

Relatório de Investimentos – Março/2021

Destino: DIRAF / PRESI

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

Data: 16/04/2021

RELATÓRIO Nº. 004 / 2021 – COMIV

Senhores Diretores,

O Comitê de Investimentos – COMIV apresenta o Relatório de Investimentos referente ao mês de **março/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) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Assembleia Legislativa do Estado do Amazonas – ALE/FPREV (páginas 13 a 14)
- 4) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Ministério Público Estadual/PGJ – MPE-PGJ/FPREV (página 14 e 15)
- 5) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV - Defensoria Pública Estadual – DPE/FPREV - (página 15 a 16)
- 6) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Justiça – TJ/FPREV - (página 16 a 17)
- 7) Recursos do Fundo Previdenciário – FPREV – Tribunal de Contas do Amazonas – TCE/FPREV - (página 18)
- 8) Rentabilidade do Fundo Previdenciário - Consolidado – FPREV (página 19 a 20)
- 9) Disponibilidades do Fundo Financeiro – (páginas 21 a 22)
- 10) Disponibilidades da Taxa de Administração - (páginas 22 a 23)
- 11) Enquadramento das Aplicações Financeiras - (páginas 23 a 28)
- 12) Total dos Recursos e Evolução Histórica dos Recursos da Amazonprev (páginas 28 a 29)
- 13) Plano de Ação Mensal: Estratégia mensal para Alocação de Recursos (página 30)
- 14) Relatório de Riscos da Carteira (página 35 a 36)
- 15) Parecer do Comitê de Investimentos (página 37).
- 16) Parecer do Conselho Fiscal (página 38).
- 17) Parecer do Conselho de Administração (página 39).



1. CENÁRIO E PERSPECTIVAS

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

Brasil: Copom eleva Selic em 75 pontos-base e indica início de normalização parcial

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

O Banco Central surpreendeu as expectativas do mercado ao elevar a taxa básica de juros em 75 pontos-base. Em decisão unânime, a autoridade monetária decidiu por aumentar a taxa Selic de 2,00% para 2,75% ao ano. O Banco Central avaliou que o cenário já não prescreve um grau de estímulo extraordinário e decidiu, assim, iniciar um processo de normalização parcial. Os principais motivos para a reavaliação foram o forte crescimento do PIB no quarto trimestre de 2020 e a elevação de expectativas e de projeções de inflação, que atualmente se situam acima da meta estabelecida para o ano de 2021. Para a próxima reunião, o Banco Central indicou um aperto monetário de mesma magnitude. Segundo o comitê, “uma estratégia de ajuste mais célere do grau de estímulo tem como benefício reduzir a probabilidade de não cumprimento da meta de inflação deste ano, assim como manter a ancoragem das expectativas para horizontes mais longos”. O documento reforça que a incerteza a respeito do cenário econômico segue acima da usual, principalmente em relação aos efeitos sobre a atividade do aumento de restrições de mobilidade em resposta ao crescimento do número de casos de Covid-19 no país. Esperamos que o ciclo de elevação da taxa de juros continue nas próximas reuniões, com a Selic alcançando 5,25% ao final deste ano.

A prévia da inflação ao consumidor (IPCA-15) variou 0,93% na comparação mensal em março. O principal fator para a inflação atual mais pressionada - nos últimos quatro anos, por exemplo, a média desse indicador para março ficou em 0,37% - foi a alta de combustíveis. Itens como gasolina e óleo diesel tiveram forte aceleração nesta leitura, refletindo os recentes reajustes dos preços na refinaria. O etanol, por ser, em geral, um produto substituto aos demais combustíveis, também se elevou. Por outro lado, tivemos alívio modesto na inflação de alimentos, com quedas em produtos in natura e leite. Em termos de núcleos, que são métricas que excluem ou suavizam itens com inflação volátil, a leitura de março mostrou variações em linha com o esperado. De toda forma, a média dos núcleos segue acelerando no acumulado em doze meses, subindo de 3,0% para 3,3% na passagem do mês.

O Índice do Banco Central de atividade (IBC-Br) avançou 1,0% na margem em janeiro. O indicador prévio do PIB registrou alta em linha com a nossa projeção (1,1%), mas acima da mediana do mercado (0,5%). O resultado refletiu a alta da indústria (0,4%) e do volume de serviços (0,6%) no mês, contrabalançada pela queda das vendas no varejo ampliado (-2,1%). Na comparação interanual, o índice teve recuo de 0,5%. O IBC-Br já se situa 0,7% acima do patamar pré-pandemia (média de janeiro e fevereiro de 2020) e o dado de janeiro aponta para crescimento de 1,8% em relação ao último trimestre de 2020. No entanto, os dados



3

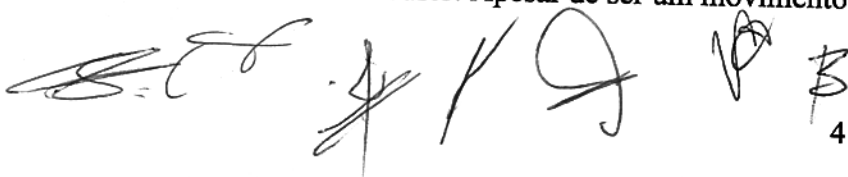
de fevereiro e março deverão sofrer o impacto das novas restrições de mobilidade decorrentes da piora da pandemia.

Nos EUA, o Fed manteve a taxa de juros entre 0% e 0,25% e indicou que a maior parte do comitê enxerga a manutenção da taxa de juros nesse patamar até o final de 2023. Sobre a atividade econômica, o banco central americano reconheceu que, após uma moderação na recuperação no final de 2020, os indicadores mais recentes apresentaram recuperação. Também houve elevação das projeções dos membros do comitê para o crescimento econômico deste ano, o que deve incorporar o novo pacote fiscal recentemente aprovado. Apesar disso, o comitê afirma que ainda há uma grande disparidade de crescimento entre os setores, tendo em vista o impacto adverso assimétrico causado pela pandemia. Sobre a política monetária, o plano segue sendo de manter o patamar atual da taxa de juros e o programa de compra de ativos de US\$120 bilhões mensais até que haja um avanço substancial em direção ao alcance das metas de pleno emprego e do objetivo para a inflação. Mas, de acordo com a distribuição de projeções dos membros do comitê, a maioria prevê que esse avanço não se dará antes de 2023, colocando uma perspectiva de postura acomodatória por um tempo prolongado.

O Banco Central Europeu (BCE) manteve a política de juros e de compra de ativos. O BCE manteve o patamar da taxa de depósito em -0,5%, da taxa de refinanciamento em 0,0% e da taxa de empréstimo em 0,25%. O Programa Pandêmico de Compras Emergenciais (PEPP na sigla em inglês) foi mantido em € 1,85 trilhão em compra de ativos, com horizonte de compras até março de 2022 ou até o BCE julgar que a crise atual tenha se encerrado. Os demais programas de estímulos também não sofreram alteração. A novidade ficou por conta do comprometimento em aumentar as compras de ativos nos próximos meses e favorecer as condições financeiras. Avaliamos que as medidas de restrição terão impacto menor sobre a atividade em relação ao que foi observado na primeira onda. Ainda assim, os estímulos serão mantidos por período prolongado.

A prévia dos índices de confiança (PMI) de março revelou melhora da percepção na Zona do Euro, mas não nos EUA. O PMI Composto prévio da Zona do Euro, que incorpora as expectativas da indústria e dos serviços, atingiu 52,5 pontos em março ante 48,8 em fevereiro, sinalizando uma reversão do sentimento na região (nível acima de 50 pontos indica expansão). A melhora da atividade na região ficou concentrado na indústria, enquanto o setor de serviços segue em contração. Nos EUA, o PMI Composto cedeu de 59,5 pontos em fevereiro para 59,1 pontos em março. Ao contrário da Zona do Euro, o setor de serviços na economia americana aponta expansão, em linha com a melhora da perspectiva de mobilidade com o avanço da vacinação.

Perspectivas Renda Fixa – Com uma grande oferta de vacinas, os EUA têm uma expectativa de vacinar toda a população até o dia da independência em 4 de julho. Esse processo impulsiona a recuperação da atividade e vem acompanhado por um pacote de incentivos bastante robusto. Apesar de ser um movimento



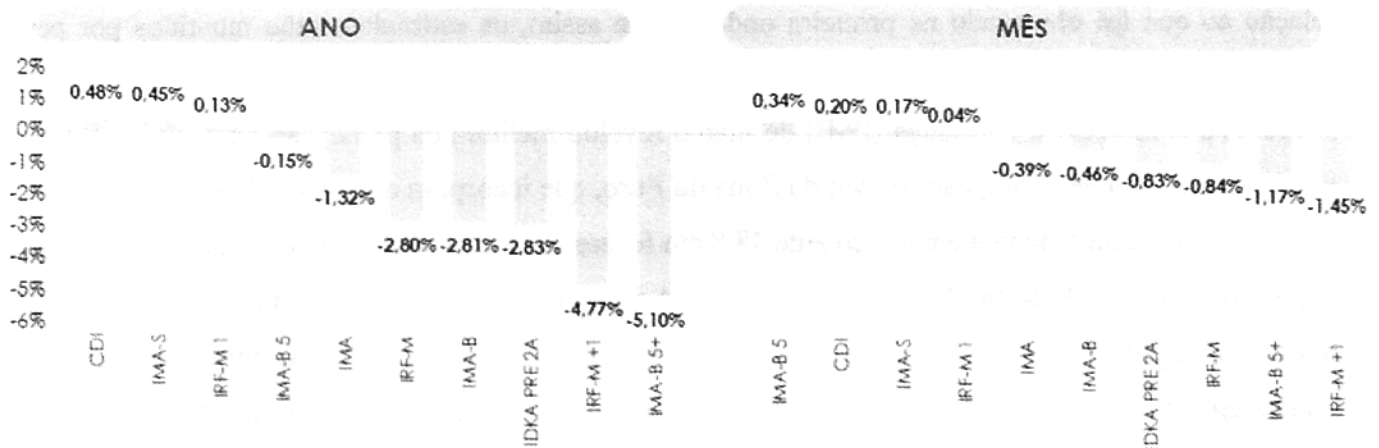
Relatório de Investimentos – Março/2021

positivo para o crescimento, tem reflexos negativos sobre a inflação, que pressiona as taxas de juros de 5 e 10 anos. Além disso, há um aumento nos preços das commodities, que são puxadas pelo processo de recuperação chinesa. Por fim, o contágio por COVID-19 ainda gera incerteza, com uma piora visível na Europa e Brasil.

O Brasil é o epicentro da pandemia, com uma segunda onda bastante forte. Novos auxílios, além dos já aprovados, são cogitados para frear o impacto na economia. A piora na incerteza vem do quadro fiscal que continua sofrendo com as investidas por parte dos parlamentares para aumento nos gastos. A preocupação está mais no curto prazo, acompanhando a piora do quadro de infecção. Com relação a inflação, o Banco Central vê o final do ajuste parcial em 4,5% neste ano, ainda abaixo da taxa neutra. Apesar das medidas restritivas impactarem a atividade, o BC está agindo para manter as expectativas ancoradas, porém os agentes de mercado acreditam em uma necessidade de aperto superior ao desenhado pelo BC. As mudanças no cenário da BRAM estão mais voltadas para os ajustes em inflação para 2021 de 4,9% e uma Selic de 5,25%.

Neste mês, destaque positivo para os ativos de renda fixa atrelados à inflação de curto prazo, representado pelo índice da Anbima IMA-B5. A inflação corrente tem contribuído com essa classe. Novamente, o IMA-S, índice de LFTs, ficou abaixo do CDI, terminando o mês com 85% do CDI. Os ativos prefixados e de inflação mais longa continuam sofrendo devido ao aumento da incerteza, principalmente fiscal. Nesse sentido, o câmbio continua na tendência de alta, agora suportado por um dólar mais estável no mundo, com aumento de 3,02%, fechando março a R\$ 5,6973.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA FIXA



Fonte: Carta ao Gestor_BRAM Abril/2021

Relatório de Investimentos – Março/2021

Perspectivas Renda Variável – Março foi mais um mês de recuperação das bolsas em geral. Neste mês, além da expectativa de forte crescimento nos países desenvolvidos, em especial nos EUA, no Brasil, o mercado tenta antecipar os efeitos positivos da diminuição da pandemia no futuro, apesar do clima bastante desafiador no presente.

O S&P 500 teve retorno de 4,24% e o Nasdaq teve retorno de 0,41%, ambos acumulando alta no ano de 5,77% e 2,78% respectivamente (em moeda original). O Ibovespa teve mais um mês de forte recuperação com retorno positivo de 6,00%, totalizando queda de -2,00% no ano.

O fluxo do investidor estrangeiro continua negativo desde fevereiro, porém o mercado de capitais permanece aquecido. O alto número de casos de COVID-19 e a incerteza em torno da condução da política fiscal do governo brasileiro têm pesado sobre os ativos brasileiros em geral.

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. Atrasos no cronograma de vacinação contra o COVID-19, assim como eventuais dificuldades na recuperação da economia brasileira permanecem como pontos de atenção no curto prazo. Para a gestão, 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, ocorreu um forte movimento de valorização dos setores mais impactados pela pandemia. Para a gestão, o mercado está antecipando a dinâmica de volta à normalidade na economia, neste contexto destacam-se os setores de Shoppings & Properties, Bancos e Petróleo. Por outro lado, setores que se valorizaram bastante sofreram devido a realização de lucro dos investidores, onde pode-se citar Papel & Celulose, Telecom & Tecnologia e Saúde.

RENTABILIDADE DOS PRINCIPAIS BENCHMARKS DE RENDA VARIÁVEL

	MARÇO	2021	12 MESES	24 MESES	36 MESES
IBOVESPA	6,00%	-2,00%	59,73%	22,24%	36,63%
SMLL	4,56%	-0,88%	64,58%	44,87%	61,92%
IBRX 100	6,04%	-0,72%	62,17%	26,16%	42,14%
IDIV	7,57%	-3,21%	39,35%	28,51%	46,14%
S&P 500 (USD)	4,24%	5,77%	53,71%	40,17%	50,44%
MSCI WORLD (USD)	3,11%	4,52%	51,76%	33,40%	36,12%

Fonte: Carta ao Gestor_BRAM Abril/2021.



Relatório de Investimentos – Março/2021

2. RECURSOS DO FUNDO PREVIDENCIÁRIO – FPREV EXECUTIVO

2.1 SALDOS E PERFORMANCE RENDA FIXA

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 374.435.400,07	R\$ 323.104.855,81	(0,5523)	(0,9139)	(0,4211)	-1,8761%	-1,8761%	4,3462%
BB PREVID TP VII	R\$ 6.890.569,80	R\$ 6.917.542,68	0,2867	(0,0122)	0,3900	0,6655%	0,6655%	7,1063%
BB PREVID IDKA 2	R\$ 191.966.599,81	R\$ 242.498.686,68	0,1769	(0,5482)	0,3700	-0,0036%	-0,0036%	NC
BRADESCO MAXI PODER PUBLICO	R\$ 2.003.764,04	R\$ 3.810.813,16	0,1500	0,0800	0,1900	0,4206%	0,4206%	1,6346%
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	R\$ 52.562.700,49	R\$ 52.598.778,27	(0,1600)	(3,8000)	0,0700	-3,8867%	-3,8867%	3,4315%
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 489.890.553,27	R\$ 480.385.103,60	0,0832	(0,6197)	0,3115	-0,2272%	-0,2272%	8,1960%
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 526.078.826,44	R\$ 527.662.583,20	0,0253	(0,5075)	0,3010	-0,1828%	-0,1828%	5,0939%
ICATU VANG. FI RF INFLA. CRED. PRIVADO	R\$ 27.758.196,79	R\$ 27.850.646,66	0,3500	(0,5300)	0,3300	0,1475%	0,1475%	11,0202%
ICATU VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 78.394.466,34	R\$ 108.518.916,55	0,0600	(0,6400)	0,2800	-0,3020%	-0,3020%	8,0444%
ICATU VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 90.983.769,37	R\$ 60.340.348,32	(1,7300)	(2,3500)	(1,2150)	-5,2053%	-5,2053%	11,6287%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI	R\$ 21.116,03	R\$ 21.146,55	0,1339	0,0600	0,1400	0,3343%	0,3343%	2,0455%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 58.672.774,69	R\$ 28.510.074,44	(1,6700)	(1,8600)	(0,8158)	-4,2862%	-4,2862%	9,2870%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 1.899.658.737,14	R\$ 1.862.219.495,92						

Quadro 1.

2.2 SALDOS E PERFORMANCE RENDA VARIÁVEL

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 120.162.092,45	R\$ 130.532.819,40	(5,5863)	(5,0279)	8,6306	-2,5946%	-2,5946%	57,7019%
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 163.880.259,74	R\$ 168.990.880,35	(2,6700)	(0,7700)	3,1200	-0,4061%	-0,4061%	52,7341%
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 57.447.865,82	R\$ 59.790.100,24	(3,3100)	(3,0900)	4,0800	-2,4747%	-2,4747%	60,1746%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 323.581.144,57	R\$ 329.164.803,58	0,6156	(1,9923)	1,7300	0,3170%	0,3170%	75,8884%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FI AÇÕES	R\$ 9.063.034,94	R\$ 9.803.850,19	(3,5900)	(2,0162)	8,1700	2,1841%	2,1841%	NC
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 5.546.311,97	R\$ 6.779.153,09	(0,1700)	(0,2364)	22,2300	21,7337%	21,7337%	NC
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	R\$ 60.863.932,98	R\$ 62.161.026,99	(1,3746)	(5,3612)	2,1311	-4,6730%	-4,6730%	48,2038%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 169.784.663,87	R\$ 178.384.246,29	(3,9200)	(3,8100)	5,0600	-2,9042%	-2,9042%	33,2027%
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 170.555.424,70	R\$ 174.167.462,84	(1,4600)	0,4700	2,1200	1,1020%	1,1020%	61,9034%
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA	R\$ 38.406.022,23	R\$ 39.901.426,98	(2,3400)	(3,8500)	3,8900	-2,4472%	-2,4472%	56,3108%
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 60.785.903,53	R\$ 62.960.380,35	(2,9100)	(4,3000)	3,5800	-3,7585%	-3,7585%	41,7020%
ITAU SMALL CAPS VALUATION	R\$ 82.581.623,45	R\$ 86.364.720,04	(2,3300)	(0,6600)	4,5800	1,4691%	1,4691%	63,3248%
SANTANDER FIC SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 14.404,56	R\$ 15.337,20	(3,0560)	(4,2863)	6,4746	-1,2036%	-1,2036%	54,6141%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ 50.541.736,90	R\$ -	(3,4551)	(4,7547)	0,8324	-7,2801%	-7,2801%	45,1574%
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 45.315.737,93	R\$ 45.988.315,18	(3,0324)	(4,2868)	1,4842	-5,8117%	-5,8117%	47,3457%
SAFRA S&P REAIS PB MULTIMERCADO	R\$ 22.186.107,00	R\$ 23.088.119,79	(0,1800)	2,5900	4,0700	6,5732%	6,5732%	51,1450%
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 83.734.069,33	R\$ 84.376.765,95	(1,9100)	(0,7727)	0,7675	-1,9209%	-1,9209%	NC
OCCAM FIC FIA	R\$ 123.639.527,85	R\$ 128.504.904,80	(3,1300)	(3,3629)	3,9351	-2,7039%	-2,7039%	NC
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 31.426.044,40	R\$ 32.217.327,79	(3,2555)	(3,4898)	2,5179	-4,2807%	-4,2807%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.619.515.908,22	R\$ 1.623.191.641,05						

Quadro 2.

Relatório de Investimentos – Março/2021

2.3 SALDOS E PERFORMANCE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 79.585.312,09	R\$ 82.654.069,79	4,8971	6,1534	3,8559	15,6455%	15,6455%	NC
SANTAND FI GLOBAL EQUITIES MULTIMERC	R\$ 87.822.626,05	R\$ 141.372.070,13	5,6373	4,5987	2,5800	13,3460%	13,3460%	NC
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 24.505.010,57	R\$ 40.682.977,71	-	-	1,9353	1,9353%	1,9353%	NC
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 76.997.124,35	R\$ 79.949.515,64	5,0882	4,0790	3,8344	13,5686%	13,5686%	NC
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 103.063.956,08	R\$ 136.158.010,05	3,7500	4,4700	3,0300	11,6718%	11,6718%	NC
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ -	R\$ 20.971.787,48	-	-	1,6361	1,6361%	1,6361%	NC
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ -	R\$ 20.289.668,37	-	-	(1,6697)	-1,6697%	-1,6697%	NC
TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	R\$ 371.974.029,15	R\$ 522.078.163,01						
TOTAL GERAL	R\$ 3.891.148.674,52	R\$ 4.007.489.299,98						

Quadro 3.

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

Nota 2: Com base na Ata 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: 1. a) ratear os novos recursos 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). b) Recursos atuais: 1. 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); 2. 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); 3. 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); 4. 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); 5. 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). Algumas movimentações poderão acontecer no decorrer do mês de abril/21 devido ao processo de cadastro de contas bancárias e de clientes institucionais junto às instituições financeiras.

2.4 DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

INSTITUIÇÃO	jan/21	fev/21	mar/21
BRASESCO	R\$ 226.441.911,95	R\$ 223.331.889,60	R\$ 232.591.793,75
BANCO DO BRASIL	R\$ 808.953.772,01	R\$ 850.037.098,57	R\$ 865.657.490,00
CAIXA	R\$ 1.184.622.286,50	R\$ 1.129.396.013,18	R\$ 1.122.807.492,06
ITAÚ	R\$ 357.950.376,24	R\$ 352.350.089,94	R\$ 363.415.136,76
SANTANDER	R\$ 184.561.892,48	R\$ 183.694.505,44	R\$ 187.375.722,51
ICATU	R\$ 406.036.307,44	R\$ 366.921.096,37	R\$ 375.094.157,82
SAFRA	R\$ 180.065.324,31	R\$ 183.922.837,77	R\$ 187.756.204,28
BTG PACTUAL	R\$ 346.988.954,96	R\$ 338.190.491,48	R\$ 345.747.806,86
AZ QUEST	R\$ 83.092.044,72	R\$ 83.734.069,33	R\$ 84.376.765,95
OCCAM BRASIL	R\$ 127.942.152,42	R\$ 123.639.527,85	R\$ 128.504.904,80
SCHRODER	R\$ -	R\$ 24.505.010,57	R\$ 40.682.977,71
SULAMÉRICA	R\$ 32.562.417,00	R\$ 31.426.044,40	R\$ 32.217.327,79
PLURAL INVEST	R\$ -	R\$ -	R\$ 41.261.455,85
TOTAL	R\$ 3.939.217.440,03	R\$ 3.891.148.674,52	R\$ 4.007.489.236,14

Quadro 4.

Relatório de Investimentos – Março/2021

DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - FPREV EXEC MARÇO/2021

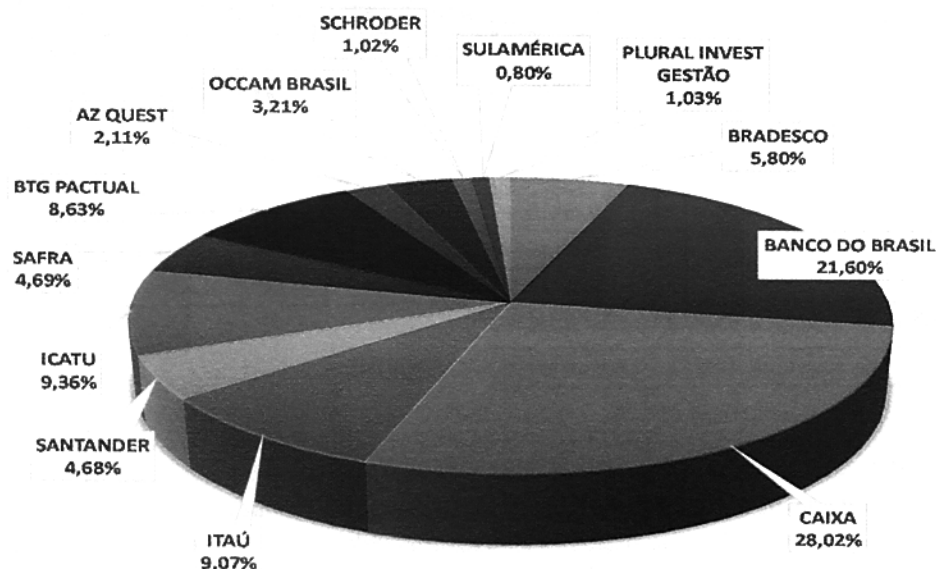


Gráfico 1.

2.5 SALDOS E VALORIZAÇÃO DOS TÍTULOS PÚBLICOS

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	26/02/2021	31/03/2021	jan21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/05/23)	R\$ 159.839.062,78	R\$ 162.171.873,72	0,7759	1,3891	1,4595	3,667%	3,6670%	12,9746%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 166.666.752,82	R\$ 169.115.058,38	0,7854	1,3986	1,4690	3,696%	3,6962%	13,1017%
NTN-B (29/01/14 - 15/08/30)	R\$ 175.340.312,20	R\$ 177.957.730,08	0,8090	1,4224	1,4928	3,769%	3,7691%	13,4201%
NTN-B (15/01/14 - 15/08/40)	R\$ 172.944.328,08	R\$ 175.484.877,56	0,7854	1,3986	1,4690	3,696%	3,6962%	13,1019%
TOTAL GERAL	R\$ 674.790.455,88	R\$ 684.729.539,73						

Quadro 5.

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

2.6 CARACTERÍSTICAS DOS TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS

SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	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\$ 3.708,562942	R\$ 3.835,828603	R\$ 3.973,019453	R\$ 3.899,533891
QUANTIDADE	43.100	43.450	44.113	44.350
APLICAÇÃO INICIAL	R\$ 99.765.417,74	R\$ 99.437.031,23	R\$ 175.261.807,11	R\$ 99.980.152,45
VALOR ATUAL	R\$ 162.171.873,72	R\$ 169.115.058,38	R\$ 177.957.730,08	R\$ 175.484.877,56
DATA DE EMISSÃO	15/01/2014	10/02/2010	10/02/2010	10/02/2010
DATA DA APLICAÇÃO	15/01/2014	15/01/2014	29/01/2014	15/01/2014
DATA DO RESGATE	15/05/2023	15/08/2030	15/08/2030	15/08/2040
TAXA DE JUROS CONTRATADA	6,48%	6,5998%	6,90%	6,60%

Quadro 6.

2.7 ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO POR ÍNDICES DE REFERÊNCIA

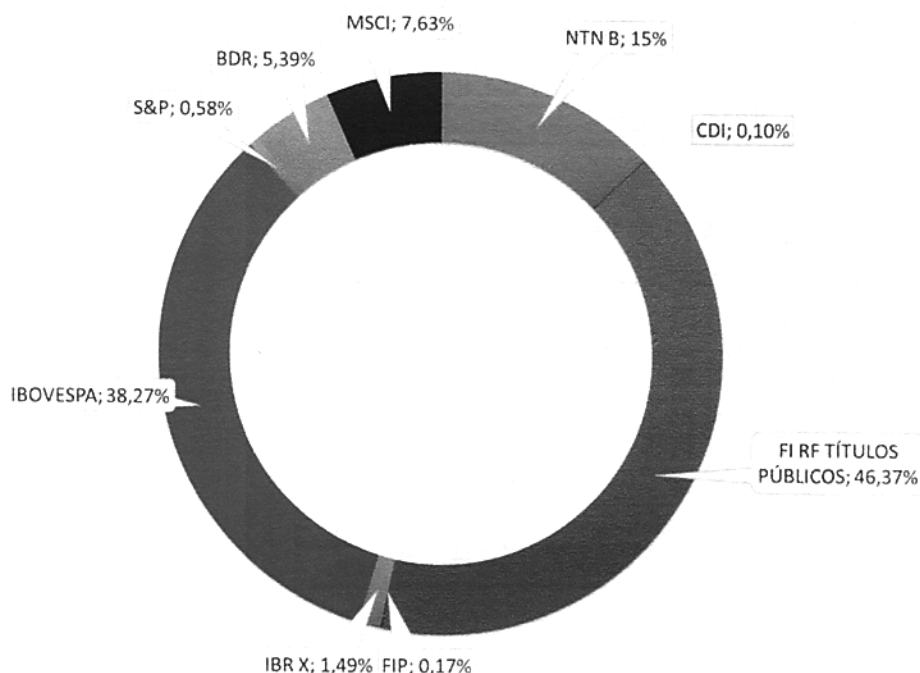


Gráfico 2.

2.8 SALDOS CVS – FPREV

DESCRIÇÃO	SALDO	
	26/02/2021	31/03/2021
CVS - A	R\$ 1.222.546,14	R\$ 1.205.092,82
CVS - B	R\$ 7.910.046,90	R\$ 7.797.069,10
CVS - C	R\$ 158.591,16	R\$ 156.327,08
CVS - D	R\$ 867.441,96	R\$ 855.052,44
TOTAL	R\$ 10.158.626,16	R\$ 10.013.541,44

Quadro 7.

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

2.9 CVS – REPASSE FINANCEIRO

MÊS	JUROS	PRINCIPAL	TOTAL
jan/21	R\$ 30.247,09	R\$ 145.084,72	R\$ 175.331,81
fev/21	R\$ 29.827,12	R\$ 145.084,72	R\$ 174.911,84
mar/21	R\$ 29.407,16	R\$ 145.084,72	R\$ 174.491,88
TOTAL	R\$ 89.481,37	R\$ 435.254,16	R\$ 524.735,53

Quadro 8.

Relatório de Investimentos – Março/2021

2.10 LOCAÇÃO DE IMÓVEIS

RECEITA DE LOCAÇÃO DE IMÓVEIS - FPREV 2021 (Contrato Regular)			
MÊS	UEA	SEAS	TOTAL
jan/21	R\$ -	R\$ -	R\$ -
fev/21			R\$ -
mar/21		R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40
TOTAL	R\$ -	R\$ 100.364,40	R\$ 100.364,40

Quadro 9.

2.11 TOTAL DOS RECURSOS - FPREV EXECUTIVO

RECURSOS FPREV EXECUTIVO	SALDO		% dos Recursos
	26/02/2021	31/03/2021	
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 3.891.148.674,52	R\$ 4.007.489.299,98	84,1191%
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 674.790.455,88	R\$ 684.729.539,73	14,3728%
TÍTULOS CVS	R\$ 10.158.626,16	R\$ 10.013.541,44	0,2102%
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18	R\$ 61.835.325,18	1,2980%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 16.891.355,97	R\$ -	0,0000%
TOTAL	R\$ 4.654.824.437,71	R\$ 4.764.067.706,33	100,00%

Quadro 10.

2.12 EVOLUÇÃO DOS RECURSOS

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%
mar/21	R\$ 4.764.067.706,33	2,35%	-0,91%	1,67%

Quadro 11.

Relatório de Investimentos – Março/2021

2.13 RENTABILIDADE X META ATUARIAL

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 03/2020		RS 4.677.866.125,22	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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 584.279,15	RS 82.104.432,44	RS -81.520.153,29
02/2021	RS 40.864.605,59	RS 44.974.382,51	RS -4.109.776,92
03/2021	RS 41.485.170,47	RS 10.665.619,53	RS 30.819.550,94
Saldo dos Investimentos em 03/2021		RS 4.764.067.706,33	

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	6,0993 %	2,0525 %	0,9300 %	
Juros	5,4500 %	1,3355 %	0,4432 %	
Meta	11,8817 %	3,4154 %	1,3773 %	
Rentabilidade em %	19,4014 %	0,2289 %	1,6848 %	
Rentabilidade em R\$	RS 827.767.383,46	RS 10.878.076,49	RS 78.423.717,68	
Resultado em %	+6,7211 %	-3,0813 %	+0,3033 %	
Resultado em R\$	RS +321.401.999,97	RS -151.442.885,77	RS +14.311.717,52	

Quadro 12.

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

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

Nota 3: Importante destacar o resultado no período de 12 (doze) meses, onde é observado um ganho de 6,72% acima da meta atuarial, equivalente a R\$ 321,401 milhões. Tal resultado, reflete a estratégia adotada pela Amazonprev em alocar recursos em fundos de Renda Variável, principalmente em fundos de Ações que não estão correlacionados com o índice IBOVESPA na sua integralidade e cuja estratégia principal é alocar recursos em empresas com grande potencial de crescimento na visão do mercado financeiro para a realização de uma gestão ativa dos recursos, além de aproveitar as oportunidades trazidas pela volatilidade dos Títulos do Tesouro de vencimentos mais longos (indexados ao IMA B e IMA B5+).

Relatório de Investimentos – Março/2021

3. RECURSOS FUNDO PREVIDENCIÁRIO- FPREV ALE

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

FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 5.162.042,99	R\$ 5.177.583,30	0,0253	(0,2664)	0,3010	0,0591%	0,0591%	5,3485%
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA RF FIC	R\$ 87.311,53	R\$ 87.437,74	0,1446	0,0032	0,1400	0,2879%	0,2879%	2,0027%
ICATU VANGUARDA FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 1.938.473,81	R\$ 1.944.929,98	0,3331	(0,5264)	0,3300	0,1342%	0,1342%	11,0055%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ -	R\$ 204.952,54	-	-	0,3700	0,3700%	0,3700%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 7.187.828,33	R\$ 7.414.903,56						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 499.584,59	R\$ 524.888,51	5,0650	(3,8100)	5,0600	6,1758%	6,1758%	45,6593%
BTG ABSOLUTO FIQ FIA	R\$ 1.558.837,59	R\$ 1.585.736,61	(0,6156)	(2,5279)	1,7256	-1,4563%	-1,4563%	NC
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 480.009,97	R\$ 490.239,64	(1,3746)	(5,3612)	2,1311	-4,6730%	-4,6730%	48,2038%
OCCAM FIC FIA	R\$ 2.006.223,91	R\$ 2.085.171,45	(3,1300)	(3,3629)	3,9351	-2,7039%	-2,7039%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 4.544.656,06	R\$ 4.686.036,21						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR	R\$ 1.375.299,52	R\$ 1.416.979,15	3,7500	4,4700	3,0300	11,6718%	11,6718%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.375.299,52	R\$ 1.416.979,15						

TOTAL GERAL	R\$ 13.107.783,91	R\$ 13.517.918,92						
--------------------	--------------------------	--------------------------	--	--	--	--	--	--

Quadro 13.

Nota: Com base na Ata 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2.

3.2 Saldos e Valorização dos Títulos Públicos –ALE/FPREV

TÍTULO PÚBLICO (DATA DE COMPRA - DATA DO VENCIMENTO)	SALDO		VALORIZAÇÃO (%)					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
NTN-B (15/01/14 - 15/08/30)	R\$ 2.277.495,45	R\$ 2.311.493,09	0,785400	1,422374	1,492764	3,7448%	3,7448%	13,1547%
TOTAL GERAL	R\$ 2.277.495,45	R\$ 2.311.493,09						

Quadro 14.

3.3 Total dos Recursos – ALE/FPREV

RECURSOS ALE FPREV	SALDO	
	26/02/2021	31/03/2021
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 13.107.783,91	R\$ 13.517.918,92
TÍTULOS PÚBLICOS	R\$ 2.277.495,45	R\$ 2.311.493,09
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 15.385.279,36	R\$ 15.829.412,01

Quadro 15.

Relatório de Investimentos – Março/2021

3.4 Rentabilidade ALE/FPREV e Meta Atuarial

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 03/2020				R\$ 12.694.389,88
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)	
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	
02/2021	R\$ 143.097,24	R\$ 0,00	R\$ 143.097,24	
03/2021	R\$ 143.973,76	R\$ 0,00	R\$ 143.973,76	
Saldo dos Investimentos em 03/2021				R\$ 15.829.412,01

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	6,0993 %	2,0525 %	0,9300 %
Juros	5,4500 %	1,3355 %	0,4432 %
Meta	11,8817 %	3,4154 %	1,3773 %
Rentabilidade em %	9,9770 %	0,5754 %	1,9509 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.340.212,24	R\$ 88.648,56	R\$ 300.158,89
Resultado em %	-1,7025 %	-2,7462 %	+0,5658 %
Resultado em R\$	R\$ -255.565,57	R\$ -437.467,90	R\$ +88.253,79

Quadro 16.

4. RECURSOS DO MPE – FPREV

4.1 Saldos, Disponibilidade e Performance dos Fundos de Investimentos

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 7.650.582,95	R\$ 7.673.614,98	0,0253	(0,5075)	0,3010	-0,1828%	-0,1828%	NC
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 40.172.100,04	R\$ 39.954.368,64	(0,5800)	(0,9579)	(0,5400)	-2,0641%	-2,0641%	1,6629%
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 97.807.421,45	R\$ 77.529.182,14	(0,5523)	(0,9139)	(0,4211)	-1,8761%	-1,8761%	2,1537%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ -	R\$ 1.552.991,24	-	-	0,3700	0,3700%	0,3700%	NC
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 145.630.104,44	R\$ 126.710.157,00						
FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 24.057.402,07	R\$ 25.038.257,90	(3,3100)	(3,0870)	4,0800	-2,4716%	-2,4716%	NC
BB AÇÕES VALOR	R\$ -	R\$ 21.480.287,57	-	-	8,6306	8,6306%	8,6306%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 24.057.402,07	R\$ 46.518.545,47						
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 12.906,21	R\$ 1.934,84						
TOTAL RECURSOS	R\$ 169.700.412,72	R\$ 173.230.637,31						

Quadro 17.

Relatório de Investimentos – Março/2021

Nota: Com base na Ata 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2

4.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – MPE/FPREV

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 03/2020		R\$ 145.914.056,30	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
04/2020	R\$ 1.268.670,97	R\$ 10.639,28	R\$ 1.258.031,69
05/2020	R\$ 1.482.380,96	R\$ 0,00	R\$ 1.482.380,96
06/2020	R\$ 1.273.507,14	R\$ 10.584,16	R\$ 1.262.922,98
07/2020	R\$ 1.272.066,06	R\$ 11.829,88	R\$ 1.260.236,18
08/2020	R\$ 1.482.857,02	R\$ 9.164,74	R\$ 1.473.692,28
09/2020	R\$ 1.514.681,38	R\$ 7.663,69	R\$ 1.507.017,69
10/2020	R\$ 1.490.094,20	R\$ 9.164,74	R\$ 1.480.929,46
11/2020	R\$ 1.503.550,04	R\$ 9.164,74	R\$ 1.494.385,30
12/2020	R\$ 1.579.792,66	R\$ 12.799,56	R\$ 1.566.993,10
01/2021	R\$ 3.008.450,20	R\$ 8.065,16	R\$ 3.000.385,04
02/2021	R\$ 1.585.217,06	R\$ 9.707,31	R\$ 1.575.509,75
03/2021	R\$ 1.564.682,30	R\$ 8.065,16	R\$ 1.556.617,14
Saldo dos Investimentos em 03/2021		R\$ 173.230.637,31	

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	6,0993 %	2,0525 %	0,9300 %
Juros	5,4500 %	1,3355 %	0,4432 %
Meta	11,8817 %	3,4154 %	1,3773 %
Rentabilidade em %	5,4614 %	-1,2482 %	1,1707 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 8.397.479,44	R\$ -2.144.085,72	R\$ 1.986.513,66
Resultado em %	-5,7385 %	-4,5096 %	-0,2038 %
Resultado em R\$	R\$ -9.861.061,42	R\$ -8.010.073,86	R\$ -350.632,58

Quadro 18.


5. RECURSOS DO DPE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	26/02/2021	31/03/2021	jun/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 15.462,07	R\$ 15.791,59	-	-	2,1311	2,1311%	2,1311%	NC
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGIA	R\$ 7.808.253,67	R\$ 7.831.760,37	0,0253	(0,5075)	0,3010	-0,1828%	-0,1828%	NC
BRANCO INST. ALOC. DINAMICA	R\$ 8.522.529,39	R\$ 8.476.337,56	(0,5800)	(0,9579)	(0,5400)	-2,0641%	-2,0641%	5,0767%
BRANCO INST. FIC FI RF IMA B5	R\$ 9.598.969,70	R\$ 9.555.492,29	(0,0200)	(0,7911)	0,0900	-0,7217%	-0,7217%	6,4550%
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ -	R\$ 995.002,31	-	-	0,3700	0,3700%	0,3700%	0,3700%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 12.001,73	R\$ 12.536,46						
TOTAL	R\$ 25.957.216,56	R\$ 26.886.920,58						

Quadro 19.

Nota: Com base na Ata 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2



Relatório de Investimentos – Março/2021

5.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – DPE/FPREV

1.1 Investimentos

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
Saldo dos Investimentos em 03/2020			R\$ 13.969.463,72
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
02/2021	R\$ 1.003.038,47	R\$ 51.465,27	R\$ 951.573,20
03/2021	R\$ 992.747,96	R\$ 51.465,27	R\$ 941.282,69
Saldo dos Investimentos em 03/2021			R\$ 26.886.920,58

1.2 Meta Atuarial do RPPS - Definida na Política de Investimentos

Item	Em 12 meses	No ano	No mês
Taxa de Juros Anual	5,4500 %	Índice de Inflação	IPCA
IPCA	6,0993 %	2,0525 %	0,9300 %
Juros	5,4500 %	1,3355 %	0,4432 %
Meta	11,8817 %	3,4154 %	1,3773 %
Rentabilidade em %	5,2750 %	-1,0271 %	-0,0446 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.009.794,44	R\$ -262.937,70	R\$ -11.578,67
Resultado em %	-5,9051 %	-4,2958 %	-1,4026 %
Resultado em R\$	R\$ -1.257.345,56	R\$ -1.137.098,11	R\$ -369.093,57

Quadro 20.

6. RECURSOS DO TJAM – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 163.342.497,19	R\$ 163.834.238,69	0,0253	(0,5075)	0,3010	-0,1828%	-0,1828%	NC	
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 51.046.475,95	R\$ 50.831.496,38	(0,5523)	(0,9139)	(0,4211)	-1,8761%	-1,8761%	NC	
BB PREV RF IDKA 2	R\$ 159.676.124,67	R\$ 163.672.954,07	0,1769	(0,5482)	0,3700	-0,0036%	-0,0036%	NC	
BRADESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 42.453.980,72	R\$ 42.145.960,64	(0,0200)	(0,7911)	0,0900	-0,7217%	-0,7217%	8,4489%	
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 416.519.078,53	R\$ 420.484.649,78							
FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 9.740.925,27	R\$ 9.948.517,77	(1,3746)	(5,3612)	2,1311	-4,6730%	-4,6730%	NC	
BRADESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 4.595.725,94	R\$ 4.783.100,47	(3,3100)	(3,0872)	4,0800	-2,4719%	-2,4719%	NC	
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 14.336.651,21	R\$ 14.731.618,24							
FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)						
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 23.471.242,39	R\$ 24.006.655,31	-	-	3,8559	3,8559%	3,8559%	NC	
TOTAL - BDR / IE	R\$ 23.471.242,39	R\$ 24.006.655,31							
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 31.064,68	R\$ 31.064,68							
TOTAL	R\$ 454.358.036,81	R\$ 459.253.988,01							

Quadro 21.

Relatório de Investimentos – Março/2021

Nota: Com base na Ata 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2

6.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TJAM/FPREV

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 03/2020		R\$ 28.870.214,20	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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
02/2021	R\$ 3.471.253,44	R\$ 314.749,25	R\$ 3.156.504,19
03/2021	R\$ 3.427.904,40	R\$ 367.719,45	R\$ 3.060.184,95
Saldo dos Investimentos em 03/2021		R\$ 459.253.988,01	

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	6,0993 %	2,0525 %	0,9300 %
Juros	5,4500 %	1,3355 %	0,4432 %
Meta	11,8817 %	3,4154 %	1,3773 %
Rentabilidade em %	4,9854 %	-0,3680 %	0,4109 %
Rentabilidade em R\$	R\$ 11.649.744,08	R\$ -1.673.266,97	R\$ 1.866.830,93
Resultado em %	-6,1640 %	-3,6585 %	-0,9533 %
Resultado em R\$	R\$ -15.732.883,02	R\$ -17.202.437,69	R\$ -4.390.722,13

Quadro 22.

Relatório de Investimentos – Março/2021

7. RECURSOS DO TCE – FPREV

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

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 41.861.745,01	R\$ 41.987.769,50	0,0253	(0,5075)	0,3010	-0,1828%	-0,1828%	NC
BB PREVID RF IDKA 2	R\$ 29.974.861,26	R\$ 30.616.359,15	0,1769	(0,5482)	0,3700	-0,0036%	-0,0036%	NC
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 21.195.073,63	R\$ 21.105.811,69	(0,5523)	(0,9139)	(0,4211)	-1,8761%	-1,8761%	NC
BRASESCO INST. FIC FI RF IMA B 5	R\$ 7.515.903,05	R\$ 7.522.768,66	(0,0200)	(0,7911)	0,0900	-0,7217%	-0,7217%	7,7081%
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 100.547.582,95	R\$ 101.232.709,00						

FUNDO DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
CAIXA FIA CONSUMO	R\$ 9.740.925,27	R\$ 9.948.517,77	(1,3746)	(5,3612)	2,1311	-4,6730%	-4,6730%	NC
BRASESCO FIC FIA INSTIT IBRX ALPHA	R\$ 488.763,13	R\$ 508.690,73	-	-	4,0800	4,0800%	4,0800%	NC
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 10.229.688,40	R\$ 10.457.208,50						

FUNDO DE INVESTIMENTO - BDR E FUNDO DE INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	SALDOS		VALORIZAÇÃO (%)					
	26/02/2021	31/03/2021	jan/21	fev/21	mar/21	TRIMESTRE	2021	ÚLTIMOS 12 MESES
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 517.193,58	R\$ 528.980,21	-	-	3,8559	3,8559%	3,8559%	NC
TOTAL - BDR / IE	R\$ 517.193,58	R\$ 528.980,21						

DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$	R\$
	7.943,52	1.007,93
TOTAL	R\$ 111.302.408,45	R\$ 112.219.905,64

Quadro 23.

Nota: Com base na Ata 172/2020, a Diretoria deferiu as sugestões apresentadas pelo COMIV: Novos Recursos: Direcionar para o Fundo BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2

7.2 Rentabilidade e Meta Atuarial – TCE/FPREV

1.1 Investimentos

Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
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
02/2021	R\$ 1.040.178,80	R\$ 0,00	R\$ 1.040.178,80
03/2021	R\$ 523.658,87	R\$ 0,00	R\$ 523.658,87

Saldo dos Investimentos em 03/2020	R\$
	4.855.498,40

Saldo dos Investimentos em 03/2021	R\$
	112.219.905,64

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	6,0993%	2,0525%	0,9300%
Juros	5,4500%	1,3355%	0,4432%
Meta	11,8817%	3,4154%	1,3773%
Rentabilidade em %	3,3205%	-1,0991%	0,3538%
Rentabilidade em R\$	R\$ 1.887.446,51	R\$ -1.233.538,39	R\$ 393.838,32
Resultado em %	-7,6520%	-4,3654%	-1,0096%
Resultado em R\$	R\$ -4.744.575,81	R\$ -5.066.647,23	R\$ -1.139.156,13

Quadro 24.

Relatório de Investimentos – Março/2021

8. CONSOLIDADO – FUNDO PREVIDENCIÁRIO AMAZONPREV

1.1 Investimentos

Saldo dos Investimentos em 03/2020		R\$ 4.884.169.747,72	
Período	Receitas (R\$)	Despesas (R\$)	Resultado (R\$)
04/2020	R\$ 48.215.833,84	R\$ 100.449.603,54	R\$ -52.233.769,70
05/2020	R\$ 48.840.726,03	R\$ 116.673.889,20	R\$ -67.833.163,17
06/2020	R\$ 38.120.534,15	R\$ 156.958.744,17	R\$ -118.838.210,02
07/2020	R\$ 38.874.890,07	R\$ 124.433.923,06	R\$ -85.559.032,99
08/2020	R\$ 45.682.773,56	R\$ 99.608.522,46	R\$ -53.925.748,90
09/2020	R\$ 522.856.507,35	R\$ 110.053.586,29	R\$ 412.802.921,06
10/2020	R\$ 45.395.118,01	R\$ 112.503.349,21	R\$ -67.108.231,20
11/2020	R\$ 46.902.795,82	R\$ 116.701.131,09	R\$ -69.798.335,27
12/2020	R\$ 129.523.150,14	R\$ 176.448.361,04	R\$ -46.925.210,90
01/2021	R\$ 7.353.548,08	R\$ 82.470.359,61	R\$ -75.116.811,53
02/2021	R\$ 48.107.390,60	R\$ 45.350.304,34	R\$ 2.757.086,26
03/2021	R\$ 48.138.137,76	R\$ 11.092.869,41	R\$ 37.045.268,35
Saldo dos Investimentos em 03/2021		R\$ 5.551.488.569,88	

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	6,0993 %	2,0525 %	0,9300 %	
Juros	5,4500 %	1,3355 %	0,4432 %	
Meta	11,8817 %	3,4154 %	1,3773 %	
Rentabilidade em %	17,9963 %	0,1022 %	1,5274 %	
Rentabilidade em R\$	R\$ 852.052.060,17	R\$ 5.652.896,27	R\$ 82.959.480,81	
Resultado em %	+5,4652 %	-3,2038 %	+0,1480 %	
Resultado em R\$	R\$ +289.550.568,59	R\$ -183.296.610,56	R\$ +8.150.366,90	

Quadro 25.

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

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

Relatório de Investimentos – Março/2021

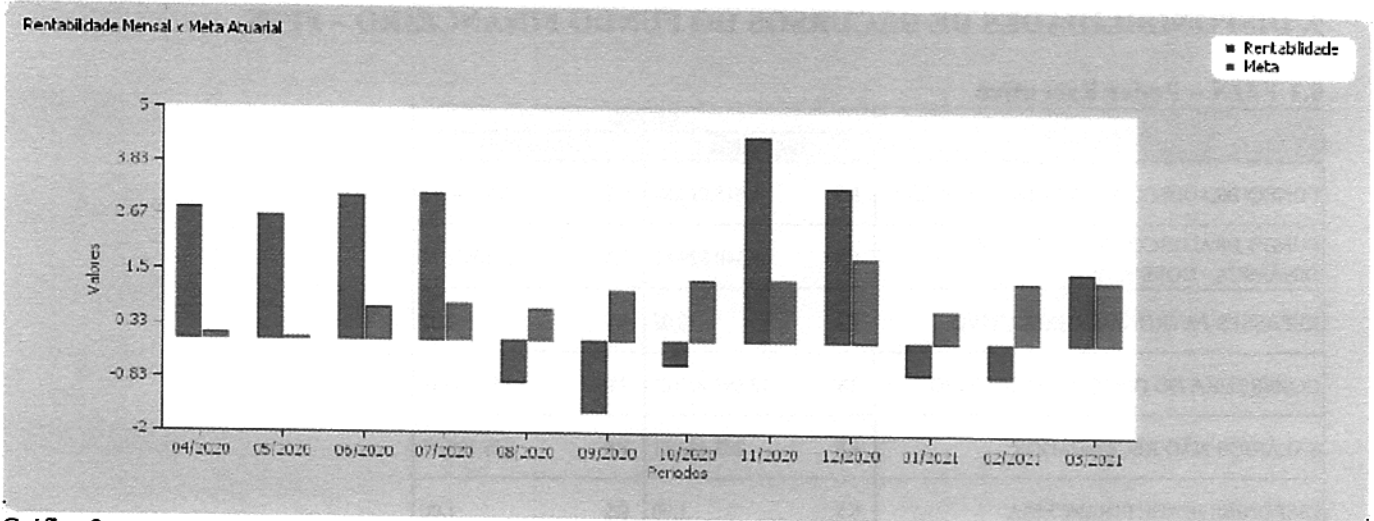


Gráfico 3.

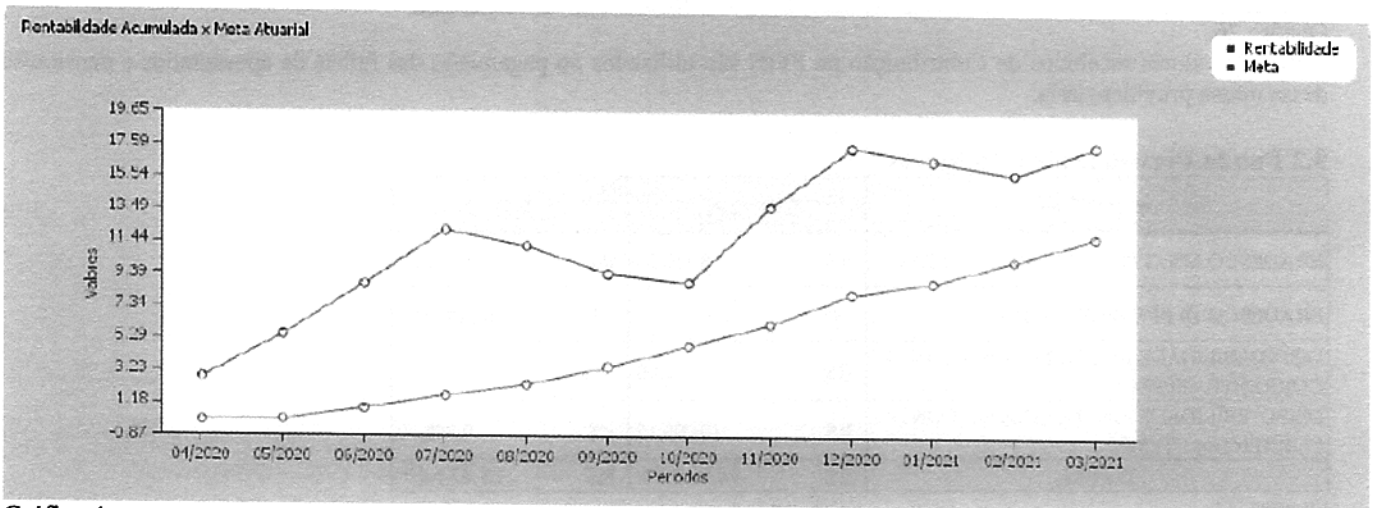


Gráfico 4.

Relatório de Investimentos – Março/2021

9. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DO FUNDO FINANCEIRO – FFIN

9.1 FFIN – Poder Executivo

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
FUNDO BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.615.012,89	R\$ 1.042.764,11
FUNDO BRADESCO FIC FI RF ALOC. DINÂMICA - COMPREV	R\$ 5.340.829,83	R\$ 5.311.882,74
REPASSES PATRONAIS - EXECUTIVO	R\$ 0,02	R\$ 0,02
COBERTURA DO DEFICIT - EXECUTIVO	R\$ 13.695.820,07	R\$ 13.167.550,94
SALÁRIOS NÃO RECLAMADOS	R\$ 223.433,51	R\$ 255.107,37
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 20.875.097,32	R\$ 19.777.306,18

Quadro 26.

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

9.2 Fundo Previdenciário Militares

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO - FPPM	R\$ 8.036,85	R\$ 4.847,83
BRADESCO DI PREMIUM - FPPM	R\$ -	R\$ 8.628,4600
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FPPM	R\$ 1,00	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE - FTEMP	R\$ 10.005,15	R\$ 9.948,20
TOTAL	R\$ 18.043,00	R\$ 23.424,49

Quadro 27.

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

9.3 FFIN Defensoria Pública – DPE/AM

DESCRIÇÃO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ -

Quadro 28.

9.4 FFIN Assembleia – ALE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 404.930,78	R\$ 406.020,94
DISPONIBILIDADE COBERTURA ALE FFIN	R\$ 47.155,86	R\$ 47.560,37
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 452.087,64	R\$ 453.582,31

Quadro 29.

Relatório de Investimentos – Março/2021

9.5 FFIN - Procuradoria Geral – PGJ / MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 952.510,68	R\$ 723.851,78
DISPONIBILIDADE COBERTURA MPE FFIN	R\$ -	R\$ 216.274,13
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 952.511,68	R\$ 940.125,91

Quadro 30.

9.6 FFIN – Tribunal de Justiça – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 7.912.393,77	R\$ 6.016.225,14
DISPONIBILIDADE COBERTURA TJ FFIN	R\$ 521.978,30	R\$ 527.583,59
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 8.434.373,07	R\$ 6.543.808,73

Quadro 31.

9.7 FFIN – Tribunal de Contas – TCE/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 1.918.634,83	R\$ 1.209.393,95
DISPONIBILIDADE COBERTURA TCE FFIN	R\$ -	R\$ 987.282,05
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ 231,16
TOTAL	R\$ 1.918.634,83	R\$ 2.196.907,16

Quadro 32.

10. DISPONIBILIDADES DE RECURSOS DE TAXA DE ADMINISTRAÇÃO

10.1 Taxa de Administração - EXECUTIVO

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 12.417.649,92	R\$ 1.572.819,48
CAIXA FIC BRASIL G. ESTRATÉGICA	R\$ 36.829.878,31	R\$ 48.984.904,19
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ 1,00
TOTAL	R\$ 49.247.529,23	R\$ 50.557.724,67

Quadro 33.

10.2 Taxa de Administração - ALE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 359.975,44	R\$ 433.046,49
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 37.881,30	R\$ -
TOTAL	R\$ 397.856,74	R\$ 433.046,49

Quadro 34.

Relatório de Investimentos – Março/2021

10.3 Taxa de Administração - TCE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 218.106,73	R\$ 218.530,78
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ 218.106,73	R\$ 218.530,78

Quadro 35.

10.4 Taxa de Administração – TJ/AM

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 879.387,89	R\$ 1.328.501,77
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ 1,00	R\$ -
TOTAL	R\$ 879.388,89	R\$ 1.328.501,77

Quadro 36.

10.5 Taxa de Administração – PGJ/MPE

FUNDO DE INVESTIMENTO	SALDOS	
	26/02/2021	31/03/2021
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ -	R\$ -
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA EM CONTA CORRENTE	R\$ -	R\$ -
TOTAL	R\$ -	R\$ -

Quadro 37.

11. ENQUADRAMENTO DOS RECURSOS

11.1 Enquadramento I – Segmento de Aplicação – Renda Fixa

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - RENDA FIXA	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2021		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
TÍTULOS DO TN	R\$ 687.041.032,82	12,39%	10,00%	100,00%	art 7º, inciso I, "a"
TOTAL art. 7º, inciso I, "a"	R\$ 687.041.032,82				
BB PREVIDENCIÁRIO TP VII	R\$ 6.917.542,68	35,70%	22,00%	100,00%	art 7º, inciso I, "b"
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 439.540.945,99				
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 480.385.103,60				
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.598.778,27				
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 803.152.454,23				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 108.518.916,55				
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 60.340.348,32				
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 28.510.074,44				
TOTAL art. 7º, inciso I, "b"	R\$ 1.979.964.164,08				
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 16.766.815,43	10,86%	13,00%	40,00%	art 7º, inciso IV, "a"
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 8.629,63				
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.224.221,59				
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 53.742.588,94				
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 472.571.346,02				
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.584,29				
TOTAL art. 7º, inciso IV, "a"	R\$ 602.422.185,90				
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.795.576,64	0,54%	3,00%	5,00%	art 7º, inciso VII, "b"
TOTAL art 7º, inciso VII, "b"	R\$ 29.795.576,64				
TOTAL RENDA FIXA	R\$ 3.299.222.959,44	59,48%			

Quadro 38.

Relatório de Investimentos – Março/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\$ 90.120.149,34	1,62%	3,00%	30,00%	art 8º, inciso I, "a"
TOTAL art 8º, inciso I, "a"	R\$ 90.120.149,34				
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 39.901.426,98	28,48%	30,00%	30,00%	art 8º, inciso II, "a"
BRDESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 168.990.880,35				
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 152.013.106,97				
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 82.564.093,76				
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 62.960.380,35				
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 174.167.462,84				
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 86.364.720,04				
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 178.909.134,80				
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 330.750.540,19				
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ -				
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 45.988.315,18				
SANTANDER CRESC SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.337,20				
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 84.376.765,95				
OCCAM FIC FIA	R\$ 130.590.076,25				
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 32.217.327,79				
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.803.850,19				
TOTAL art. 8º, inciso II, "a"	R\$ 1.579.613.418,84				
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 23.088.119,79	0,42%	3,00%	3,00%	art 8º, inciso III
TOTAL art. 8º, inciso III	R\$ 23.088.119,79				
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 6.779.153,09	0,12%	2,00%	5,00%	art 8º, inciso IV, "a"
TOTAL art. 8º, inciso IV, "a"	R\$ 6.779.153,09				
TOTAL RENDA VARIÁVEL	R\$ 1.699.600.841,06	30,64%			

SEGMENTO DE APLICAÇÃO - INVESTIMENTO NO EXTERIOR	TOTAL	% DA CARTEIRA	ESTRATÉGIA DE ALOCAÇÃO - PAI 2020		Resolução CMN nº 3.922/2010
			LIMITE ALVO	LIMITE SUPERIOR	
BB MM GLOBAL SELECT EQUITY INVEST NO EXTERIOR	R\$ 107.189.705,31	5,96%	5,00%	10,00%	art 9º-A, inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITY INVEST EXTERIOR	R\$ 141.372.070,13				
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA IE	R\$ 40.682.977,71				
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 20.971.787,48				
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 20.289.668,37				
TOTAL art 9º - A - II - Sufixo Investimento no Exterior	R\$ 330.506.209,00				
BB AÇÕES ESG FIA - BDR NIVEL I	R\$ 79.949.515,64	3,92%	5,00%		art 9º-A, inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 137.574.989,20				
TOTAL art 9º - A - III - BDR Nível I	R\$ 217.524.504,84				
TOTAL INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	R\$ 548.030.713,84	9,88%			

TOTAL GERAL DAS APLICAÇÕES	R\$ 5.546.854.514,34	100,00%
-----------------------------------	-----------------------------	----------------

Quadro 39.

Relatório de Investimentos – Março/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\$ 6.917.542,68	0,12%	20%
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 439.540.945,99	7,80%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 472.571.346,02	8,39%	
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 152.013.106,97	2,70%	
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 79.949.515,64	1,42%	
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 107.189.705,31	1,90%	
CAIXA FI BRASIL IMA B5 TP RF LP	R\$ 480.385.103,60	8,53%	
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.598.778,27	0,93%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 16.766.815,43	0,30%	
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 8.629,63	0,00%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.224.221,59	1,05%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 53.742.588,94	0,95%	
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 90.120.149,34	1,60%	
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 168.990.880,35	3,00%	
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.584,29	0,00%	
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 803.152.454,23	14,26%	
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 39.901.426,98	0,71%	
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 174.167.462,84	3,09%	
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 86.364.720,04	1,53%	
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 82.564.093,76	1,47%	
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 62.960.380,35	1,12%	
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 178.909.134,80	3,18%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.795.576,64	0,53%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 108.518.916,55	1,93%	
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 60.340.348,32	1,07%	
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 330.750.540,19	5,87%	
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 6.779.153,09	0,12%	
SANTANDER CRESCE SENIOR SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.337,20	0,00%	
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ -	0,00%	
SANTANDER SELEÇÃO 30	R\$ 45.988.315,18	0,82%	
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 141.372.070,13	2,51%	
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 23.088.119,79	0,41%	
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 28.510.074,44	0,51%	
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 137.574.989,20	2,44%	
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 84.376.765,95	1,50%	
OCCAM FIC FIA	R\$ 130.590.076,25	2,32%	
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 32.217.327,79	0,57%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.803.850,19	0,17%	
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 20.971.787,48	0,37%	
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 20.289.668,37	0,36%	
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 40.682.977,71	0,72%	
TOTAL SEGMENTO APLICAÇÃO	R\$ 4.859.813.481,52		

Quadro 40.

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 – Março/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\$ 6.917.542,68	19.523.305/0001-06	R\$ 240.972.949,54	2,87%	15%	
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	R\$ 439.540.945,99	13.322.205/0001-35	R\$ 8.957.703.037,59	4,91%		
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA	R\$ 472.571.346,02	25.078.994/0001-90	R\$ 9.507.617.903,00	4,97%		
BB PREVID AÇÕES VALOR FIC FIA	R\$ 152.013.106,97	29.258.294/0001-38	R\$ 1.177.292.184,55	12,91%		
BB FIA BDR - NIVEL I	R\$ 79.949.515,64	21.470.644/0001-13	R\$ 1.208.962.567,14	6,61%		
BB MM GLOBAL SELECT	R\$ 107.189.705,31	17.413.636/0001-68	R\$ 1.785.873.756,52	6,00%		
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO	R\$ 16.766.815,43	08.246.263/0001-97	R\$ 397.338.580,93	4,22%		
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	R\$ 8.629,63	03.399.411/0001-90	R\$ 3.219.925.406,69	0,00%		
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA B5	R\$ 59.224.221,59	20.216.216.0001/04	R\$ 1.065.355.221,87	5,56%		
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA	R\$ 53.742.588,94	28.515.874/0001-09	R\$ 1.406.629.483,62	3,82%		
BRADESCO INST IBR X ALPHA	R\$ 90.120.149,34	14.099.976/0001-78	R\$ 586.704.302,13	15,36%		
BRADESCO FIA MID SMALL CAPS	R\$ 168.990.880,35	06.988.623/0001-09	R\$ 2.141.846.289,54	7,89%		
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	R\$ 480.385.103,60	11.060.913/0001-10	R\$ 13.551.415.614,91	3,54%		
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF	R\$ 52.598.778,27	22.791.074/0001-26	R\$ 214.654.568,75	24,50%		
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	R\$ 803.152.454,23	23.215.097/0001-55	R\$ 15.491.489.347,05	5,18%		
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	R\$ 82.564.093,76	10.577.512/0001-79	R\$ 630.846.852,38	13,09%		
ITAÚ INST. ALOC. DINÂMICA FI FIC	R\$ 108.584,29	21.838.150/0001-49	R\$ 3.580.849.195,10	0,00%		
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA FIC FIA	R\$ 39.901.426,98	08.817.414/0001-10	R\$ 981.481.248,05	4,07%		
ITAÚ INST. AÇÕES PHOENIX FIC FI	R\$ 62.960.380,35	23.731.629/0001-07	R\$ 1.088.808.596,09	5,78%		
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC	R\$ 174.167.462,84	24.571.992/0001-75	R\$ 3.385.715.282,16	5,14%		
ITAÚ SMALL CAP VALUATION	R\$ 86.364.720,04	01.063.897/0001-65	R\$ 1.354.225.128,44	6,38%		
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO 30	R\$ 45.988.315,18	29.549.642/0001-26	R\$ 1.453.995.731,90	3,16%		
SANTANDER SELEÇÃO TOP AÇÕES	R\$ 15.337,20	02.436.763/0001-05	R\$ 432.011.131,47	0,00%		
SANTANDER IBOVESPA ATIVO AÇÕES	R\$ -	01.699.688/0001-02	R\$ 566.151.716,74	0,00%		
SANTANDER GLOBAL EQUITY	R\$ 141.372.070,13	17.804.792/0001-50	R\$ 1.656.051.100,50	8,54%		
ICATÚ VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	R\$ 178.909.134,80	08.279.304/0001-41	R\$ 1.494.264.626,94	11,97%		
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO CURTA FI RF	R\$ 108.518.916,55	10.922.432/0001-03	R\$ 921.256.811,75	11,78%		
ICATÚ VANG. INFLAÇÃO LONGA FI RF	R\$ 60.340.348,32	10.756.541/0001-06	R\$ 795.575.669,42	7,58%		
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC FI RF	R\$ 28.510.074,44	30.659.168/0001-74	R\$ 1.525.094.042,58	1,87%		
BTG ABSOLUTO INST. FIQ FIA	R\$ 330.750.540,19	11.977.794/0001-64	R\$ 2.831.568.584,73	11,68%		
SAFRA CONSUMO AMERICANO BDR - NIVEL I	R\$ 137.574.989,20	19.436.818/0001-80	R\$ 2.654.448.171,68	5,18%		
AZ QUEST SMALL MID INST. FIC FIA	R\$ 84.376.765,95	34.791.108/0001-61	R\$ 2.040.029.723,44	4,14%		
OCCAM FIC FIA	R\$ 130.590.076,25	11.628.883/0001-03	R\$ 1.109.023.441,48	11,78%		
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	R\$ 32.217.327,79	11.458.144/0001-02	R\$ 810.805.346,86	3,97%		
GENIAL MS GLOBAL BRANDS FIC FIA	R\$ 20.971.787,48	37.331.285/0001-53	R\$ 109.238.423.934,79	0,02%		
GENIAL MS US GROWTH FIC FIA IE	R\$ 20.289.668,37	37.331.299/0001-77	R\$ 39.085.800.370,31	0,05%		
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC FIA	R\$ 9.803.850,19	09.290.813/0001-38	R\$ 114.173.453,98	8,59%		
SCHRODER SUSTENT ACOES GLOBAIS FIC FIA	R\$ 40.682.977,71	37.308.394/0001-50	R\$ 9.139.087.088,52	0,45%		
TOTAL	R\$ 4.800.150.632,00					

FUNDOS DE INVESTIMENTO - LIMITES GERAIS ART. 14, § 1º	TOTAL APLICADO	CNPJ	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	% DO FL	Resolução CMN nº 3.922/2010
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	R\$ 23.088.119,79	21.595.829/0001-54	R\$ 1.037.182.533,83	2,23%	5%
BTG ECONOMIA REAL FIP	R\$ 6.779.153,09	35.640.811/0001-31	R\$ 485.987.734,85	1,39%	
ICATÚ VANG. FI RF INFLAÇÃO CP LP	R\$ 29.795.576,64	19.719.727/0001-51	R\$ 914.587.003,20	3,26%	
TOTAL	R\$ 59.662.849,52				

TOTAL	R\$ 4.859.813.481,52
--------------	-----------------------------

Quadro 41.

Relatório de Investimentos – Março/2021

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

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

Nota 3: Art. 14 § 3º. Em caso de os limites de que tratam o caput e o § 1º deste artigo serem ultrapassados em decorrência de resgate de cotas do fundo por outros cotistas, o regime próprio de previdência social deverá adequar-se em até 120 dias. Nesse caso, registra-se o fundo Bradesco IBRX Alpha (14.099.976/0001-78).

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

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.

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

GESTOR DE RECURSOS	TOTAL DE RECURSOS SOB GESTÃO - (RANKING ANBIMA FEVEREIRO/2021) EM R\$ MI	APLICAÇÕES - AMAZONPREV (FEVEREIRO/2021)	% DE RECURSOS SOB GESTÃO	Resolução CMN nº 3.922/2010
BB DTVM S.A	R\$ 1.180.786,21	R\$ 1.258.182.162,61	0,1066%	5%
ITAU UNIBANCO SA	R\$ 748.596,25	R\$ 363.502.574,50	0,0486%	
BRDESCO	R\$ 530.812,69	R\$ 388.853.285,28	0,0733%	
CAIXA	R\$ 414.462,14	R\$ 1.418.700.429,86	0,3423%	
BANCO SANTANDER (BRASIL) S/A	R\$ 296.854,68	R\$ 187.375.722,51	0,0631%	
BANCO BTG	R\$ 189.996,58	R\$ 347.333.543,47	0,1828%	
BANCO SAFRA	R\$ 106.542,30	R\$ 189.173.183,43	0,1776%	
SULAMERICA INVESTIMENTOS	R\$ 28.959,33	R\$ 32.217.327,79	0,1113%	
ICATÚ VANGUARDA DTVM S/A	R\$ 31.042,37	R\$ 377.563.976,31	1,2163%	
AZ QUEST INVESTIMENTOS	R\$ 15.741,11	R\$ 84.376.765,95	0,5360%	
OCCAM BRASIL GESTÃO	R\$ 15.785,40	R\$ 130.590.076,25	0,8273%	
PLURAL INVEST GESTÃO DE RECURSOS LTDA	R\$ 3.441,51	R\$ 41.261.455,85	1,1989%	
Schroder Investment Management Brasil Ltda.	R\$ 25.354,42	R\$ 40.682.977,71	0,1605%	

Quadro 42.

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

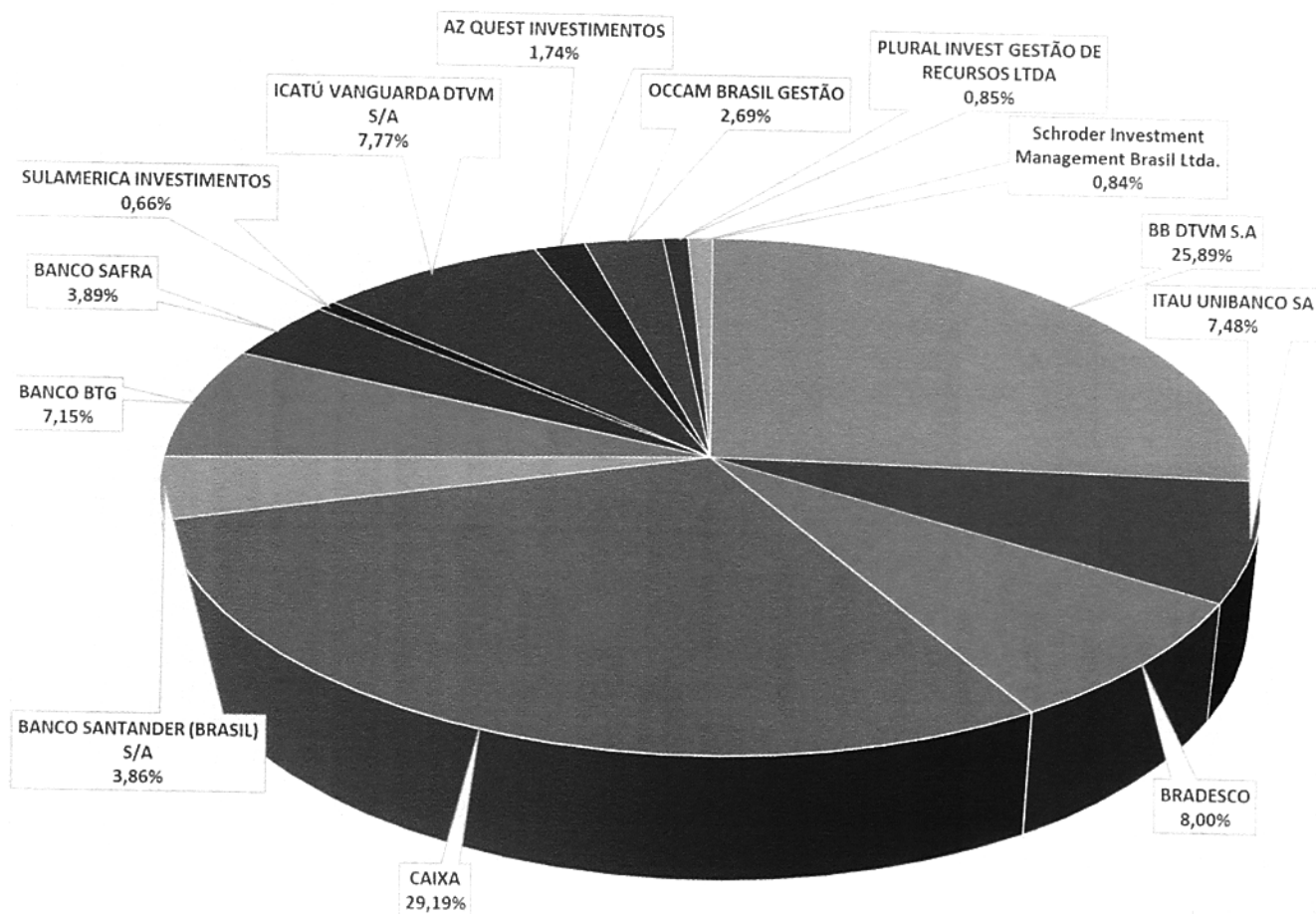


Gráfico 5.

12. TOTALIZAÇÃO DOS RECURSOS – AMAZONPREV

DESCRIÇÃO	SALDO
FUNDOS DE INVESTIMENTO	R\$ 4.859.832.980,07
TÍTULOS PÚBLICOS - NTN B	R\$ 687.041.032,82
TÍTULOS - CVS	R\$ 10.013.541,44
IMÓVEIS	R\$ 61.835.325,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	R\$ 15.258.084,74
TOTAL	R\$ 5.633.980.964,25

Quadro 43.

[Handwritten signatures and initials]

EVOLUÇÃO DOS RECURSOS - AMAZONPREV

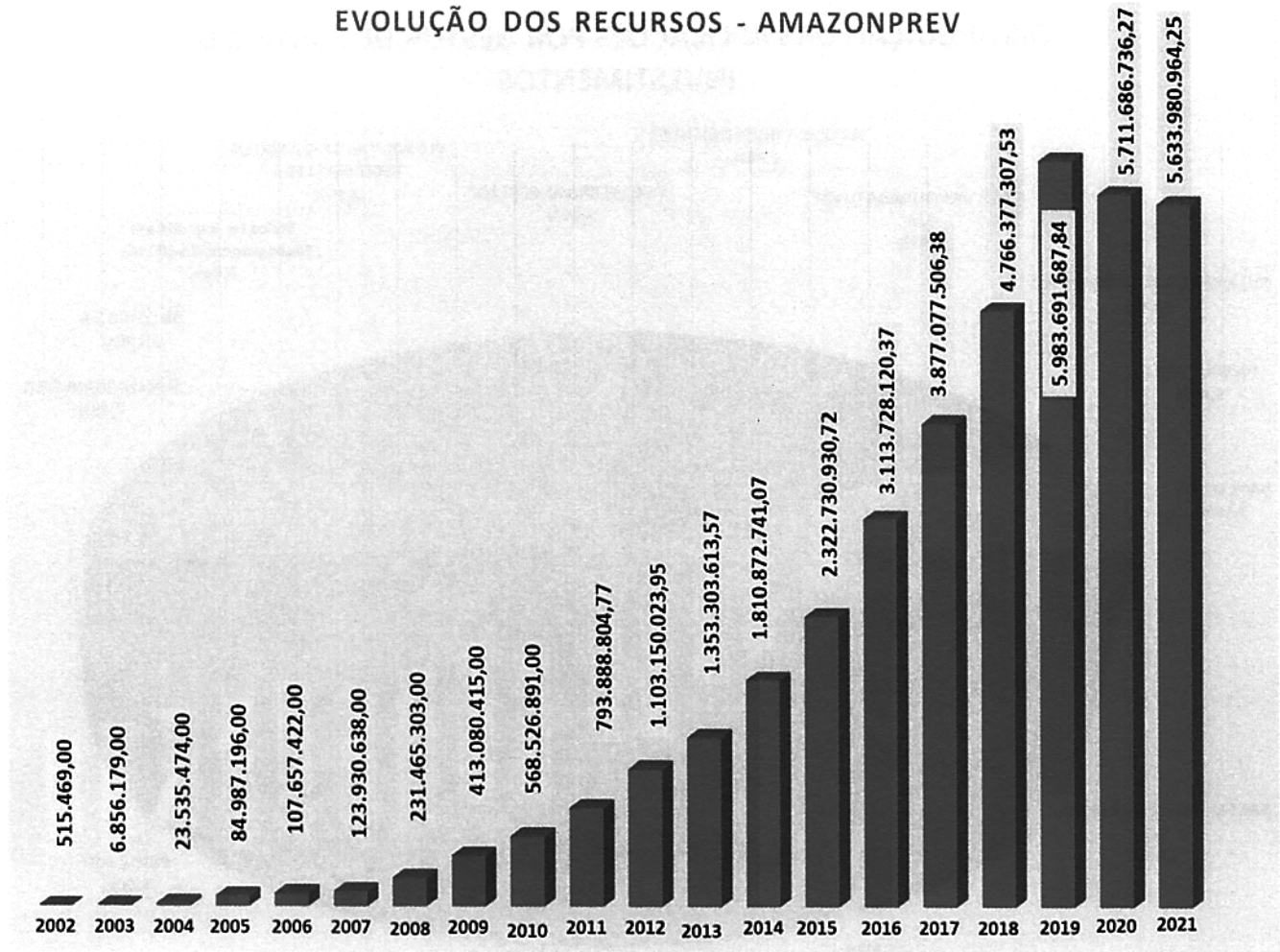


Gráfico 6.

Relatório de Investimentos – Março/2021

13. PLANO DE AÇÃO MENSAL

PLANO DE AÇÃO MENSAL		RESPONSÁVEL	PRAZO
FPREV EXECUTIVO:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo Itaú Private MM SP500 BRL FICFI (26.269.692/0001-61)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/05/2021
FPREV ALE:	Novos Recursos: Direcionar para o fundo Itaú Private MM SP500 BRL FICFI (26.269.692/0001-61)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/05/2021
FPREV MPE/PGJ:	Novos Recursos: fundo Brasil Capital RP Institucional FIC FIA (40 129 641 0001 65)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/05/2021
FPREV - DPE/AM	Novos Recursos: fundo Brasil Capital RP Institucional FIC FIA (40 129 641 0001 65)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/05/2021
FPREV - TJ/AM	Novos Recursos: fundo Brasil Capital RP Institucional FIC FIA (40 129 641 0001 65)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/05/2021
FPREV - TCE/AM	Novos Recursos: fundo Brasil Capital RP Institucional FIC FIA (40 129 641 0001 65)	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/05/2021
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	15/05/2021
RECURSOS COMPREV	Zerar a aplicação no fundo Bradesco Alocação Dinâmica, migrando os recursos para o fundo Bradesco DI Premium.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/05/2021
DISPONIBILIDADES DA TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	Os Novos Recursos repassados pelo Poder Executivo, devem ser aplicados no fundo Maxi Poder Público, direcionando o residual, se houver, para o Fundo Caixa Gestão Estratégica. Aos valores repassados pelos demais órgãos serão mantidas as aplicações atuais. Havendo necessidade, a GERA/COFIN pode solicitar transferência de valores da Caixa para o Bradesco.	GERAF / COFIN, com supervisão do COMIV	15/05/2021

Quadro 44.

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***

Relatório de Investimentos – Março/2021

SALDOS E PERFORMANCE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO - FPREV AMAZONPREV	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	Máx Drawdown 12M	12M	mar/21	2021
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfl	R\$ 472.571.346,02	R\$ 9.507.617.903,00	4,08%	0,42%	-2,71	4,35%	-0,42%	-1,88%
BB Prev RF Tit Publ VII FI	R\$ 6.917.542,68	R\$ 240.972.949,54	1,69%	0,17%	-0,90	7,11%	0,39%	0,67%
BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	R\$ -	R\$ 1.420.869.422,66	12,46%	1,28%	-7,67	11,48%	-1,19%	-5,12%
Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	R\$ 48.430.706,20	R\$ 1.406.629.483,62	4,36%	0,45%	-2,89	3,86%	-0,54%	-2,07%
Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	R\$ 59.224.221,59	R\$ 1.065.355.221,87	3,28%	0,34%	-2,49	7,71%	0,09%	-0,72%
Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	R\$ 3.810.813,16	R\$ 397.338.580,93	0,32%	0,03%	-0,55	1,64%	0,19%	0,42%
Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF	R\$ -				-0,65			
Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	R\$ 52.598.778,27	R\$ 214.654.568,75	6,05%	0,62%	-4,08	3,43%	0,07%	-3,90%
FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	R\$ 480.385.103,60	R\$ 13.551.415.614,91	3,03%	0,31%	-2,30	8,20%	0,31%	-0,23%
Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	R\$ 754.167.550,04	R\$ 15.491.489.347,05	3,77%	0,39%	-2,76	5,09%	0,30%	-0,18%
Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	R\$ 29.795.576,64	R\$ 914.587.003,20	3,68%	0,38%	-2,34	11,03%	0,33%	0,15%
Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	R\$ 108.518.916,55	R\$ 921.256.811,75	3,11%	0,32%	-2,35	8,06%	0,28%	-0,29%
Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	R\$ 60.340.348,32	R\$ 795.575.669,42	12,50%	1,28%	-7,68	11,62%	-1,22%	-5,20%
Itau Instt Alocacao Dinamica RF FICFI	R\$ 108.584,29	R\$ 3.580.849.195,10	1,65%	0,17%	-1,57	2,06%	0,14%	0,34%
Safra Ima Institucional Fc FI RF	R\$ 28.510.074,44	R\$ 1.525.094.042,58	9,24%	0,95%	-5,76	9,28%	-0,82%	-4,28%
BB Prev RF Idka 2 FI	R\$ 439.540.945,99	R\$ 8.957.703.037,59	2,62%	0,27%	-1,93	8,63%	0,37%	-0,00%
TOTAL	R\$ 2.544.920.507,79							

FUNDO DE INVESTIMENTO - SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	TOTAL APLICADO	PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO - R\$	Volatilidade 12M	VaR 95% 12M	Máx Drawdown 12M	12M	mar/21	2021
						RETORNO	RETORNO	RETORNO
BB Acoes Valor Fc FIA	R\$ 152.013.106,97	R\$ 1.177.292.184,55	26,32%	2,72%	-11,54	57,70%	8,63%	-2,59%
BB Mult Global Select Equity Ie FI	R\$ 107.189.705,31	R\$ 1.785.873.756,52	25,07%	2,60%	-8,80	73,76%	3,86%	15,65%
BB Acoes Esg FIA - Bdr Nivel I	R\$ 79.949.515,64	R\$ 1.208.962.567,14	24,33%	2,52%	-12,65	59,01%	3,83%	13,57%
Bradesco FIA Mid Small Caps	R\$ 168.990.880,35	R\$ 2.141.846.289,54	25,34%	2,62%	-10,66	52,73%	3,12%	-0,41%
Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	R\$ 90.120.149,34	R\$ 586.704.302,13	25,49%	2,64%	-9,65	60,16%	4,08%	-2,48%
BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	R\$ 330.750.540,19	R\$ 2.831.568.584,73	26,38%	2,74%	-7,35	64,29%	1,73%	-1,46%
BTG Pactual Economia Real FIP	R\$ 6.779.153,09	R\$ 485.987.734,85						
Caixa FIA Consumo	R\$ 82.564.093,76	R\$ 630.846.852,38	27,21%	2,82%	-10,65	48,20%	2,13%	-4,67%
Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	R\$ -	R\$ 110.191.686,39	26,07%	2,70%	-10,31	65,91%	5,39%	-0,19%
Icatu Vanguarda Dividendos FIA	R\$ 178.909.134,80	R\$ 1.500.771.290,94	25,25%	2,61%	-13,55	33,22%	5,06%	-2,89%
Itau Acoes Dinamic Fc	R\$ 174.167.462,84	R\$ 3.385.715.282,16	26,55%	2,75%	-11,31	58,11%	2,12%	1,10%
Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	R\$ 39.901.426,98	R\$ 981.481.248,05	25,43%	2,63%	-9,78	56,32%	3,89%	-2,44%
Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI	R\$ 62.960.380,35	R\$ 1.088.808.596,09	30,33%	3,14%	-18,95	41,69%	3,58%	-3,76%
Itau Small Cap Master FIA	R\$ 86.364.720,04	R\$ 1.354.225.128,44	27,58%	2,85%	-14,07	66,95%	4,80%	1,98%
Sant Selecao Cresce Senior Acoes Fc FI	R\$ 15.337,20	R\$ 432.011.131,47	26,01%	2,69%	-9,67	47,40%	1,48%	-5,84%
Santander FI Ibovespa Ativo Instt Acoes	R\$ -	R\$ 566.151.716,74	26,21%	2,71%	-10,75	51,85%	5,48%	-3,00%
Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	R\$ 45.988.315,18	R\$ 1.453.995.731,90	25,99%	2,69%	-9,67	47,35%	1,48%	-5,81%
Santander Global Equities Dólar Master Mult Ie FI	R\$ 141.372.070,13	R\$ 1.656.051.100,50	21,97%	2,28%	-8,91	72,29%	2,58%	13,34%
Safra S P Reais Pb FI Mult	R\$ 23.088.119,79	R\$ 1.037.182.533,83	20,57%	2,13%	-9,70	51,16%	4,07%	6,58%
Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	R\$ 137.574.989,20	R\$ 2.654.448.171,68	24,55%	2,54%	-11,99	59,12%	3,03%	11,67%
Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	R\$ 84.376.765,95	R\$ 2.040.029.723,44	26,05%	2,69%	-12,63	54,57%	0,77%	-0,40%
Occam Fc de FIA	R\$ 130.590.076,25	R\$ 1.109.023.441,48	25,49%	2,64%	-11,03	57,43%	3,94%	-2,70%
Sul America Equities FIA	R\$ 32.217.327,79	R\$ 810.805.346,86	26,18%	2,71%	-14,89	46,60%	2,52%	-4,28%
Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie	R\$ 40.682.977,71	R\$ 179.286.951,95			-8,49		1,94%	14,11%
BTG Pactual Dividendos FIC FIA	R\$ 9.803.850,19	R\$ 114.173.453,98	25,49%	2,64%	-12,07	43,53%	8,17%	-0,03%
Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie	R\$ 20.289.668,37	R\$ 376.388.870,88			-10,83		-3,91%	4,13%
Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie	R\$ 20.971.787,48	R\$ 120.151.936,50			-8,60		4,41%	4,77%
TOTAL	R\$ 2.247.631.554,90							

TOTAL GERAL R\$ 4.792.552.062,69

Quadro 1.

Fonte: Economática, 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

Relatório de Investimentos – Março/2021

Desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo médio da carteira será de 4,63%.

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

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

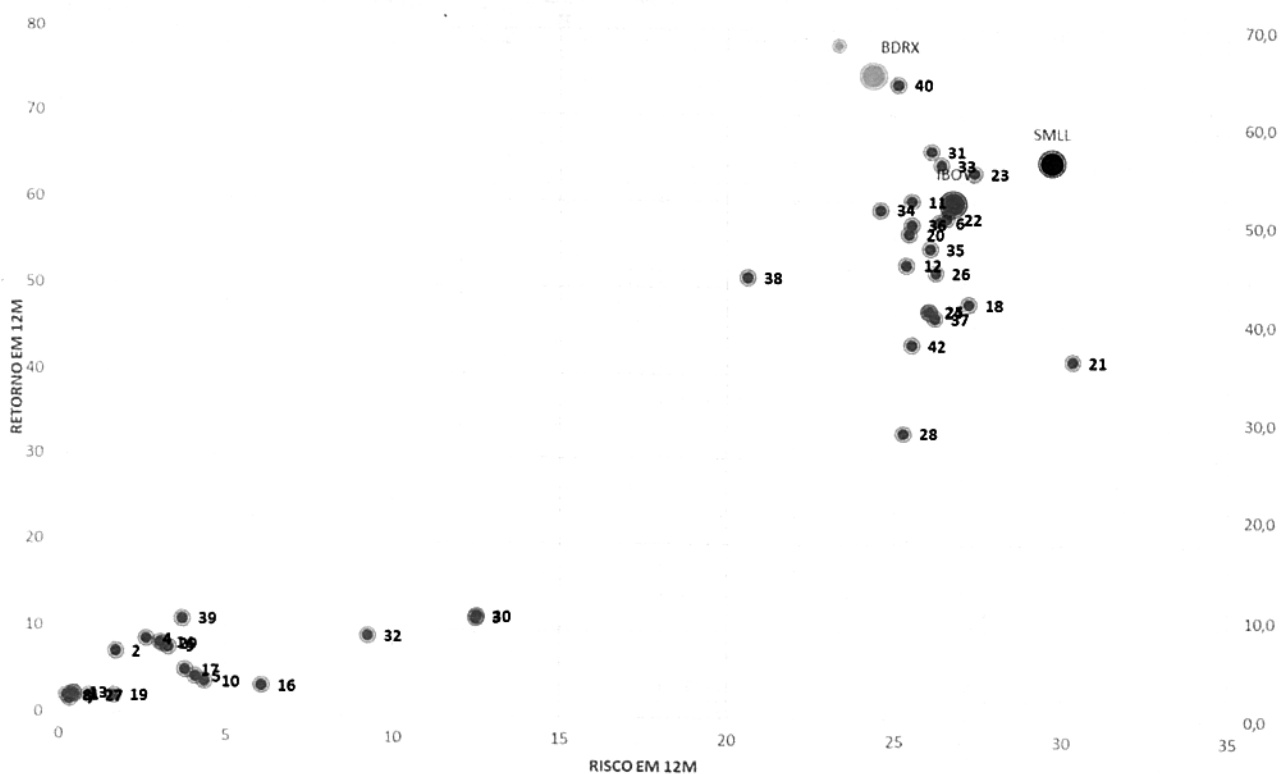


Gráfico 1: Análise Risco x Retorno (12 M)

Relatório de Investimentos – Março/2021

Nº	Fundos	Retorno	Volatilidade
1	BB Prev RF Irf M1 Tit Publ Fc	2,12	0,45
2	BB Prev RF Tit Publ VII FI	7,11	1,69
3	BB Prev RF Ima-B5+ Tp FI	11,48	12,46
4	BB Prev RF Idka 2 FI	8,63	2,62
5	BB Prev RF Alocacao Ativa Fcfi	4,35	4,08
6	BB Acoes Valor Fc FIA	57,70	26,32
7	Bradesco FI RF Maxi Poder Publico	1,64	0,32
8	Bradesco FI RF Ref DI Premium	2,05	0,23
9	Bradesco Inst FICFI RF Ima B 5	7,71	3,28
10	Bradesco Fc FI RF Alocacao Dinamica	3,86	4,36
11	Brad Fc de FIA Institucional Ibrx Alpha	60,16	25,49
12	Bradesco FIA Mid Small Caps	52,73	25,34
13	FI Caixa Brasil Irf M 1 Tp RF	2,27	0,43
14	FI Caixa Brasil Ima B 5 Tp RF LP	8,20	3,03
15	Caixa FI Brasil 2020 V Tp RF		
16	Caixa FI Brasil 2024 VI Tp RF	3,43	6,05
17	Caixa FIC Brasil Gestao Estrategica RF	5,09	3,77
18	Caixa FIA Consumo	48,20	27,21
19	Itau Instit Alocacao Dinamica RF FICFI	2,06	1,65
20	Itau Rpi Acoes Ibovespa Ativo FICFI	56,32	25,43
21	Itau Institucional Acoes Phoenix Fc FI	41,69	30,33
22	Itau Acoes Dunamis Fc	58,11	26,55
23	Small Cap Valuation Fc Acoes	63,31	27,38
24	Sant Selecao Crescimento Acoes Fc FI	47,35	25,99
25	Sant Selecao Cresc Senior Acoes Fc FI	47,40	26,01
26	Santander FI Ibovespa Ativo Instit Acoes	51,85	26,21
27	Santander RF Ativo Fc FI	1,99	0,89
28	Icatu Vanguarda Dividendos FIA	33,22	25,25
29	Icatu Vanguarda Inflacao Curta FI RF LP	8,06	3,11
30	Icatu Vang Inflacao Longa FI RF LP	11,62	12,50
31	Icatu Vanguarda Acoes Ibx FI	65,91	26,07
32	Safra Ima Institucional Fc FI RF	9,28	9,24
33	BTG Pactual Absoluto Inst FIC FIA	64,29	26,38
34	Safra Consumo Americano FIA Bdr Nivel I	59,12	24,55
35	Az Quest Small Mid Caps Inst Fc de FIA	54,57	26,05
36	Occam Fc de FIA	57,43	25,49
37	Sul America Equities FIA	46,60	26,18
38	Safra S P Reais Pb FI Mult	51,16	20,57
39	Icatu Vang FI RF Inflacao Cred Priv LP	11,03	3,68
40	BB Mult Global Select Equity Ie FI	73,76	25,07
41	BTG Pactual Economia Real FIP		
42	BTG Pactual Dividendos FIC FIA	43,53	25,49
43	Schroder Sust Acoes Glob Fc FIA Ie		
44	Genial Ms Us Growth Fc FIA Ie		
45	Genial Ms Global Brands Fc FIA Ie		

Quadro 2. Legenda Gráfico 1.

Relatório de Investimentos – Março/2021

2. VERIFICAÇÃO DE LASTRO DOS FUNDOS DE RISCO DE CRÉDITO

DATA BASE EM 31.03.21

TABELA - DURATION & YIELD POR CLASSE			
Ativo	Duration	Spread	% PL
DEB	3,36	1,80%	59,2%
CRI	0,00	0,00%	0,0%
LF	2,19	2,19%	14,0%
CDB	1,59	0,71%	0,0%
DPGE	0,00	0,00%	0,0%
NP	1,24	2,84%	1,1%
BOND	0,00	0,00%	0,0%
FIDC	0,00	0,00%	0,0%
NTN-B	3,58	-	21,9%
Over	0,00	-	3,9%
Carteira Crédito	3,11	1,89%	74,3%
Crédito - Contribuição Fundo	1,14	1,40%	74,3%
Fundo (Inclui DAP e NTN-B)	2,80	1,40%	100,0%

Quadro 03

TABELA - RATING EXTERNO*		
Rating	Financeiro	% PL
AAA	163.922.515	20,1%
AA+	125.900.334	13,8%
AA	157.160.192	17,2%
AA-	93.570.890	10,2%
A+	63.620.061	7,0%
DPGE	0	0,0%
A	0	0,0%
A-	18.797.489	2,1%
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-	9.891.895	1,1%
CCC	0	0,0%
CC	0	0,0%
C	0	0,0%
Sem Rating	26.418.044	2,9%
Tesouro / Over	234.990.890	25,7%
Total	914.272.330	100,0%

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

Quadro 04.

Relatório de Investimentos – Março/2021

TABELA - SETOR		
Setor	Financeiro	% PL
Elétrico	181.994.241	19,9%
Bancos	128.100.274	14,0%
Conc. Rodoviárias	81.655.933	8,9%
Saneamento	77.187.833	8,4%
Serviço	58.648.796	6,4%
Varejo	54.325.450	5,9%
Shopping Center	33.528.774	3,7%
Infraestrutura	19.207.613	2,1%
Logística	16.654.980	1,8%
Mineração e Siderurgia	10.908.337	1,2%
Óleo e Gás	7.620.884	0,8%
Indústria e Comércio	5.349.220	0,6%
Papel e Celulose	4.099.104	0,4%
Tesouro / Over	234.990.890	25,7%
Total	914.272.330	100,0%

Quadro 05.

Nota: Dados referentes ao fundo ICATU VANGUARDA FI RF INFLACÃO CREDITO PRIVADO LP. (base: 31/03/2021)

PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos da Fundação Amazonprev – Fundo Previdenciário do Estado do Amazonas, reunido ordinariamente no dia 16 de abril de 2021, apresenta o Relatório de Investimentos, com base no mês de março/2021, com o acompanhamento da Rentabilidade e Risco das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos do RPPS.

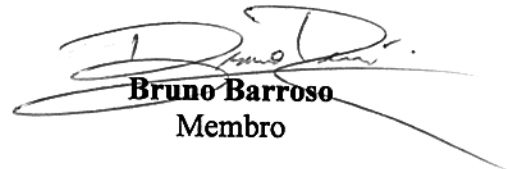
O Relatório da Carteira da Amazonprev reflete os resultados sobre as decisões de investimentos e alocações deliberadas no período, com base em análise de Cenário Econômico e Estratégia de Alocação proposta pelo Comitê de Investimentos devidamente alinhada aos termos da Política de Investimentos aprovada 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, 16 de abril 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: