 3,1% na margem. No ano, o IBC-Br recuou 4,1% e se situa 0,9% abaixo do patamar pré-pandemia (média de janeiro e fevereiro). Com os últimos dados de atividade divulgados, nosso tracking do PIB do 4º trimestre passou para 2,6% na margem. Para 2020, espera-se queda do PIB de 4,2%. Nessa divulgação, o índice subiu 0,48% na comparação mensal, resultado um pouco aquém da nossa expectativa (0,51%) e da mediana do mercado (0,50%). A abertura entre os grupos mostrou, por um lado, uma inflação de alimentos mais pressionada, com destaque para itens como tomate, leite e frutas. No sentido contrário, a alta do grupo Educação, dada a perspectiva de reajuste de matrículas escolares após a retomada das aulas, foi menor que a prevista. Em termos de núcleos, que são métricas que excluem ou suavizam itens com inflação volátil, a leitura de fevereiro mostrou alguma melhora, em especial das medidas de inflação subjacente acompanhadas pelo Banco Central. Nos últimos 12 meses, a média dos núcleos acumula alta de 3,0%, um nível ainda confortável. Os recentes movimentos de depreciação do câmbio e de alta de preços de commodities impõem uma trajetória menos benéfica para a inflação nos próximos meses. Além disso, há uma incerteza sobre a capacidade da indústria de suprir a demanda aquecida por bens, em um cenário de baixos estoques, elevação de custos de produção e perspectiva de novos incentivos ao consumo por parte do governo. Tendo em vista esses fatores, a projeção do IPCA de 2021 foi elevada de 3,6% para 4,0%.

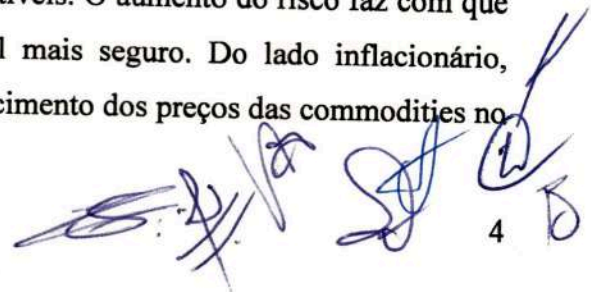
Em sua última reunião, o Fed manteve a taxa de juros no intervalo de 0% a 0,25% e o pacote mensal de US\$ 120 bilhões em compra de ativos. Os membros reforçaram que o cenário ainda depende da evolução da pandemia, enquanto as metas de inflação e emprego estão distantes de serem atingidas. Para o FOMC, a perspectiva de novo impulso fiscal reforça o cenário de recuperação. Os membros ressaltam, no entanto, que o avanço da vacinação é essencial para a materialização do aumento da demanda. Sobre o mercado de trabalho, apesar da desaceleração recente da criação de vagas, a expectativa é de continuidade da retomada do emprego. A respeito da inflação, o FOMC reconhece que nos próximos meses as leituras serão pressionadas por efeitos pontuais, afastando qualquer necessidade de reação da política monetária. Sobre possíveis próximos passos, os membros reafirmaram a necessidade de manutenção dos estímulos, devendo



Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

levar “algum tempo” para a discussão da possibilidade de redução dos estímulos ser introduzida no comitê. Diante de toda a incerteza oriunda da dinâmica do vírus, da vacina e do impacto sobre o mercado de trabalho, avaliado que os estímulos permanecerão por um período prolongado. O PMI Composto prévio da Zona do Euro, que incorpora as expectativas da indústria e dos serviços atingiu 48,1 pontos em fevereiro ante 47,8 em janeiro, sinalizando continuidade da contração da economia (nível abaixo de 50 pontos indica contração). A piora da atividade na região tem se concentrado no setor de serviços, afetado por novas medidas de restrição. O setor teve nova queda no período, de 45,4 para 44,7 pontos. Já nos EUA, o PMI Composto avançou de 58,7 pontos em janeiro para 58,8 pontos em fevereiro, com destaque para a melhora do setor de serviços. Ainda com incerteza quanto à contenção da pandemia e a velocidade de recuperação do mercado de trabalho, os estímulos fiscais e monetários deverão permanecer em ambas as regiões. Na China, destaque para a inflação ao consumidor (CPI) que apresentou deflação em janeiro. No mês, a taxa acumulada em doze meses foi de -0,3%, ante 0,2% em dezembro. Na mesma direção, a núcleo da inflação (exclui itens voláteis) recuou de 0,4% para -0,3% em termos anuais, com destaque para o enfraquecimento mais intenso da inflação de serviços, cuja variação foi de -0,7%. Os números ficaram abaixo da expectativa do mercado. Além da dissipação de choques e normalização de preços dos produtos in natura, a leitura do mês também contou com o efeito de algumas medidas de restrição à mobilidade, que afetam a dinâmica da atividade no setor de serviços. A inflação ao produtor (PPI), por sua vez, acelerou de -0,4% em dezembro para 0,3% em janeiro, pressionada pela alta nos preços das commodities. O cenário benigno de inflação prescreve uma retirada gradual das medidas expansionistas adotadas desde o início do ano passado no país.

Perspectivas Renda Fixa – Apesar do aumento da quantidade de doses aplicadas e novas vacinas aprovadas pelo mundo, a retomada da atividade esbarra em um número crescente de novos casos e em uma redução de mobilidade. Adicionalmente, os efeitos do excesso de recursos em circulação e novos incentivos têm elevado, principalmente nos Estados Unidos, as taxas dos títulos federais. Isso demonstra uma preocupação com a inflação para os próximos anos. Outro fato que contribui com essa incerteza é o aumento do preço das commodities, provocado por um aumento da demanda, especialmente pela China, que voltou a focar em recuperação. Por outro lado, no momento que as economias começarem a atingir um nível satisfatório de imunização da população, deve haver uma volta da mobilidade que poderá impactar positivamente na retomada da atividade. No cenário local, assim como em outros países, voltaram as discussões sobre o auxílio emergencial, que tem ganhado destaque mesmo com um período e valores menores. No que tange o comprometimento fiscal e votações importantes, como a PEC emergencial, pode haver um certo alívio, dependendo do que for aprovado. Essa incerteza está presente em outros assuntos, como a condução do governo com relação aos preços dos combustíveis. O aumento do risco faz com que os investidores estrangeiros levem seus recursos para um local mais seguro. Do lado inflacionário, permanece um ambiente de inflação maior, porém sinais de arrefecimento dos preços das commodities no

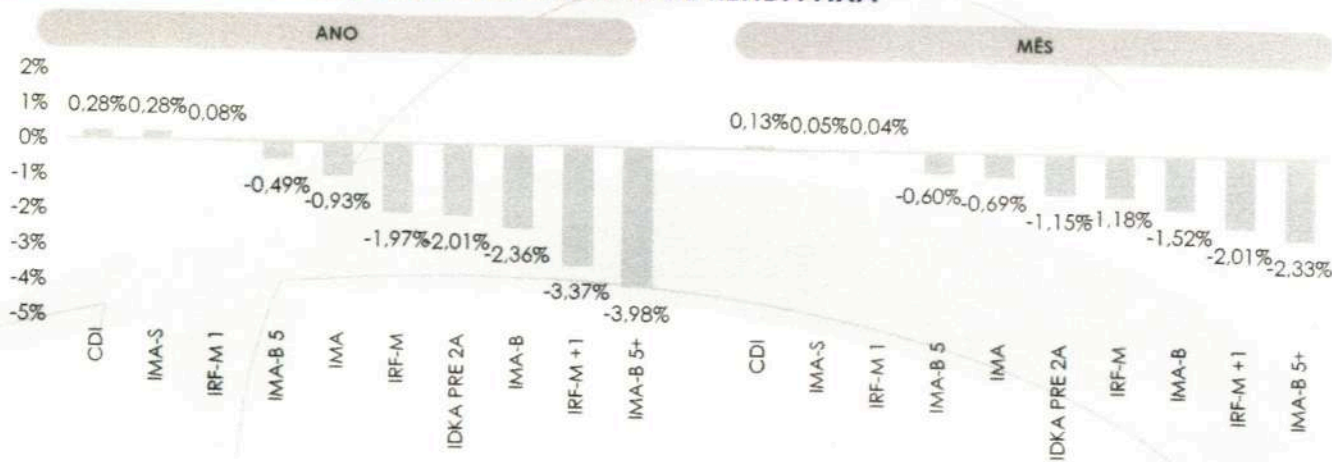


4

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

segundo semestre trazem uma esperança com relação ao nível de inflação mais próximo a meta no final de 2021. Apesar de uma inflação maior neste momento, 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%. Neste mês, o único índice de renda fixa a obter resultado positivo foi o IMA-S da ANBIMA, mesmo assim o resultado foi abaixo do CDI, terminando o mês com 40% do CDI. O aumento da curva de juros ocorreu com mais intensidade na porção intermediária, tanto dos ativos atrelados à inflação quanto dos prefixados, que também foram impactados nos vencimentos mais longos. Nesse sentido, o dólar retomou aos patamares mais altos de 2020, com aumento de 0,99%, fechando janeiro a R\$ 5,48.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Fonte: Carta ao Gestor_BRAM Março/2021

Perspectivas Renda Variável – Fevereiro foi um mês de recuperação das bolsas no exterior. Por um lado, segue o clima de esperança de normalização das economias com o avanço das vacinas, principalmente nos países desenvolvidos. Por outro, o debate em torno dos desafios lançados para este ano segue tanto interna quanto externamente. O S&P 500 teve retorno de 2,61 e o Nasdaq, teve retorno de 1,93 ambos acumulando alta no ano de 1,47 e 2,36, respectivamente (em moeda original). O Ibovespa teve mais um mês de queda de 4,37 totalizando queda de 7,55 no ano. O fluxo do investidor estrangeiro deixou de ser positivo, porém o mercado de capitais permanece aquecido. O aumento de casos de COVID 19 assim como seus efeitos colaterais, tem pesado sobre a bolsa brasileira. A gestão segue 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. Para os gestores, 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

[Assinaturas manuscritas]

5

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

expostas ao consumo doméstico, com expectativa de crescimento acima do mercado, potencial de consolidação e bem posicionadas para os desafios à frente. Sobre a performance dos diferentes setores, Papel Celulose e Mineração Siderurgia foram os grandes destaques devido à sua correlação com câmbio e com o crescimento global. Por outro lado, o setor de Petróleo Petroquímicos foi o maior destaque negativo devido ao aumento da incerteza em torno da política de reajuste de preços de combustíveis. Os setores de Educação e Shoppings Properties também foram negativamente impactados pelos efeitos colaterais provenientes do aumento de casos de COVID 19 e a necessidade de novas medidas para contenção de contaminações.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	FEVEREIRO	2021	12 MESES	24 MESES	36 MESES
IBOVESPA	-4,37%	-7,55%	5,63%	15,12%	28,92%
SMLL	-1,84%	-5,21%	2,20%	38,68%	54,97%
IBRX 100	-3,45%	-6,38%	6,92%	18,84%	34,16%
IDIV	-5,21%	-10,02%	-3,53%	17,34%	37,29%
S&P 500 (USD)	2,61%	1,47%	29,01%	36,87%	40,43%
MSCI WORLD (USD)	2,45%	1,37%	27,36%	30,73%	28,75%

Fonte: Carta ao Gestor_BRAM Março/2021.



Relatório de Investimentos – Fevereiro/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 (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 377.889.065,09	R\$ 374.435.400,07	2,3790	(0,5523)	(0,9139)	0,8831%	-1,4612%	2,5857%
BB PREVID TP VII	R\$ 7.078.188,15	R\$ 6.890.569,80	1,2064	0,2867	(0,0122)	1,4842%	0,2745%	5,2592%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 177.279.358,66	R\$ 191.966.599,81	1,5256	0,1769	(0,5482)	1,1477%	-0,3723%	NC
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.005.092,35	R\$ 2.003.764,04	0,1800	0,1500	0,0800	0,4105%	0,2301%	1,7564%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 54.641.479,49	R\$ 52.562.700,49	2,5300	(0,1600)	(3,8000)	-1,5240%	-3,9539%	0,5787%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 507.308.881,01	R\$ 489.890.553,27	1,8198	0,0832	(0,6197)	1,2730%	-0,5370%	5,9216%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 528.762.520,96	R\$ 526.078.826,44	1,3207	0,0253	(0,5075)	0,8320%	-0,4823%	4,6417%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 27.905.092,33	R\$ 27.758.196,79	2,3700	0,3500	(0,5300)	2,1838%	-0,1819%	5,7752%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.896.794,63	R\$ 78.394.466,34	1,8100	0,0600	(0,6400)	1,2191%	-0,5804%	5,7602%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 93.172.991,55	R\$ 90.983.769,37	7,5000	(1,7300)	(2,3500)	3,1577%	-4,0393%	0,5602%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 21.103,41	R\$ 21.116,03	0,2000	0,1339	0,0600	0,3944%	0,1940%	2,4430%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 59.784.428,75	R\$ 58.672.774,69	5,5614	(1,6700)	(1,8600)	1,8679%	-3,4989%	2,8034%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.914.744.996,38	R\$ 1.899.658.737,14						
FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 126.523.666,69	R\$ 120.162.092,45	10,7189	(5,5863)	(2,1187)	2,3191%	-7,5866%	9,1529%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 165.158.915,00	R\$ 163.880.259,74	8,6100	(2,6700)	(0,7700)	4,8961%	-3,4194%	1,2500%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 59.277.904,60	R\$ 57.447.865,82	9,4300	(3,3100)	(3,0900)	2,5384%	-6,2977%	7,0652%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 331.973.171,94	R\$ 323.581.144,57	5,2345	0,6156	(1,9923)	3,7728%	-1,3890%	18,0716%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 9.455.562,33	R\$ 9.063.034,94	-	(3,5900)	(2,0162)	-5,5338%	-5,5338%	NC
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.560.220,69	R\$ 5.546.311,97	(0,7242)	(0,1700)	(0,2364)	-1,1273%	-0,4060%	NC
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 93.909.405,04	R\$ 60.863.932,98	4,8862	(1,3746)	(5,3612)	-2,1014%	-6,6621%	-0,2020%
ICATU VANGUARDIA DIVIDENDOS FIA	R\$ 206.061.428,93	R\$ 169.784.663,87	7,9600	(3,9200)	(3,8100)	-0,2241%	-7,5806%	-10,5643%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 169.751.964,95	R\$ 170.555.424,70	6,3000	(1,4600)	0,4700	5,2403%	-0,9969%	7,2697%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 10.416.300,97	R\$ 38.406.022,23	8,3700	(2,3400)	(3,8500)	1,7595%	-6,0999%	3,3045%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 123.982.617,43	R\$ 60.785.903,53	7,9700	(2,9100)	(4,3000)	0,3205%	-7,0849%	-20,4893%
ITAÚ SMALL CAPS VALUATION	R\$ 53.778.389,48	R\$ 82.581.623,45	7,5200	(2,3300)	0,6600	5,7079%	-1,6854%	3,1614%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.049,63	R\$ 14.404,56	7,6133	(3,0560)	(1,9891)	2,2495%	-4,9843%	-1,0819%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 72.471.225,08	R\$ 50.541.736,90	7,4312	(3,4551)	(3,4240)	0,1680%	-6,7608%	-2,4402%
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 47.345.349,71	R\$ 45.315.737,93	7,6224	(3,0324)	(4,2868)	-0,1148%	-7,1892%	-3,3631%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 21.625.095,96	R\$ 22.186.107,00	3,0680	(0,1800)	2,5900	5,5472%	2,4053%	24,0879%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.092.044,72	R\$ 83.734.069,33	6,9300	(1,9100)	(0,7727)	4,0772%	-2,6679%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$ 127.942.152,42	R\$ 123.639.527,85	10,1100	(3,1300)	(3,3629)	3,0766%	-6,3876%	NC
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 32.562.417,00	R\$ 31.426.044,40	7,6962	(3,2555)	(3,4898)	0,5542%	-6,6316%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.740.902.882,57	R\$ 1.619.515.908,22						
SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 46.203.995,78	R\$ 79.585.312,09	1,0937	4,8971	6,1534	12,5697%	11,3518%	NC
SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 64.730.268,06	R\$ 87.822.626,05	0,4756	5,6373	4,5987	11,0208%	10,4952%	NC
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ -	R\$ 24.505.010,57	-	-	-	0,0000%	0,0000%	NC
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 73.979.497,64	R\$ 76.997.124,35	0,6824	5,0882	4,0790	10,1211%	9,3747%	NC
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 98.655.799,60	R\$ 103.063.956,08	0,3469	3,7500	4,4700	8,7636%	8,3876%	NC
TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	R\$ 283.569.561,08	R\$ 371.974.029,15						
TOTAL GERAL	R\$ 3.939.217.440,03	R\$ 3.891.148.674,52						

Quadro 1.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

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: Com base na Ata COMIV 171/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV, direcionando os novos recursos para o fundo Schroeder Ações Globais e BB IDKA 2.

2.2 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXECUTIVO

INSTITUIÇÃO	dez/20	jan/21	fev/21
BRADESCO	R\$ 165.001.374,66	R\$ 226.441.911,95	R\$ 223.331.889,60
BANCO DO BRASIL	R\$ 783.508.342,84	R\$ 808.953.772,01	R\$ 850.037.098,57
CAIXA	R\$ 1.203.050.938,14	R\$ 1.184.622.286,50	R\$ 1.129.396.013,18
ITAÚ	R\$ 430.007.369,02	R\$ 357.950.376,24	R\$ 352.350.089,94
SANTANDER	R\$ 286.843.195,30	R\$ 184.561.892,48	R\$ 183.694.505,44
ICATU	R\$ 474.195.769,93	R\$ 406.036.307,44	R\$ 366.921.096,37
SAFRA	R\$ 177.551.764,66	R\$ 180.065.324,31	R\$ 183.922.837,77
BTG PACTUAL	R\$ 319.648.985,40	R\$ 346.988.954,96	R\$ 338.190.491,48
AZ QUEST	R\$ 84.713.090,08	R\$ 83.092.044,72	R\$ 83.734.069,33
OCCAM BRASIL	R\$ 104.020.515,68	R\$ 127.942.152,42	R\$ 123.639.527,85
SCHRODER	R\$ -	R\$ -	R\$ 24.505.010,57
SULAMÉRICA	R\$ 33.658.143,72	R\$ 32.562.417,00	R\$ 31.426.044,40
TOTAL	R\$ 4.062.199.489,43	R\$ 3.939.217.440,03	R\$ 3.891.148.674,52

Quadro 2.

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC
FEVEREIRO- 2021

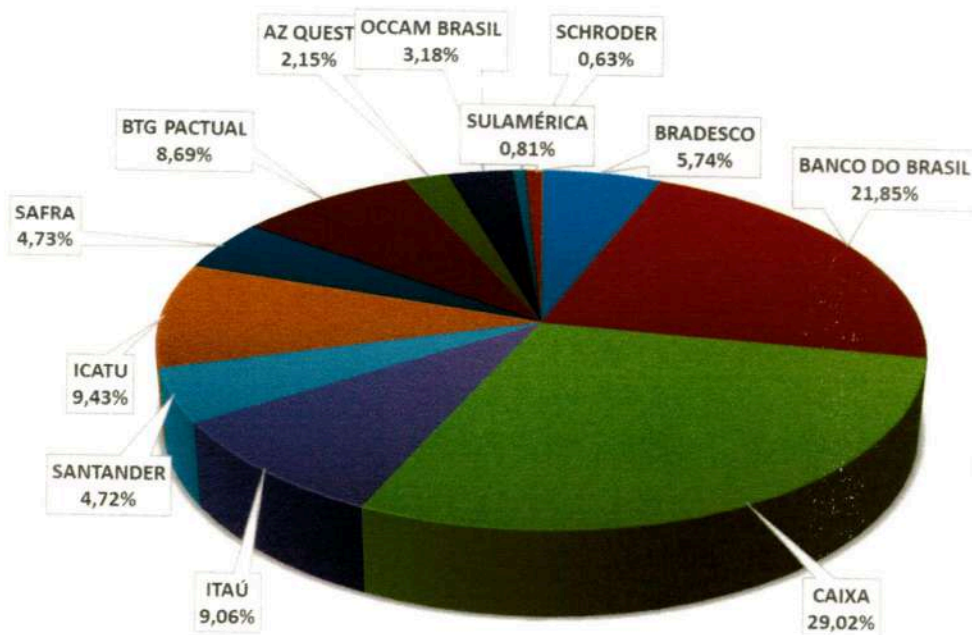


Gráfico 1

Handwritten signature and initials in blue ink.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

2.3 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR ÍNDICE DE REFERÊNCIA – FPREV EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	ÍNDICE DE REFERÊNCIA	SALDO POR FUNDO	SALDO APLICADO	% APLICADO			
BRASESCO FI MAXI PODER PUBLICO	CDI	R\$ 2.003.764,04	R\$ 2.003.764,04	0,05%			
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	CDI ATIVO	R\$ 526.078.826,44	R\$ 922.721.449,54	23,71%			
BB PREVID ALOCAÇÃO ATIVA		R\$ 374.435.400,07					
SAFRA S&P REAIS		R\$ 22.186.107,00					
BRASESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA		R\$ -					
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI		R\$ 21.116,03					
BB PREVID IDKA 2	IDKA 2	R\$ 191.966.599,81	R\$ 191.966.599,81	4,93%			
ICATU VANG. FI RF INFLA. CP	IMA B 5	R\$ 27.758.196,79	R\$ 596.043.216,40	15,32%			
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF		R\$ 78.394.466,34					
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	IMA B5+	R\$ 90.983.769,37	R\$ 90.983.769,37	2,34%			
CAIXA FI BRASIL 2020 I TP RF	IPCA + 6%	R\$ -	R\$ 64.999.582,26	1,67%			
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF		R\$ 52.562.700,49					
BTG ECONOMIA REAL FIP		R\$ 5.546.311,97					
BB PREVID TP VII		R\$ 6.890.569,80					
BRASESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	IBR X	R\$ 57.447.865,82	R\$ 57.447.865,82	1,48%			
ICATÚ VANGUARDA AÇÕES IBX FI		R\$ -					
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	IBOVESPA	R\$ 120.162.092,45	R\$ 1.534.335.623,43	39,43%			
BRASESCO FIA MID SMALL CAPS		R\$ 163.880.259,74					
ITAÚ SMALL CAPS VALUATION		R\$ 82.581.623,45					
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES		R\$ 60.863.932,98					
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		R\$ 169.784.663,87					
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC		R\$ 170.555.424,70					
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA		R\$ 38.406.022,23					
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI		R\$ 60.785.903,53					
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES		R\$ 14.404,56					
BTG ABSOLUTO FIQ FIA		R\$ 323.581.144,57					
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES		R\$ 50.541.736,90					
SANTANDER SELEÇÃO 30		R\$ 45.315.737,93					
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA		R\$ 83.734.069,33					
OCCAM FIC FIA		R\$ 123.639.527,85					
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES		R\$ 9.063.034,94					
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES		R\$ 31.426.044,40					
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR		BDR			R\$ 103.063.956,08	R\$ 180.061.080,43	4,63%
BB FIA BDR NIVEL I					R\$ 76.997.124,35		
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC		MSCI			R\$ 87.822.626,05	R\$ 191.912.948,71	4,93%
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 24.505.010,57						
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 79.585.312,09						
TOTAL GERAL - FPREV EXECUTIVO		R\$ 3.891.148.674,52	R\$ 3.891.148.674,52	100%			

Quadro 3.

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

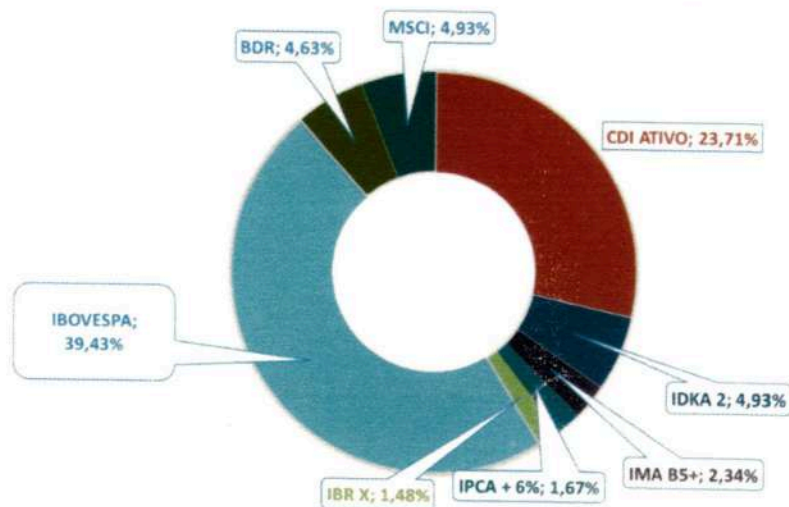


Gráfico 2.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS – FPREV EXECUTIVO

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 162.023.178,29	R\$ 159.839.062,78	1,8817	0,7759	1,3891	4,098%	2,1758%	12,0119%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 168.824.066,80	R\$ 166.666.752,82	1,8912	0,7854	1,3986	4,128%	2,1949%	12,1379%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 172.938.016,99	R\$ 175.340.312,20	1,9151	0,8090	1,4224	4,201%	2,2429%	12,4537%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 175.039.492,87	R\$ 172.944.328,08	1,8912	0,7854	1,3986	4,128%	2,1950%	12,1381%
TOTAL GERAL	R\$ 678.824.754,95	R\$ 674.790.455,88						

Quadro 4.

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

Nota 2: Registra-se que em fevereiro/21, conforme características do ativo, foi efetuado o pagamento de cupom de juros semestrais de NTN B, tendo sido disponibilizado o valor de R\$ 13.524.431,06, motivo da redução do valor aplicado.

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	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO
PREÇO UNITÁRIO DE COMPRA	R\$ 2.314,742871	R\$ 2.288,539269	R\$ 2.235,637189	R\$ 2.254,343911
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 98.620.663,31	R\$ 99.980.152,45
VALOR ATUAL	R\$ 159.839.062,78	R\$ 166.666.752,82	R\$ 175.340.312,20	R\$ 172.944.328,08
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	
	29/01/2021	26/02/2021
CVS - A	R\$ 1.239.999,46	R\$ 1.222.546,14
CVS - B	R\$ 8.023.024,70	R\$ 7.910.046,90
CVS - C	R\$ 160.855,24	R\$ 158.591,16
CVS - D	R\$ 879.831,48	R\$ 867.441,96
TOTAL	R\$ 10.303.710,88	R\$ 10.158.626,16

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.

2.8 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
TOTAL	R\$ 60.074,21	R\$ 290.169,44	R\$ 350.243,65

Quadro 7.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

2.9 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2021 (Contrato Regular)					
MÊS	UEA		SEAS		TOTAL
jan/21	R\$	-	R\$	-	R\$ -
fev/21					R\$ -
TOTAL	R\$	-	R\$	-	R\$ -

Quadro 8.

2.10 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	29/01/2021	26/02/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.939.217.440,03	R\$ 3.891.148.674,52	83,5939%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 678.824.754,95	R\$ 674.790.455,88	14,4966%
TÍTULOS CVS	R\$ 10.303.710,88	R\$ 10.158.626,16	0,2182%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 61.835.325,18	1,3284%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1.457.381,31	R\$ 16.891.355,97	0,3629%
TOTAL	R\$ 4.691.638.612,35	R\$ 4.654.824.437,71	100,00%

Quadro 9.

2.11 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS – FPREV EXECUTIVO

Mês	Recursos FPREV Executivo	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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%
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%

Quadro 10.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

2.12 RENTABILIDADE X META ATUARIAL – FPREV EXECUTIVO



Curitiba, 13 de março 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 28/02/2021.

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 02/2020			RS 5.147.828.344,11
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
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 68.758.510,80	RS -68.174.498,49
02/2021	RS 41.044.778,45	RS 58.074.626,75	RS -17.029.848,30
Saldo dos Investimentos em 02/2021			RS 4.654.824.437,71

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	5,1953 %	1,1121 %	0,8600 %	
Juros	5,4500 %	0,8884 %	0,4432 %	
Meta	10,9284 %	2,0104 %	1,3070 %	
Rentabilidade em %	5,1369 %	-1,4238 %	-0,4217 %	
Rentabilidade em RS	RS 247.660.038,99	RS -67.971.224,61	RS -19.784.326,34	
Resultado em %	-5,2209 %	-3,3666 %	-1,7064 %	
Resultado em RS	RS -279.644.050,49	RS -163.949.286,54	RS -81.104.674,42	

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.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

2.13 ACOMPANHAMENTO DE SALDO DO FTEMP

REFERÊNCIA	APOSENTADO	1ª PARC. 15% SALÁRIO APOSENTADO	PENSIONISTA	2ª PARC. 15% SALÁRIO PENSIONISTA	TOTAL	SALDO DISPONÍVEL DO FUNDO TEMPORÁRIO (FTEMP)
SALDO INICIAL FTEMP (*)						
ABRIL	R\$ 56.682.153,99	-	R\$ 20.836.487,85	-	R\$ 87.518.651,78	R\$ 1.001.250.287,91
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\$ 758.577.257,87
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\$ 458.043.671,61
OUTUBRO	R\$ 76.164.446,64	-	R\$ 24.896.928,36	-	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\$ 25.529.272,04	R\$ 10.486.907,93	R\$ 154.096.330,10	R\$ 102.898.798,85
jan/21	R\$ 45.588.078,51	-	R\$ 26.148.678,64	-	R\$ 71.736.757,15	R\$ 31.162.041,70
fev/21	R\$ 31.162.041,70	-	-	-	R\$ 31.162.041,70	R\$ 0,00
TOTAL ACUMULADO					R\$ 1.088.777.939,68	

Quadro 12

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

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.188.376,23	R\$ 5.162.042,99	1,3207	0,0253	(0,2664)	1,0763%	-0,2412%	4,8952%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 87.259,34	R\$ 87.311,53	0,2000	0,0598	0,0032	0,2631%	0,0630%	2,3133%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 1.948.732,15	R\$ 1.938.473,81	2,3700	(0,5264)	(0,5264)	1,2951%	-1,0501%	4,8552%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 7.224.367,72	R\$ 7.187.828,33						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 519.347,06	R\$ 499.584,59	7,9600	(3,8053)	(3,8100)	-0,1049%	-7,4703%	-10,4574%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.599.265,80	R\$ 1.558.837,59	5,2345	(0,6156)	(2,5279)	1,9428%	-3,1279%	NC
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 507.202,10	R\$ 480.009,97	4,8862	(1,3746)	(5,3612)	-2,1014%	-6,6621%	-0,2020%
OCCAM FIC FIA	R\$ 2.076.040,01	R\$ 2.006.223,91	10,1100	(3,1300)	(3,3629)	3,0766%	-6,3876%	NC
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.178.970,83	R\$ 1.375.299,52	0,3500	3,7500	4,4700	8,7670%	8,3876%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 5.880.825,80	R\$ 5.919.955,58						

TOTAL GERAL	R\$ 13.105.193,52	R\$ 13.107.783,91						
--------------------	--------------------------	--------------------------	--	--	--	--	--	--

Quadro 13.

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

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.305.447,91	R\$ 2.277.495,45	1,891225	0,785400	1,422374	4,1521%	2,2189%	12,1643%
TOTAL GERAL	R\$ 2.305.447,91	R\$ 2.277.495,45						

Quadro 14.

Nota: Realizado o pagamento de Cupom de juros semestrais de NTN B no valor de R\$ 60.520,47, motivo da redução do valor aplicado.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	29/01/2021	26/02/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 13.105.193,52	R\$ 13.107.783,91
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.305.447,91	R\$ 2.277.495,45
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 15.410.641,43	R\$ 15.385.279,36

Quadro 15.

3.4 Evolução dos Recursos – ALE/FPREV

Mês	Recursos ALE FPREV	Evolução		
		Mensal	Anual	12 Meses
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%
jan/21	R\$ 15.410.641,43	1,61%	1,61%	21,00%
fev/21	R\$ 15.385.279,36	-0,17%	1,44%	20,80%

Quadro 16.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

3.5 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial



Curitiba, 13 de março de 2021.

Cliente: GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do(a) **Assembleia** para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 28/02/2021.

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 02/2020		RS 12.745.197,26	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
03/2020	RS 116.289,97	RS 0,00	RS 116.289,97
04/2020	RS 119.283,88	RS 0,00	RS 119.283,88
05/2020	RS 119.498,47	RS 0,00	RS 119.498,47
06/2020	RS 118.639,37	RS 0,00	RS 118.639,37
07/2020	RS 118.639,37	RS 0,00	RS 118.639,37
08/2020	RS 154.104,87	RS 0,00	RS 154.104,87
09/2020	RS 170.237,76	RS 0,00	RS 170.237,76
10/2020	RS 143.453,76	RS 0,00	RS 143.453,76
11/2020	RS 143.747,84	RS 0,00	RS 143.747,84
12/2020	RS 133.342,71	RS 0,00	RS 133.342,71
01/2021	RS 286.790,86	RS 0,00	RS 286.790,86
02/2021	RS 143.097,24	RS 0,00	RS 143.097,24
Saldo dos Investimentos em 02/2021		RS 15.385.279,36	

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	5,1953 %	1,1121 %	0,8600 %
Juros	5,4500 %	0,8884 %	0,4432 %
Meta	10,9284 %	2,0104 %	1,3070 %
Rentabilidade em %	6,4865 %	-1,3814 %	-1,0931 %
Rentabilidade em RS	RS 872.956,00	RS -211.510,33	RS -168.459,31
Resultado em %	-4,0044 %	-3,3250 %	-2,3692 %
Resultado em RS	RS -597.175,87	RS -519.293,91	RS -369.878,47

Quadro 17.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.689.610,99	R\$ 7.650.582,95	1,3207	0,0253	(0,5075)	0,8320%	-0,4823%	NC
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.570.408,48	R\$ 40.172.100,04	2,4800	(0,5800)	(0,9579)	0,9097%	-1,5323%	4,0486%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 98.709.563,90	R\$ 97.807.421,45	2,3790	(0,5523)	(0,9139)	0,8831%	-1,4612%	4,4043%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 146.969.583,37	R\$ 145.630.104,44						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRANCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 23.301.328,09	R\$ 24.057.402,07	9,4300	(3,3100)	(3,0870)	2,5416%	-3,3100%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 23.301.328,09	R\$ 24.057.402,07						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 6.426,30	R\$ 12.906,21
TOTAL RECURSOS	R\$ 170.277.337,76	R\$ 169.700.412,72

Quadro 18.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV



Curitiba, 13 de março de 2021.

Cliente: GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do(a) **Ministério Público** para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 28/02/2021.

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 02/2020		RS 147.760.135,60	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
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
02/2021	RS 1.585.217,06	RS 9.707,31	RS 1.575.509,75
Saldo dos Investimentos em 02/2021		RS 169.687.506,51	

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	5,1953 %	1,1121 %	0,8600 %
Juros	5,4500 %	0,8884 %	0,4432 %
Meta	10,9284 %	2,0104 %	1,3070 %
Rentabilidade em %	2,1229 %	-2,4234 %	-1,2717 %
Rentabilidade em RS	RS 3.298.295,74	RS -4.138.021,85	RS -2.165.341,00
Resultado em %	-7,9380 %	-4,3464 %	-2,5454 %
Resultado em RS	RS -13.667.404,92	RS -7.570.548,07	RS -4.390.888,72

Quadro 19

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ -	R\$ 15.462,07	-	-	-	0,0000%	0,0000%	NC
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 6.863.660,99	R\$ 7.808.253,67	1,3207	0,0253	(0,5075)	0,8320%	-0,4823%	NC
BRASESCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.604.956,06	R\$ 8.522.529,39	2,4800	(0,5800)	(0,9579)	0,9097%	-1,5323%	3,7666%
BRASESCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.721.053,40	R\$ 9.598.969,70	1,7800	(0,0200)	(0,7911)	0,9546%	-0,8109%	4,1151%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 16.819,87	R\$ 12.001,73						
TOTAL	R\$ 25.328.013,69	R\$ 25.957.216,56						

Quadro 20.

Nota 1: Os Novos Recursos foram direcionados para os fundos Caixa FIA Consumo e Caixa Gestão Estratégica.

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV



Curitiba, 13 de março de 2021.

Cliente: GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do(a) Defensoria para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 28/02/2021.

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 02/2020		RS 13.406.924,99	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
03/2020	RS 810.969,30	RS 0,00	RS 810.969,30
04/2020	RS 818.197,74	RS 0,00	RS 818.197,74
05/2020	RS 954.963,10	RS 0,00	RS 954.963,10
06/2020	RS 808.818,93	RS 0,00	RS 808.818,93
07/2020	RS 809.559,37	RS 0,00	RS 809.559,37
08/2020	RS 951.659,78	RS 0,00	RS 951.659,78
09/2020	RS 950.378,64	RS 0,00	RS 950.378,64
10/2020	RS 952.657,42	RS 0,00	RS 952.657,42
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
Saldo dos Investimentos em 02/2021		RS 25.945.214,83	

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	5,1953 %	1,1121 %	0,8600 %
Juros	5,4500 %	0,8884 %	0,4432 %
Meta	10,9284 %	2,0104 %	1,3070 %
Rentabilidade em %	4,1306 %	-1,0413 %	-0,8444 %
Rentabilidade em RS	RS 760.940,81	RS -263.360,76	RS -212.848,69
Resultado em %	-6,1281 %	-2,9915 %	-2,1237 %
Resultado em RS	RS -1.245.470,16	RS -771.844,42	RS -542.300,91

Quadro 21.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 204.272.695,73	R\$ 163.342.497,19	1,3207	0,0253	(0,5075)	0,8320%	-0,4823%	NC
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.517.311,31	R\$ 51.046.475,95	2,3790	(0,5523)	(0,9139)	0,8831%	-1,4612%	NC
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 140.446.104,72	R\$ 159.676.124,67	1,5256	0,1769	(0,5482)	1,1477%	-0,3723%	NC
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 43.108.294,32	R\$ 42.453.980,72	2,4800	(0,0200)	(0,7911)	1,6489%	-0,8109%	6,4227%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 439.344.406,08	R\$ 416.519.078,53						

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 10.292.739,97	R\$ 9.740.925,27	4,8860	(1,3746)	(5,3612)	12,3748%	-1,3746%	NC
BRDESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 3.019.524,85	R\$ 4.595.725,94	-	(3,3100)	(3,0872)	-3,3100%	-3,3100%	NC
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ -	R\$ 23.471.242,39	-	-	-	0,0000%	0,0000%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 13.312.264,82	R\$ 37.807.893,60						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1.764.244,09	R\$ 31.064,68						
TOTAL	R\$ 454.420.914,99	R\$ 454.358.036,81						

Quadro 22.

Nota 1: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo BB Global Select.

Nota 2: Foi resgatado o montante de R\$ 40.000.000,00 do Fundo Caixa Gestão Estratégica e aplicados nos fundos BB Global Select e BB Previdenciário IDKA2.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV



Curitiba, 13 de março de 2021.

Cliente: GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do(a) **Tribunal de Justiça** para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 28/02/2021.

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 02/2020		RS 26.955.991,45	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
03/2020	RS 2.647.202,34	RS 269.053,00	RS 2.378.149,34
04/2020	RS 3.365.431,19	RS 341.730,86	RS 3.023.700,33
05/2020	RS 5.222.844,03	RS 280.083,57	RS 4.942.760,46
06/2020	RS 2.652.044,89	RS 345.842,60	RS 2.306.202,29
07/2020	RS 3.093.956,95	RS 155.165,84	RS 2.938.791,11
08/2020	RS 3.115.630,27	RS 491.741,78	RS 2.623.888,49
09/2020	RS 381.166.785,90	RS 305.986,37	RS 380.860.799,53
10/2020	RS 3.325.215,77	RS 305.986,37	RS 3.019.229,40
11/2020	RS 3.555.836,55	RS 303.719,14	RS 3.252.117,41
12/2020	RS 6.779.546,58	RS 408.928,65	RS 6.370.617,93
01/2021	RS 3.459.800,94	RS 280.567,30	RS 3.179.233,64
02/2021	RS 3.471.253,44	RS 314.749,25	RS 3.156.504,19
Saldo dos Investimentos em 02/2021		RS 454.326.972,13	

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	5,1953 %	1,1121 %	0,8600 %	
Juros	5,4500 %	0,8884 %	0,4432 %	
Meta	10,9284 %	2,0104 %	1,3070 %	
Rentabilidade em %	4,6707 %	-0,7813 %	-0,7153 %	
Rentabilidade em RS	RS 9.318.986,56	RS -3.540.097,90	RS -3.250.447,05	
Resultado em %	-5,6413 %	-2,7366 %	-1,9962 %	
Resultado em RS	RS -12.174.755,43	RS -12.649.473,87	RS -9.189.789,57	

Quadro 23.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)							
	29/01/2021	26/02/2021	nov/20	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 42.075.295,01	R\$ 41.861.745,01	0,8200	1,3207	0,0253	(0,5075)	0,8320%	-0,4823%	NC	
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 30.140.100,99	R\$ 29.974.861,26	0,2156	-	0,1769	(0,5482)	-0,3723%	-0,3723%	NC	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.390.569,80	R\$ 21.195.073,63	0,8479	2,3790	(0,5523)	(0,9139)	0,8831%	-1,4612%	NC	
BRDESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.575.834,35	R\$ 7.515.903,05	1,3000	1,7800	(0,0200)	(0,7911)	0,9546%	-0,8109%	5,6958%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 101.181.800,15	R\$ 100.547.582,95								

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)							
	29/01/2021	26/02/2021	nov/20	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 10.292.739,97	R\$ 9.740.925,27	8,6332	4,8862	(1,3746)	(5,3612)	-2,1014%	-6,6621%	NC	
BRDESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ -	R\$ 488.763,13	-	-	-	-	0,0000%	0,0000%	NC	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ -	R\$ 517.193,58	-	-	-	-	0,0000%	0,0000%	NC	
TOTAL	R\$ 10.292.739,97	R\$ 10.746.881,98								

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 7.943,52	R\$ 7.943,52
TOTAL	R\$ 111.482.483,64	R\$ 111.302.408,45

Quadro 24.

Nota 1: Os Novos Recursos foram direcionados para o fundo BB Global Select e Bradesco IBRX Alpha.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV



Curitiba, 13 de março de 2021.

Cliente: GOVERNO DO ESTADO DO AMAZONAS

Prezado(a) cliente,

Encaminhamos os resultados da rentabilidade do(a) **Tribunal de Contas** para acompanhamento do desempenho dos resultados financeiros posicionado em 28/02/2021.

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 02/2020		RS 4.696.470,07	
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)
03/2020	RS 245.127,45	RS 0,00	RS 245.127,45
04/2020	RS 770.472,25	RS 0,00	RS 770.472,25
05/2020	RS 446.927,24	RS 0,00	RS 446.927,24
06/2020	RS 447.429,30	RS 0,00	RS 447.429,30
07/2020	RS 522.267,78	RS 0,00	RS 522.267,78
08/2020	RS 522.585,60	RS 0,00	RS 522.585,60
09/2020	RS 99.120.333,45	RS 0,00	RS 99.120.333,45
10/2020	RS 521.775,18	RS 0,00	RS 521.775,18
11/2020	RS 1.032.124,86	RS 0,00	RS 1.032.124,86
12/2020	RS 521.263,88	RS 0,00	RS 521.263,88
01/2021	RS 7.943,52	RS 0,00	RS 7.943,52
02/2021	RS 1.040.178,80	RS 0,00	RS 1.040.178,80
Saldo dos Investimentos em 02/2021		RS 111.294.464,93	

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	5,1953 %	1,1121 %	0,8600 %	
Juros	5,4500 %	0,8884 %	0,4432 %	
Meta	10,9284 %	2,0104 %	1,3070 %	
Rentabilidade em %	2,9022 %	-1,4616 %	-1,1017 %	
Rentabilidade em RS	RS 1.399.565,55	RS -1.635.320,23	RS -1.228.197,51	
Resultado em %	-7,2355 %	-3,4036 %	-2,3776 %	
Resultado em RS	RS -3.768.226,19	RS -3.884.666,52	RS -2.685.288,57	

Quadro 25.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV



Curitiba, 13 de março 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 28/02/2021.

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 02/2020				RS 5.353.393.063,48
Período	Receitas (RS)	Despesas (RS)	Resultado (RS)	
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 69.117.015,50	RS -61.763.734,26	
02/2021	RS 48.287.563,46	RS 58.450.548,58	RS -10.162.985,12	
Saldo dos Investimentos em 02/2021				RS 5.431.463.875,47

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	5,1953 %	1,1121 %	0,8600 %	
Juros	5,4500 %	0,8884 %	0,4432 %	
Meta	10,9284 %	2,0104 %	1,3070 %	
Rentabilidade em %	5,0101 %	-1,4010 %	-0,4903 %	
Rentabilidade em RS	RS 263.310.783,65	RS -77.759.535,68	RS -26.809.619,90	
Resultado em %	-5,3353 %	-3,3442 %	-1,7741 %	
Resultado em RS	RS -311.097.083,06	RS -189.345.113,31	RS -98.282.820,67	

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 – Fevereiro/2021

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	29/01/2021	26/02/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.536.392,01	R\$ 1.615.012,89
FUNDO BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 5.294.451,70	R\$ 5.340.829,83
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 34.793,80	R\$ 13.695.820,07
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 218.117,79	R\$ 223.433,51
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 7.083.756,32	R\$ 20.875.097,32

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	
	29/01/2021	26/02/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 4.327,77	R\$ 8.036,85
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 1,00	R\$ 1,00
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FTEMP	R\$ -	R\$ -
BRADESCO DI PREMIUM - FTEMP	R\$ 13.347.623,72	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ -	R\$ 10.005,15
TOTAL	R\$ 13.351.952,49	R\$ 18.043,00

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	
	29/01/2021	26/02/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ -

Quadro 29.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/01/2021	26/02/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 402.320,23	R\$ 404.930,78
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 58.703,59	R\$ 47.155,86
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 461.024,82	R\$ 452.087,64

Quadro 30.

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/01/2021	26/02/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.596.078,93	R\$ 952.510,68
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 1.596.079,93	R\$ 952.511,68

Quadro 31.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/01/2021	26/02/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 8.433.786,43	R\$ 7.912.393,77
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ -	R\$ 521.978,30
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 8.433.786,43	R\$ 8.434.373,07

Quadro 32.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	29/01/2021	26/02/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 3.799.598,79	R\$ 1.918.634,83
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 36.346,03	R\$ -
TOTAL	R\$ 3.835.944,82	R\$ 1.918.634,83

Quadro 33.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 47.439,27	R\$ 12.417.649,92	0,1800	0,1500	0,0800	0,4105%	0,2301%	1,7533%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 37.017.759,17	R\$ 36.829.878,31	1,3207	0,0253	(0,5075)	0,8320%	-0,4823%	4,6417%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 37.065.199,44	R\$ 49.247.529,23						

Quadro 34.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.359.549,05	R\$ 359.975,44	0,1800	0,1500	0,0800	0,4105%	0,2301%	1,7533%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 37.881,30						
TOTAL	R\$ 1.359.549,05	R\$ 359.975,44						

Quadro 35.

Nota: Transferido o valor de R\$ 1.000.000,00 para a conta operacional dos recursos da Taxa de Administração (20.400-5 Bradesco) em 02/02/2021, com o objetivo de pagar as despesas administrativas dessa Amazonprev.

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 856.568,30	R\$ 218.106,73	0,1800	0,1500	0,0800	0,4105%	0,2301%	1,7533%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 40.154,37	R\$ -						
TOTAL	R\$ 896.722,67	R\$ 218.106,73						

Quadro 36.

Nota: Transferido o valor de R\$ 750.000,00 para a conta operacional dos recursos da Taxa de Administração (20.400-5 Bradesco) em 22/02/2021, com o objetivo de pagar as despesas administrativas dessa Amazonprev.

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.877.978,95	R\$ 879.387,89	0,1800	0,1500	0,0800	0,4105%	0,2301%	1,7533%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 1,00						
TOTAL	R\$ 1.877.978,95	R\$ 879.388,89						

Quadro 37.

Nota: Transferido o valor de R\$ 1.000.000,00 para a conta operacional dos recursos da Taxa de Administração (20.400-5 Bradesco) em 22/02/2021, com o objetivo de pagar as despesas administrativas dessa Amazonprev.

10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	29/01/2021	26/02/2021	dez/20	jan/21	fev/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 757.245,11	R\$ -	0,1800	0,1500	0,0800	0,4105%	0,2301%	N/C
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -						
TOTAL	R\$ 757.245,11	R\$ -						

Quadro 38.

Nota: Transferido o valor de R\$ 757.659,40 para a conta operacional dos recursos da Taxa de Administração (20.400-5 Bradesco) em 17/02/2021, com o objetivo de pagar as despesas administrativas dessa Amazonprev.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/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 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TN	R\$ 677.067.951,32	12,51%	10,00%	100,00%	art 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 677.067.951,32				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 6.890.569,80	35,99%	22,00%	100,00%	art 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 381.617.585,74				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 489.890.553,27				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.562.700,49				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 788.733.826,56				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.394.466,34				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 90.983.769,37				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 58.672.774,69				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.947.746.246,26				
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 28.690.403,82	12,69%	13,00%	40,00%	art 7º, inciso IV, "a"
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.568.853,47				
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 54.035.459,27				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 544.484.371,10				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.427,56				
TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 686.887.515,23				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.696.670,60	0,55%	3,00%	5,00%	art 7º, inciso VII, "b"
TOTAL art 7º, inciso VII, "b"	R\$ 29.696.670,60				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.341.398.383,41	61,75%			

Quadro 39.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

11.1 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\$ 86.589.756,96	1,60%	3,00%	30,00%	art 8º, inciso I, "a"
TOTAL art 8º, inciso I, "a"	R\$ 86.589.756,96				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 38.406.022,23	28,80%	30,00%	30,00%	art 8º, inciso II, "a"
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 163.880.259,74				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 120.162.092,45				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 80.841.255,56				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 60.785.903,53				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 170.555.424,70				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 82.581.623,45				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 170.284.248,46				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 325.139.982,16				
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 50.541.736,90				
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 45.315.737,93				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 14.404,56				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.734.069,33				
OCCAM FIC FIA	R\$ 125.645.751,76				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 31.426.044,40				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.063.034,94				
TOTAL art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.558.377.592,10				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 22.186.107,00	0,41%	3,00%	3,00%	art. 8º, inciso III
TOTAL art. 8º, inciso III	R\$ 22.186.107,00				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.546.311,97	0,10%	2,00%	5,00%	art. 8º, inciso IV, "a"
TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 5.546.311,97				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.672.699.768,03	30,91%			

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	R\$ 103.573.748,06	3,99%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 87.822.626,05				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 24.505.010,57				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 76.997.124,35	3,35%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 104.439.255,60				
TOTAL art 9º - A	R\$ 397.337.764,64	7,34%			
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 397.337.764,64				
TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.411.435.916,08	100,00%			

Quadro 40.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/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\$ 6.890.569,80	0,12%	20%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 381.617.585,74	6,92%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 544.484.371,10	9,87%		
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 120.162.092,45	2,18%		
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 76.997.124,35	1,40%		
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 103.573.748,06	1,88%		
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 489.890.553,27	8,88%		
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.562.700,49	0,95%		
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 28.690.403,82	0,52%		
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.568.853,47	1,08%		
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 54.035.459,27	0,98%		
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 86.589.756,96	1,57%		
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 163.880.259,74	2,97%		
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.427,56	0,00%		
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 788.733.826,56	14,30%		
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 38.406.022,23	0,70%		
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 170.555.424,70	3,09%		
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 82.581.623,45	1,50%		
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 80.841.255,56	1,47%		
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 60.785.903,53	1,10%		
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 170.284.248,46	3,09%		
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.696.670,60	0,54%		
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.394.466,34	1,42%		
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 90.983.769,37	1,65%		
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 325.139.982,16	5,90%		
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.546.311,97	0,10%		
SANTANDER CRESCE SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 14.404,56	0,00%		
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 50.541.736,90	0,92%		
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 45.315.737,93	0,82%		
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 87.822.626,05	1,59%		
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 22.186.107,00	0,40%		
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 58.672.774,69	1,06%		
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 104.439.255,60	1,89%		
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.734.069,33	1,52%		
OCCAM FIC FIA	R\$ 125.645.751,76	2,28%		
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 31.426.044,40	0,57%		
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.063.034,94	0,16%		
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 24.505.010,57	0,44%		
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 4.734.367.964,76			

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 – Fevereiro/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\$ 6.890.569,80	19.523.305/0001-06	R\$ 245.863.748,76	2,80%	15%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 381.617.585,74	13.322.205/0001-35	R\$ 8.476.640.994,51	4,50%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 544.484.371,10	25.078.994/0001-90	R\$ 9.568.490.825,39	5,69%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 120.162.092,45	29.258.294/0001-38	R\$ 1.081.575.624,12	11,11%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 76.997.124,35	21.470.644/0001-13	R\$ 907.562.932,41	8,48%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 103.573.748,06	17.413.636/0001-68	R\$ 1.616.013.967,79	6,41%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 28.690.403,82	08.246.263/0001-97	R\$ 422.999.839,93	6,78%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.568.853,47	20.216.216.0001/04	R\$ 954.945.016,55	6,24%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 54.035.459,27	28.515.874/0001-09	R\$ 1.422.915.185,87	3,80%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 86.589.756,96	14.099.976/0001-78	R\$ 595.178.322,17	14,55%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 163.880.259,74	06.988.623/0001-09	R\$ 2.091.910.274,82	7,83%	
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 489.890.553,27	11.060.913/0001-10	R\$ 20.761.505.098,56	2,36%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.562.700,49	22.791.074/0001-26	R\$ 214.507.329,19	24,50%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 788.733.826,56	23.215.097/0001-55	R\$ 14.722.139.597,34	5,36%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 80.841.255,56	10.577.512/0001-79	R\$ 631.793.991,04	12,80%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.427,56	21.838.150/0001-49	R\$ 3.882.685.363,65	0,00%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 38.406.022,23	08.817.414/0001-10	R\$ 941.584.140,74	4,08%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 60.785.903,53	23.731.629/0001-07	R\$ 1.154.784.976,21	5,26%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 170.555.424,70	24.571.992/0001-75	R\$ 3.416.632.575,89	4,99%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 82.581.623,45	01.063.897/0001-65	R\$ 1.355.584.094,24	6,09%	
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 45.315.737,93	29.549.642/0001-26	R\$ 1.501.948.926,76	3,02%	
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 14.404,56	02.436.763/0001-05	R\$ 469.479.928,15	0,00%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 50.541.736,90	01.699.688/0001-02	R\$ 601.842.456,25	8,40%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 87.822.626,05	17.804.792/0001-50	R\$ 1.351.219.558,39	6,50%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 170.284.248,46	08.279.304/0001-41	R\$ 1.494.264.626,94	11,40%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.394.466,34	10.922.432/0001-03	R\$ 872.184.819,46	8,99%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 90.983.769,37	10.756.541/0001-06	R\$ 924.231.847,02	9,84%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 58.672.774,69	30.659.168/0001-74	R\$ 1.813.956.117,79	3,23%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 325.139.982,16	11.977.794/0001-64	R\$ 2.741.202.425,63	11,86%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 104.439.255,60	19.436.818/0001-80	R\$ 2.288.705.798,61	4,56%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.734.069,33	34.791.108/0001-61	R\$ 550.853.305,14	15,20%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 125.645.751,76	11.628.883/0001-03	R\$ 1.033.064.602,48	12,16%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 31.426.044,40	11.458.144/0001-02	R\$ 869.769.164,82	3,61%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.063.034,94	09.290.813/0001-38	R\$ 105.286.182,46	8,61%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 24.505.010,57	37.308.394/0001-50	R\$ 8.327.909.304,85	0,29%	
TOTAL	R\$ 4.676.938.875,19				

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\$ 22.186.107,00	21.595.829/0001-54	R\$ 825.903.419,31	2,69%	5%
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.546.311,97	35.640.811/0001-31	R\$ 397.607.133,85	1,39%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.696.670,60	19.719.727/0001-51	R\$ 825.779.381,34	3,60%	
TOTAL	R\$ 57.429.089,57				

TOTAL	R\$ 4.734.367.964,76
--------------	-----------------------------

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;

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

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.

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 ao PL do fundo Master.

Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large signature on the left, several smaller initials in the middle, and a signature on the right with a circled 'a' next to it.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA JANEIRO/2021) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (FEVEREIRO/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.173.250,59	R\$ 1.233.725.491,50	0,1052%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 752.185,20	R\$ 352.437.401,47	0,0469%	
BRADESCO	R\$ 529.081,09	R\$ 392.764.733,27	0,0742%	
CAIXA	R\$ 412.100,49	R\$ 1.412.028.335,88	0,3426%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 295.455,62	R\$ 183.694.505,44	0,0622%	
BANCO BTG	R\$ 144.039,87	R\$ 339.749.329,07	0,2359%	
BANCO SAFRA	R\$ 105.947,77	R\$ 185.298.137,29	0,1749%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 29.677,20	R\$ 31.426.044,40	0,1059%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 30.888,08	R\$ 369.359.154,77	1,1958%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 16.514,80	R\$ 83.734.069,33	0,5070%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 14.946,99	R\$ 125.645.751,76	0,8406%	
Schroder Investment Management Brasil Ltda.	R\$ 26.641,12	R\$ 24.505.010,57	0,0920%	

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.

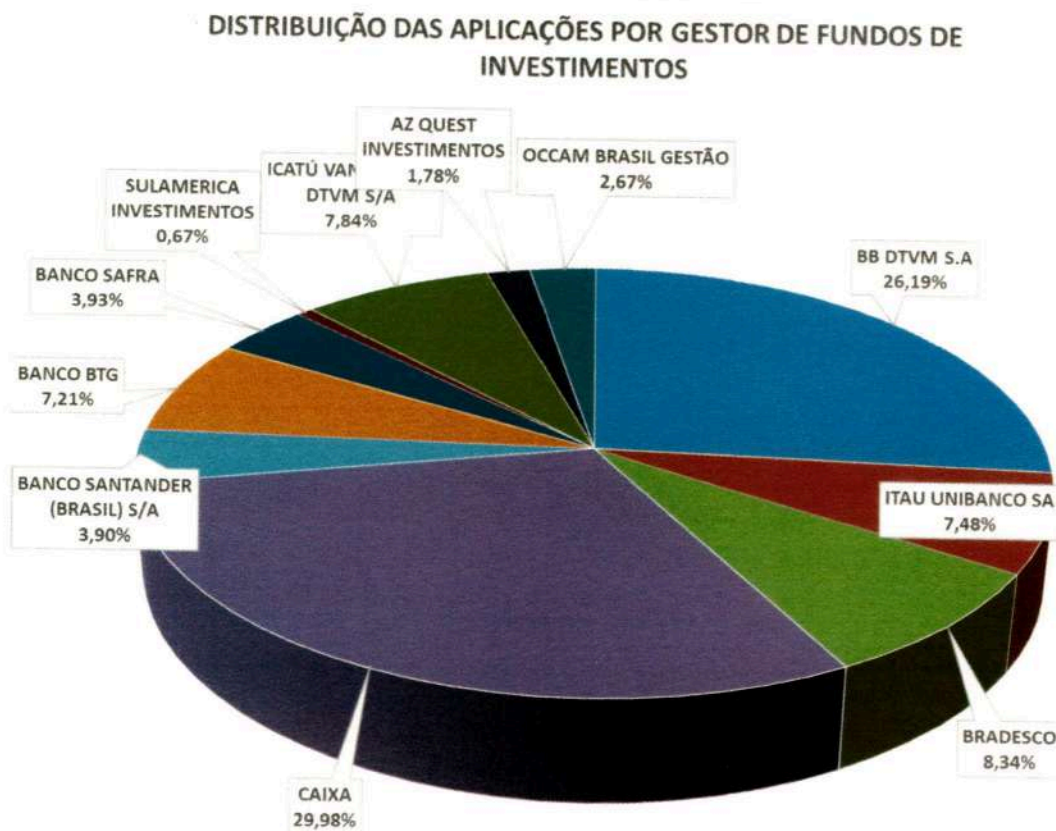


Gráfico 4.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.734.367.964,76
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 677.067.951,33
TÍTULOS - CVS	R\$ 10.158.626,16
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 31.491.553,32
TOTAL	R\$ 5.514.921.420,75

Quadro 44.

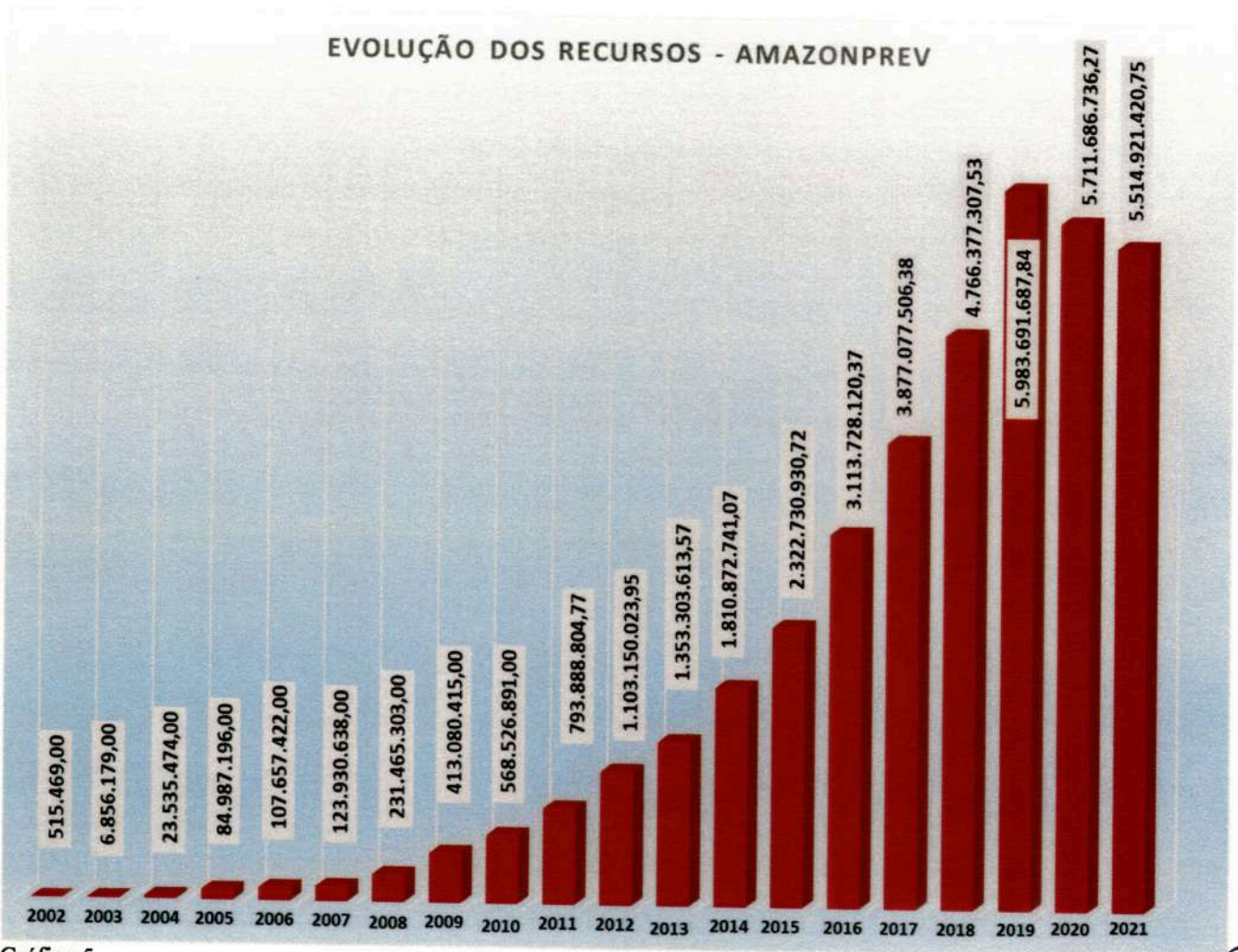


Gráfico 5.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	Novos Recursos: Ratear entre os fundos Caixa FI Brasil IMA B5 RF TP LP (11.060.913/0001-10) e Icatu Vanguarda Inflação Curta (10.922.432/0001-03)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/04/2021
	Demais Recursos: Migrar R\$ 28.000.000,00 do fundo BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA (29.258.294/0001) para o fundo Itaú Private MM SP500 BRL FICFI (26.269.692/0001-61)		
	Zerar posição no fundo ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI (23.731.629/0001-07) migrando o valor total para o fundo Itaú Private MM SP500 BRL FICFI (26.269.692/0001-61)		
FPREV ALE:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo BB MM GLOBAL SELECT (17.413.636/0001-68)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/04/2021
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo BB MM GLOBAL SELECT (17.413.636/0001-68)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/04/2021
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo BB MM GLOBAL SELECT (17.413.636/0001-68)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/04/2021
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo BB MM GLOBAL SELECT (17.413.636/0001-68)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/04/2021
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: Direcionar para o fundo BB MM GLOBAL SELECT (17.413.636/0001-68)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/04/2021
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	15/04/2021
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	15/04/2021
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	15/04/2021

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.



AMAZONPREV
Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas



RELATÓRIOS - 2021

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

[Handwritten signature]

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - FPREV - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	TOTAL APLICADO	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	fev/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocacao Ativa Fc fi	R\$ 374.435.400,07	6,30%	0,65%	-5,49	2,59%	-0,91%	-1,46%
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 6.890.569,80	2,46%	0,25%	-2,66	5,26%	-0,01%	0,27%
BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	R\$ -	19,75%	2,03%	-17,54	0,54%	-2,32%	-3,97%
Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	R\$ -	6,95%	0,72%	-5,88	2,22%	-0,96%	-1,53%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ -	5,44%	0,56%	-5,66	5,70%	-0,79%	-0,81%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 2.003.764,04	0,32%	0,03%	-0,55	1,76%	0,08%	0,23%
Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF	R\$ -			-1,47			
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 52.562.700,49	9,27%	0,95%	-9,00	0,57%	-3,80%	-3,96%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 489.890.553,27	5,06%	0,52%	-5,40	5,92%	-0,62%	-0,54%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 526.078.826,44	5,95%	0,61%	-4,27	4,64%	-0,51%	-0,48%
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 27.758.196,79	6,12%	0,63%	-6,53	5,78%	-0,53%	-0,18%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 78.394.466,34	5,27%	0,54%	-5,56	5,77%	-0,64%	-0,58%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 90.983.769,37	19,90%	2,05%	-17,78	0,55%	-2,35%	-4,03%
Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 21.116,03	1,66%	0,17%	-1,57	2,45%	0,06%	0,19%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 58.672.774,69	14,74%	1,51%	-13,09	2,80%	-1,86%	-3,50%
Santander RF Ativo Fc FI	R\$ -	1,00%	0,10%	-0,92	1,99%	-0,12%	-0,08%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 191.966.599,81	4,25%	0,44%	-4,46	6,43%	-0,55%	-0,37%
TOTAL	R\$ 1.899.658.737,14						

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	TOTAL APLICADO	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	MáxDrawdown 12M	12M	fev/21	2021
					RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Valor Fc FIA	R\$ 120.162.092,45	42,12%	4,30%	-37,88	5,91%	-5,03%	-10,33%
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 79.585.312,09	28,03%	2,90%	-19,43	67,93%	6,15%	11,35%
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nivel I	R\$ 76.997.124,35	29,47%	3,05%	-16,34	65,68%	4,08%	9,37%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 163.880.259,74	43,60%	4,40%	-41,46	1,24%	-0,77%	-3,43%
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	R\$ 57.447.865,82	44,08%	4,47%	-40,72	7,06%	-3,09%	-6,30%
BTG Pactual Absolutto Inst FIC FIA	R\$ 323.581.144,57	45,88%	4,64%	-41,14	10,28%	-2,53%	-3,13%
BTG Pactual Economia Real FIP	R\$ 5.546.311,97						
Caixa FIA Consumo	R\$ 60.863.932,98	46,12%	4,66%	-40,42	-0,20%	-5,36%	-6,66%
Icatu Vanguarda Acoes Ibrx FI	R\$ -	45,28%	4,59%	-42,05	9,23%	-2,68%	-5,30%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	R\$ 169.784.663,87	39,96%	4,06%	-0,67	-10,56%	-3,81%	-7,57%
Itau Acoes Dunamis Fc	R\$ 170.555.424,70	43,80%	4,45%	-40,48	4,60%	0,47%	-1,00%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 38.406.022,23	44,30%	4,49%	-41,97	3,30%	-3,85%	-6,10%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI	R\$ 60.785.903,53	52,44%	5,28%	-1,04	-20,50%	-4,30%	-7,08%
Itau Small Cap Master FIA	R\$ 82.581.623,45	46,73%	4,70%	-45,52	3,33%	-0,53%	-2,69%
Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	R\$ 14.404,56	43,44%	4,40%	-42,23	-3,38%	-4,29%	-7,21%
Santander FI Ibovespa Ativo Inst Acoes	R\$ 50.541.736,90	45,29%	4,59%	-43,34	-3,78%	-4,75%	-8,05%
Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	R\$ 45.315.737,93	43,40%	4,39%	-42,21	-3,36%	-4,29%	-7,19%
Santander Global Equities Dólar Master Mult Ie FI	R\$ 87.822.626,05	23,94%	2,48%	-17,03	72,33%	4,60%	10,50%
Safra S P Reais Pb FI Mult	R\$ 22.186.107,00	32,24%	3,31%	-29,22	24,11%	2,59%	2,41%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	R\$ 103.063.956,08	33,03%	3,41%	-18,23	54,45%	4,47%	8,39%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 83.734.069,33	46,36%	4,66%	-0,07	-5,01%	0,77%	-1,16%
Occam Fc de FIA	R\$ 123.639.527,85	41,68%	4,25%	-37,57	10,55%	-3,36%	-6,38%
Sul America Equities FIA	R\$ 31.426.044,40	47,84%	4,81%	-1,49	-12,28%	-3,49%	-6,63%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	R\$ 24.505.010,57			-8,49		5,34%	11,94%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 9.063.034,94	41,19%	4,18%	-38,15	-3,71%	-4,15%	-7,59%
TOTAL	R\$ 1.991.489.937,37						

TOTAL GERAL R\$ 3.891.148.674,52

Quadro 1.

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

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

Nº	Fundos	Retorno	Volatilidade
1	BB Prev RF Irf M1 Tit Publ Fc	2,71	0,58
2	BB Prev RF Tit Publ VII FI	5,26	2,46
3	BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	0,54	19,75
4	BB Prev RF Idka 2 FI	6,43	4,25
5	BB Prev RF Alocacao Ativa FcFI	2,59	6,30
6	BB Acoes Valor Fc FIA	5,91	42,12
7	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	1,76	0,32
8	Bradesco FI RF Ref DI Premium	1,83	0,26
9	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	5,70	5,44
10	Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	2,22	6,95
11	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	7,06	44,08
12	Bradesco FIA Mid Small Caps	1,24	43,60
13	FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF	2,87	0,56
14	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	5,92	5,06
15	Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF		
16	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	0,57	9,27
17	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	4,64	5,95
18	Caixa FIA Consumo	-0,20	46,12
19	Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	2,45	1,66
20	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	3,30	44,30
21	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI	-20,50	52,44
22	Itau Acoes Dunamis Fc	4,60	43,80
23	Small Cap Valuation Fc Acoes	1,81	46,18
24	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	-3,36	43,40
25	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	-3,38	43,44
26	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	-3,78	45,29
27	Santander RF Ativo Fc FI	1,99	1,00
28	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	-10,56	39,96
29	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	5,77	5,27
30	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	0,55	19,90
31	Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	9,23	45,28
32	Safra Ima Institucional Fc FI RF	2,80	14,74
33	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	10,28	45,88
34	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	54,45	33,03
35	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	-5,01	46,36
36	Occam Fc de FIA	10,55	41,68
37	Sul America Equities FIA	-12,28	47,84
38	Safra S P Reais Pb FI Mult	24,11	32,24
39	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	5,78	6,12
40	BB Mult Global Select Equity Ie FI	67,93	28,03
41	BTG Pactual Economia Real FIP		
42	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	-3,71	41,19
43	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie		

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

2. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

DATA BASE EM 26.02.21

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,34	1,96%	55,5%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,25	2,06%	13,5%
CDB	1,68	0,71%	0,0%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	1,33	2,45%	1,1%
BOND	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,68	-	27,1%
Over	0,00	-	2,8%
Carteira Crédito	3,09	1,98%	70,1%
Crédito - Contribuição Fundo	1,01	1,39%	70,1%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	2,86	1,39%	100,0%

Quadro 03

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financeiro	% PL
AAA	172.342.560	19,8%
AA+	113.970.936	13,1%
AA	138.946.903	16,0%
AA-	74.598.272	8,6%
A+	57.474.016	6,6%
DPGE	0	0,0%
A	0	0,0%
A-	18.861.991	2,2%
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-	9.671.564	1,1%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Rating	23.948.285	2,8%
Tesouro / Over	259.818.781	29,9%
Total	869.633.307	100,0%

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

Quadro 04.

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

TABELA - SETOR		
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	162.785.385	18,7%
Bancos	117.276.708	13,5%
Conc. Rodoviárias	76.945.668	8,8%
Saneamento	58.167.869	6,7%
Serviço	54.127.924	6,2%
Varejo	49.705.268	5,7%
Shopping Center	33.446.686	3,8%
Infraestrutura	16.773.892	1,9%
Mineração e Siderurgia	10.465.302	1,2%
Logística	10.003.721	1,2%
Óleo e Gás	7.548.787	0,9%
Indústria e Comércio	5.331.634	0,6%
Papel e Celulose	4.124.780	0,5%
Holding	3.110.903	0,4%
Tesouro / Over	259.818.781	29,9%
Total	869.633.307	100,0%

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 26/02/2021)



PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 17 de março de 2021, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de fevereiro/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, 17 de março de 2021.

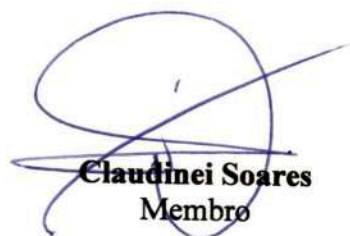

Alan Nascimento
Coordenador


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

Relatório de Investimentos – Fevereiro/2021

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: